

## **NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC**

**(une société d'investissement à capital variable et compartiments multiples ayant chacun des responsabilités distinctes constituée en Irlande sous forme de société à responsabilité limitée sous le numéro 267219)**

### **ÉTATS FINANCIERS CONDENSÉS NON AUDITÉS**

**Pour le semestre clos le 30 juin 2023**

*Aucune souscription ne doit être effectuée sur la seule base du rapport financier. Les souscriptions doivent être effectuées uniquement sur la base du Prospectus en vigueur, accompagné du dernier rapport annuel et du dernier rapport semestriel si ce dernier a été publié ultérieurement.*

*Les données de performance indiquées représentent la performance passée et ne garantissent pas les résultats futurs. Les performances récentes pourront être supérieures ou inférieures aux performances passées. La valeur du principal et les rendements évoluant au fil du temps (notamment du fait des fluctuations de change), le prix de rachat des actions sera supérieur ou inférieur à leur prix initial. Les performances indiquées sont nettes de toutes les charges imputées aux Fonds, mais excluent l'impact des commissions de souscription et des frais de banque correspondants, et supposent un réinvestissement des distributions. Si de tels droits et frais avaient été inclus, les rendements auraient été inférieurs. Les performances d'autres classes d'actions peuvent être supérieures ou inférieures selon les écarts de commissions et de commissions de souscription. Sauf indication contraire, tous les termes définis et utilisés dans le présent document ont le même sens que celui qui leur est donné dans le prospectus de la Société.*

## NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

| Table des matières                                                                                                        | Page |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|
| <b>Organisation</b> .....                                                                                                 | 3    |
| <b>Présentation de la Société</b> .....                                                                                   | 4    |
| <b>Rapports du Gestionnaire Financier</b> .....                                                                           | 17   |
| <b>État condensé de la situation financière</b> .....                                                                     | 24   |
| <b>Compte de résultat global condensé</b> .....                                                                           | 26   |
| <b>État condensé des variations de l'actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables</b> ..... | 28   |
| <b>État condensé des flux de trésorerie</b> .....                                                                         | 30   |
| <b>Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023</b> .....                                               | 32   |
| <b>Calendrier des investissements</b>                                                                                     |      |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND .....                                      | 59   |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND .....                                             | 77   |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND .....                               | 93   |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND .....                                 | 104  |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND .....                                         | 131  |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND .....                                             | 139  |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND .....                                 | 151  |
| <b>Calendrier des Évolutions du Portefeuille</b>                                                                          |      |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND .....                                      | 162  |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND .....                                             | 164  |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND .....                               | 166  |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND .....                                 | 168  |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND .....                                         | 170  |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND .....                                             | 172  |
| NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I – LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND .....                                 | 174  |
| <b>ANNEXE I – Divulgence de la performance</b> .....                                                                      | 176  |
| <b>ANNEXE II – Règlement sur les opérations de financement sur titres</b> .....                                           | 184  |

## NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

### Organisation

#### Conseil d'administration\*

Daniel Morrissey (Irlandais)\*\*  
Jason Trepanier (Américain)\*\*+  
Lynda Wood (née Schweitzer) (Américaine)\*\*\*  
John Nolan (Irlandais)\*\*  
Christopher Yiannakou (Britannique) \*\*\*\*

\* Voir le Rapport des Administrateurs dans les états financiers audités pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 – Déclaration de gouvernance et composition du Conseil d'Administration

\*\* Administrateur indépendant du Gestionnaire Financier

\*\*\* Dirigeante exécutive du Gestionnaire Financier

\*\*\*\* Dirigeant exécutif de Loomis Sayles Investments Limited, UK (filiale à part entière du Gestionnaire Financier)

+ Administrateur exécutif de la Société de gestion et du Promoteur et Distributeur

#### Siège social

6th Floor  
2 Grand Canal Square  
Dublin  
D02 A342  
Irlande

#### Agent administratif, Agent de registre et de transfert

Brown Brothers Harriman Fund Administration  
Services (Ireland) Limited  
30 Herbert Street  
Dublin  
D02 W329  
Irlande

#### Dépositaire

Brown Brothers Harriman Trustee Services  
(Ireland) Limited  
30 Herbert Street  
Dublin  
D02 W329  
Irlande

#### Secrétaire

Wilton Secretarial Limited  
6th Floor  
2 Grand Canal Square  
Dublin  
D02 A342  
Irlande

#### Société de gestion et Promoteur

Natixis Investment Managers S.A.  
2 rue Jean Monnet  
L-2180 Luxembourg  
Grand-Duché de Luxembourg

#### Distributeur

Natixis Investment Managers  
International 43, avenue Pierre  
Mendès-France  
CS 41432  
75648 Paris cedex 13  
France

#### Gestionnaire financier

Loomis, Sayles & Company, L.P.  
One Financial Center  
Boston  
Massachusetts 02111  
États-Unis

#### Conseiller juridique de la Société

William Fry LLP  
2 Grand Canal Square  
Dublin  
D02 A342  
Irlande

#### Commissaires aux comptes indépendants

PricewaterhouseCoopers  
Chartered Accountants & Registered  
Auditors  
One Spencer Dock  
International Financial Services Centre  
Dublin  
D01 X9R7  
Irlande

#### Représentant à Hong Kong

Brown Brothers Harriman (Hong Kong)  
Limited  
Level 13, Man Yee Building,  
68 Des Voeux Road,  
Central  
Hong Kong

## NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

### Présentation de la Société

Les informations suivantes sont tirées du prospectus ; elles doivent être lues conjointement avec le texte intégral et les définitions de la section correspondante dudit prospectus.

Natixis International Funds (Dublin) I plc (ci-après la « Société »), constituée le 26 juin 1997 en vertu du Droit irlandais en tant que société ouverte à responsabilité limitée (public limited company –PLC) conformément à la Loi sur les sociétés de 2014 (Companies Act 2014), est structurée comme une société d'investissement à capital variable et à compartiments multiples ayant chacun des responsabilités distinctes. La Société est agréée par la Banque centrale d'Irlande (Central Bank of Ireland) (la « Banque centrale ») comme société d'investissement, conformément aux dispositions de la Réglementation (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) des Communautés européennes 2011, telle qu'amendée (ci-après la « Réglementation OPCVM »). La Société a débuté ses activités le 30 juin 1997.

Sept Fonds (les « Fonds ») présentent actuellement des Actions participantes remboursables\* en circulation, Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Multisector Income Fund\*\* (ci-après le « Loomis Sayles Multisector Income Fund »), Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles High Income Fund\*\*\* (ci-après le « Loomis Sayles High Income Fund »), Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund\*\*\* (ci-après le « Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund »), Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund\*\*\* (ci-après le « Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund »), Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Euro High Yield Fund\*\*\* (ci-après le « Loomis Sayles Euro High Yield Fund »), Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Euro Credit Fund\*\*\* (ci-après le « Loomis Sayles Euro Credit ») et Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund\*\*\* (ci-après le « Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund »).

### Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers

Classification du Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (SFDR) :

| Fonds                                                                                 | Classification |
|---------------------------------------------------------------------------------------|----------------|
| Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Multisector Income Fund        | 6              |
| Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles High Income Fund               | 6              |
| Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund | 8              |
| Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund   | 6              |
| Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Euro High Yield Fund           | 8              |
| Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Euro Credit Fund               | 8              |
| Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund   | 8              |

**Présentation de la Société (suite)**

**Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (suite)**

**Compartiments relevant de l'Article 6**

Les investissements sous-jacents de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

**Compartiments relevant de l'Article 8**

Les Compartiments suivants promeuvent, entre autres caractéristiques, des caractéristiques environnementales et/ou sociales ou une combinaison de ces caractéristiques, à condition que les sociétés dans lesquelles les investissements sont réalisés suivent de bonnes pratiques de gouvernance et, à ce titre, relèvent de l'Article 8 du Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers : Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund, Loomis Sayles Euro High Yield Fund, Loomis Sayles Euro Credit Fund, Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund.

- \* Les Actions participantes remboursables mentionnées dans le rapport sont des « Actions participantes » remboursables telles que définies dans le Prospectus de la Société.
- \*\* Autorisé à Hong Kong et disponible au public à Hong Kong.
- \*\*\* Non autorisé à Hong Kong et non disponible au public à Hong Kong.

## NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

### Présentation de la Société (suite)

Au 30 juin 2023, la Société permet de souscrire les classes d'Actions suivantes dans chacun des Fonds :

| Loomis Sayles Multisector Income Fund | Loomis Sayles High Income Fund | Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund | Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund | Loomis Sayles Euro High Yield Fund | Loomis Sayles Euro Credit Fund | Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund |
|---------------------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|--------------------------------------------|
| Classe d'Actions C/A (USD)            | Classe d'Actions C/A (USD)     | Classe d'Actions C/A (USD)                   | Classe d'Actions H-R/D (EUR)               | Classe d'Actions I/A (EUR)         | Classe d'Actions I/A (EUR)     | Classe d'Actions I/A (EUR)                 |
| Classe d'Actions C/D (USD)            | Classe d'Actions C/D (USD)     | Classe d'Actions C/D (USD)                   | Classe d'Actions H-RE/A (EUR)              | Classe d'Actions I/D (EUR)         | Classe d'Actions I/D (EUR)     | Classe d'Actions I/D (EUR)                 |
| Classe d'Actions CT/A (USD)           | Classe d'Actions CT/DM (USD)   | Classe d'Actions F/D (USD)                   | Classe d'Actions H-RE/D (EUR)              | Classe d'Actions H-I/A (GBP)       | Classe d'Actions H-I/A (GBP)   | Classe d'Actions H-I/A (GBP)               |
| Classe d'Actions CT/DG (USD)          | Classe d'Actions F/A (USD)     | Classe d'Actions I/A (EUR)                   | Classe d'Actions I/A (USD)                 | Classe d'Actions H-I/D (GBP)       | Classe d'Actions H-I/D (GBP)   | Classe d'Actions H-I/D (GBP)               |
| Classe d'Actions CT/DM (USD)          | Classe d'Actions I/A (EUR)     | Classe d'Actions I/A (USD)                   | Classe d'Actions I/A (GBP)                 | Classe d'Actions H-I/A (CHF)       | Classe d'Actions H-I/A (CHF)   | Classe d'Actions H-I/A (CHF)               |
| Classe d'Actions CW/A (EUR)           | Classe d'Actions I/A (USD)     | Classe d'Actions I/A (SGD)                   | Classe d'Actions I/D (USD)                 | Classe d'Actions N/A (EUR)         | Classe d'Actions N/A (EUR)     | Classe d'Actions N/A (EUR)                 |
| Classe d'Actions H-CW/A (EUR)         | Classe d'Actions I/A (SGD)     | Classe d'Actions I/D (GBP)                   | Classe d'Actions N/A (USD)                 | Classe d'Actions N/D (EUR)         | Classe d'Actions N/D (EUR)     | Classe d'Actions N/D (EUR)                 |
| Classe d'Actions F/A (USD)            | Classe d'Actions I/D (GBP)     | Classe d'Actions I/D (USD)                   | Classe d'Actions N/A (EUR)                 | Classe d'Actions H-N/A (GBP)       | Classe d'Actions H-N/A (GBP)   | Classe d'Actions H-N/A (GBP)               |
| Classe d'Actions F/DM (USD)           | Classe d'Actions I/D (USD)     | Classe d'Actions I/D (SGD)                   | Classe d'Actions R/A (USD)                 | Classe d'Actions H-N/D (GBP)       | Classe d'Actions H-N/D (GBP)   | Classe d'Actions H-N/D (GBP)               |
| Classe d'Actions I/A (EUR)            | Classe d'Actions I/D (JPY)     | Classe d'Actions H-I/A (EUR)                 | Classe d'Actions S/A (EUR)                 | Classe d'Actions H-N/A (CHF)       | Classe d'Actions H-N/A (CHF)   | Classe d'Actions H-N/A (CHF)               |
| Classe d'Actions I/A (USD)            | Classe d'Actions I/D (SGD)     | Classe d'Actions H-I/A (USD)                 | Classe d'Actions S/A (USD)                 | Classe d'Actions R/A (EUR)         | Classe d'Actions R/A (EUR)     | Classe d'Actions R/A (EUR)                 |
| Classe d'Actions I/A (SGD)            | Classe d'Actions H-I/A (EUR)   | Classe d'Actions H-I/A (SGD)                 | Classe d'Actions S/A (GBP)                 | Classe d'Actions R/D (EUR)         | Classe d'Actions R/D (EUR)     | Classe d'Actions R/D (EUR)                 |
| Classe d'Actions I/D (GBP)            | Classe d'Actions H-I/A (CHF)   | Classe d'Actions H-I/A (AUD)                 | Classe d'Actions S/D (USD)                 | Classe d'Actions H-R/A (CHF)       | Classe d'Actions H-R/A (CHF)   | Classe d'Actions H-R/A (CHF)               |
| Classe d'Actions I/D (USD)            | Classe d'Actions H-I/A (SGD)   | Classe d'Actions H-I/A (SEK)                 | Classe d'Actions H-Q/A (EUR)               | Classe d'Actions RE/A (EUR)        | Classe d'Actions RE/A (EUR)    | Classe d'Actions RE/A (EUR)                |
| Classe d'Actions I/D (SGD)            | Classe d'Actions H-I/D (EUR)   | Classe d'Actions H-I/D (EUR)                 | Classe d'Actions H-I/A (EUR)               | Classe d'Actions RE/D (EUR)        | Classe d'Actions RE/D (EUR)    | Classe d'Actions RE/D (EUR)                |
| Classe d'Actions I/DG (USD)           | Classe d'Actions H-I/D (GBP)   | Classe d'Actions H-I/D (GBP)                 | Classe d'Actions H-R/A (EUR)               | Classe d'Actions H-RE/A (CHF)      | Classe d'Actions H-RE/A (CHF)  | Classe d'Actions H-RE/A (CHF)              |
| Classe d'Actions H-I/A (EUR)          | Classe d'Actions H-I/D (SGD)   | Classe d'Actions H-I/D (SGD)                 |                                            | Classe d'Actions S/A (EUR)         | Classe d'Actions S/A (EUR)     | Classe d'Actions S/A (EUR)                 |
| Classe d'Actions H-I/A (SGD)          | Classe d'Actions N/A (USD)     | Classe d'Actions N/A (USD)                   |                                            | Classe d'Actions S/D (EUR)         | Classe d'Actions S/D (EUR)     | Classe d'Actions S/D (EUR)                 |
| Classe d'Actions H-I/A (SEK)          | Classe d'Actions N/A (EUR)     | Classe d'Actions N/A (EUR)                   |                                            | Classe d'Actions H-S/A (GBP)       | Classe d'Actions H-S/A (GBP)   | Classe d'Actions H-S/A (GBP)               |
| Classe d'Actions H-I/D (EUR)          | Classe d'Actions N/DM (USD)    | Classe d'Actions N/DM (USD)                  |                                            | Classe d'Actions H-S/D (GBP)       | Classe d'Actions H-S/D (GBP)   | Classe d'Actions H-S/D (GBP)               |
| Classe d'Actions H-I/D (GBP)          | Classe d'Actions H-N/A (EUR)   | Classe d'Actions H-N/A (EUR)                 |                                            | Classe d'Actions H-S/A (CHF)       | Classe d'Actions H-S/A (CHF)   | Classe d'Actions H-S/A (CHF)               |
| Classe d'Actions H-I/D (SGD)          | Classe d'Actions H-N/A (GBP)   | Classe d'Actions H-N/A (GBP)                 |                                            | Classe d'Actions S2/A (EUR)        | Classe d'Actions S2/A (EUR)    | Classe d'Actions S2/A (EUR)                |
| Classe d'Actions H-I/D (SEK)          | Classe d'Actions H-N/A (CHF)   | Classe d'Actions H-N/A (CHF)                 |                                            | Classe d'Actions S2/D (EUR)        | Classe d'Actions S2/D (EUR)    | Classe d'Actions S2/D (EUR)                |
| Classe d'Actions J/DM (USD)           | Classe d'Actions H-N/D (EUR)   | Classe d'Actions H-N/D (EUR)                 |                                            | Classe d'Actions H-S2/A (GBP)      | Classe d'Actions H-S2/A (GBP)  | Classe d'Actions S3/A (EUR)                |
| Classe d'Actions N/A (USD)            | Classe d'Actions H-N/D (GBP)   | Classe d'Actions H-N/D (GBP)                 |                                            | Classe d'Actions H-S2/D (GBP)      | Classe d'Actions H-S2/D (GBP)  | Classe d'Actions S3/D (EUR)                |
| Classe d'Actions N/A (EUR)            | Classe d'Actions H-N/D (CHF)   | Classe d'Actions H-N/D (CHF)                 |                                            | Classe d'Actions H-S2/A (CHF)      | Classe d'Actions H-S2/A (CHF)  | Classe d'Actions H-S2/A (GBP)              |
| Classe d'Actions N/DM (USD)           | Classe d'Actions H-N/DM (GBP)  | Classe d'Actions H-N/DM (GBP)                |                                            | Classe d'Actions Q/A (EUR)         | Classe d'Actions Q/A (EUR)     | Classe d'Actions H-S2/D (GBP)              |
| Classe d'Actions H-N/A (EUR)          | Classe d'Actions N1/A (USD)    | Classe d'Actions N1/A (USD)                  |                                            |                                    | Classe d'Actions S1/A (EUR)    | Classe d'Actions H-S2/A (CHF)              |

## NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

### Présentation de la Société (suite)

| Loomis Sayles Multisector Income Fund | Loomis Sayles High Income Fund | Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund | Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund | Loomis Sayles Euro High Yield Fund | Loomis Sayles Euro Credit Fund | Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund |
|---------------------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|--------------------------------------------|
| Classe d'Actions H-N/A (CHF)          | Classe d'Actions H-N1/A (EUR)  | Classe d'Actions N1/A (EUR)                  |                                            |                                    | Classe d'Actions H-S2/A (USD)  | Classe d'Actions Q/A (EUR)                 |
| Classe d'Actions H-N/A (GBP)          | Classe d'Actions H-N1/A (CHF)  | Classe d'Actions R/A (EUR)                   |                                            |                                    | Classe d'Actions H-S/A (USD)   |                                            |
| Classe d'Actions H-N/D (EUR)          | Classe d'Actions R/A (EUR)     | Classe d'Actions R/A (USD)                   |                                            |                                    | Classe d'Actions H-I/A (USD)   |                                            |
| Classe d'Actions H-N/D (GBP)          | Classe d'Actions R/A (USD)     | Classe d'Actions R/A (SGD)                   |                                            |                                    | Classe d'Actions H-N/A (USD)   |                                            |
| Classe d'Actions H-N/D (CHF)          | Classe d'Actions R/A (SGD)     | Classe d'Actions R/D (EUR)                   |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions H-N/DM (GBP)         | Classe d'Actions R/D (EUR)     | Classe d'Actions R/D (GBP)                   |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions N1/A (USD)           | Classe d'Actions R/D (GBP)     | Classe d'Actions R/D (USD)                   |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions N1/A (EUR)           | Classe d'Actions R/D (USD)     | Classe d'Actions R/D (SGD)                   |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions N1/D (USD)           | Classe d'Actions R/D (SGD)     | Classe d'Actions H-R/A (EUR)                 |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions H-N1/A (EUR)         | Classe d'Actions R/DM (USD)    | Classe d'Actions H-R/A (SGD)                 |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions R/A (EUR)            | Classe d'Actions H-R/A (EUR)   | Classe d'Actions H-R/A (SEK)                 |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions R/A (USD)            | Classe d'Actions H-R/A (SGD)   | Classe d'Actions H-R/D (EUR)                 |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions R/A (SGD)            | Classe d'Actions H-R/D (EUR)   | Classe d'Actions H-R/D (SGD)                 |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions R/D (EUR)            | Classe d'Actions H-R/D (SGD)   | Classe d'Actions RE/A (EUR)                  |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions R/D (GBP)            | Classe d'Actions RE/A (EUR)    | Classe d'Actions RE/A (USD)                  |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions R/D (USD)            | Classe d'Actions RE/A (USD)    | Classe d'Actions RE/D (EUR)                  |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions R/D (SGD)            | Classe d'Actions RE/D (EUR)    | Classe d'Actions RE/D (USD)                  |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions R/DG (USD)           | Classe d'Actions RE/D (USD)    | Classe d'Actions RE/DM (USD)                 |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions R/DM (USD)           | Classe d'Actions H-RE/A (EUR)  | Classe d'Actions H-RE/A (EUR)                |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions H-R/A (EUR)          | Classe d'Actions H-RE/D (EUR)  | Classe d'Actions H-RE/D (EUR)                |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions H-R/A (SGD)          | Classe d'Actions S/A (EUR)     | Classe d'Actions S/A (EUR)                   |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions H-R/A (SEK)          | Classe d'Actions S/A (USD)     | Classe d'Actions S/A (USD)                   |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions H-R/D (EUR)          | Classe d'Actions S/A (SGD)     | Classe d'Actions S/A (SGD)                   |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions H-R/D (SGD)          | Classe d'Actions S/D (GBP)     | Classe d'Actions S/D (GBP)                   |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions H-R/D (SEK)          | Classe d'Actions S/D (USD)     | Classe d'Actions S/D (USD)                   |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions H-R/DM (AUD)         | Classe d'Actions S/D (JPY)     | Classe d'Actions S/D (SGD)                   |                                            |                                    |                                |                                            |
| Classe d'Actions H-R/DM (SGD)         | Classe d'Actions S/D (SGD)     | Classe d'Actions H-S/A (EUR)                 |                                            |                                    |                                |                                            |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Présentation de la Société (suite)

| Loomis Sayles Multisector Income Fund | Loomis Sayles High Income Fund | Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund |  |  |  |  |
|---------------------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|--|--|--|--|
| Classe d'Actions RE/A (EUR)           | Classe d'Actions H-S/A (EUR)   | Classe d'Actions H-S/A (USD)                 |  |  |  |  |
| Classe d'Actions RE/A (USD)           | Classe d'Actions H-S/A (CHF)   | Classe d'Actions H-S/A (SGD)                 |  |  |  |  |
| Classe d'Actions RE/D (EUR)           | Classe d'Actions H-S/A (SGD)   | Classe d'Actions H-S/A (NOK)                 |  |  |  |  |
| Classe d'Actions RE/D (USD)           | Classe d'Actions H-S/D (EUR)   | Classe d'Actions H-S/A (AUD)                 |  |  |  |  |
| Classe d'Actions RE/DM (USD)          | Classe d'Actions H-S/D (GBP)   | Classe d'Actions H-S/A (SEK)                 |  |  |  |  |
| Classe d'Actions H-RE/A (EUR)         | Classe d'Actions Q/A (USD)     | Classe d'Actions H-S/D (EUR)                 |  |  |  |  |
| Classe d'Actions H-RE/D (EUR)         |                                | Classe d'Actions H-S/D (GBP)                 |  |  |  |  |
| Classe d'Actions H-RE/DM (AUD)        |                                | Classe d'Actions H-S/D (SGD)                 |  |  |  |  |
| Classe d'Actions S/A (EUR)            |                                |                                              |  |  |  |  |
| Classe d'Actions S/A (USD)            |                                |                                              |  |  |  |  |
| Classe d'Actions S/A (SGD)            |                                |                                              |  |  |  |  |
| Classe d'Actions S/D (GBP)            |                                |                                              |  |  |  |  |
| Classe d'Actions S/D (USD)            |                                |                                              |  |  |  |  |
| Classe d'Actions S/D (SGD)            |                                |                                              |  |  |  |  |
| Classe d'Actions H-S/A (EUR)          |                                |                                              |  |  |  |  |
| Classe d'Actions H-S/A (SGD)          |                                |                                              |  |  |  |  |
| Classe d'Actions H-S/A (SEK)          |                                |                                              |  |  |  |  |
| Classe d'Actions H-S/D (EUR)          |                                |                                              |  |  |  |  |
| Classe d'Actions H-S/D (GBP)          |                                |                                              |  |  |  |  |
| Classe d'Actions H-S/D (SEK)          |                                |                                              |  |  |  |  |
|                                       |                                |                                              |  |  |  |  |
|                                       |                                |                                              |  |  |  |  |
|                                       |                                |                                              |  |  |  |  |
|                                       |                                |                                              |  |  |  |  |
|                                       |                                |                                              |  |  |  |  |
|                                       |                                |                                              |  |  |  |  |



## NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

### Présentation de la Société (suite)

Chaque classe d'actions est proposée à des investisseurs spécifiquement ciblés :

| Investisseurs ciblés          | Classe d'Actions proposée                                                            |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|
| Investisseurs particuliers    | Classe C, Classe CT, Classe CW, Classe F, Classe N, Classe N1, Classe R et Classe RE |
| Investisseurs institutionnels | Classe I, Classe J, Classe S, Classe S2 et Classe Q                                  |

La monnaie fonctionnelle des Loomis Sayles Multisector Income Fund, Loomis Sayles High Income Fund, Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund et Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund est actuellement le dollar américain (USD).

La devise de référence des Fonds Loomis Sayles Euro High Yield Fund, Loomis Sayles Euro Credit Fund et Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund est actuellement l'euro (EUR).

Les classes d'actions de chaque Fonds étaient libellées comme suit au 30 juin 2023 :

| Devise                     | Classe d'Actions                                                                                                                                                                                             |
|----------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Dollar américain (USD)     | Classe C, Classe CT, Classe F, Classe H-I, Classe H-S, Classe I, Classe J, Classe N, Classe N1, Classe R, Classe RE et Classe S                                                                              |
| Euro (EUR)                 | Classe CW, Classe H-CW, Classe H-I, Classe H-N, Classe H-N1, Classe H-Q, Classe H-R, Classe H-RE, Classe H-S, Classe I, Classe N, Classe N1, Classe Q, Classe R, Classe RE, Classe S, Classe S2 et Classe S3 |
| Livre sterling (GBP)       | Classe H-I, Classe H-N, Classe H-S, Classe H-S2, Classe I, Classe R et Classe S                                                                                                                              |
| Couronne norvégienne (NOK) | Classe H-S                                                                                                                                                                                                   |
| Couronne suédoise (SEK)    | Classe H-I, Classe H-R et Classe H-S                                                                                                                                                                         |
| Dollar de Singapour (SGD)  | Classe H-I, Classe H-R, Classe H-S, Classe I, Classe R et Classe S                                                                                                                                           |
| Yen japonais (JPY)         | Classe I et Classe S                                                                                                                                                                                         |
| Franc suisse (CHF)         | Classe H-I, Classe H-N, Classe H-N1, Classe H-R, Classe H-RE, Classe H-S et Classe H-S2                                                                                                                      |
| Dollar australien (AUD)    | Classe H-I, Classe H-S, Classe H-R et Classe H-RE                                                                                                                                                            |

Au 30 juin 2023, aucune classe d'actions CW ou J n'était émise.

### Objectifs et politiques d'investissement

#### Loomis Sayles Multisector Income Fund

L'objectif d'investissement du Loomis Sayles Multisector Income Fund (ci-après le « Fonds ») est de générer un rendement total élevé en combinant des revenus courants et une appréciation du capital. Le Fonds investit au moins 80 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des obligations et autres titres obligataires assimilés émis ou garantis par le gouvernement américain ou ses autorités ou agences et des titres obligataires émis par des entités supranationales comme la Banque mondiale, ainsi que dans des effets de commerce, des titres à coupon zéro, des ABS (titres garantis par des actifs), des MBS (titres garantis par des prêts hypothécaires), parmi lesquels des CMO (obligations garanties par créances hypothécaires), des titres vendus avant l'émission, des titres régis par la Regulation S, des titres régis par la Rule 144A, des obligations structurées et des titres convertibles conformément à la Réglementation OPCVM.

Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur d'inventaire nette en titres autres que ceux susmentionnés, tels que des actions ordinaires, des actions privilégiées et des real estate investment trusts (« REIT ») américains. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa Valeur d'inventaire nette en parts d'organismes de placement collectif. Le Fonds peut investir tout montant de son actif dans les titres d'émetteurs américains et canadiens (à condition qu'ils soient cotés ou négociés internationalement sur les marchés définis dans le Prospectus) et jusqu'à 30 % de sa Valeur d'inventaire nette dans les titres d'autres émetteurs non américains et non canadiens, y compris ceux d'émetteurs des pays émergents. Le Fonds peut investir tout montant de sa Valeur d'inventaire nette en titres d'émetteurs supranationaux. Le Fonds peut investir en titres libellés dans n'importe quelle devise, y compris dans les monnaies des marchés émergents. Le Fonds peut investir en titres de n'importe quelle échéance. Le Fonds peut également investir jusqu'à 35 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des titres dont la notation est inférieure à investment grade. Les titres dont la notation est inférieure à investment grade sont des titres dont la notation est inférieure à BBB- (Standard & Poor's Rating Services), Baa3 (Moody's Investor Service, Inc.) ou à une notation équivalente par Fitch Ratings ou, si aucune notation n'est attribuée, à une notation que la Société de gestion ou tout Gestionnaire financier juge de qualité équivalente. Le Fonds n'impose aucune limite au montant de son actif pouvant être investi dans des espèces ou des instruments du marché monétaire.

## Présentation de la Société (suite)

### Objectifs et politiques d'investissement (suite)

#### Loomis Sayles High Income Fund

L'objectif d'investissement du Loomis Sayles High Income Fund (ci-après le « Fonds ») est de générer un rendement total élevé en combinant des revenus courants et une appréciation du capital. Le Fonds investit au moins 51 % de sa Valeur d'inventaire nette en titres obligataires, lesquels sont cotés ou négociés internationalement sur les marchés définis dans le Prospectus. Les titres obligataires dans lesquels le Fonds peut investir incluent les titres d'entreprises, les titres émis ou garantis par le gouvernement américain ou ses autorités ou ses agences (ci-après les « obligations d'État américaines »), ou des entités supranationales (comme la Banque mondiale), les effets de commerce, les titres à coupon zéro, les titres garantis par des prêts hypothécaires, les obligations garanties par créances hypothécaires, les titres garantis par des actifs, les sociétés américaines d'investissement immobilier (Real Estate Investment Trust ou « REIT »), les titres régis par la Regulation S, les titres régis par la Rule 144A et les titres convertibles conformément à la Réglementation OPCVM.

Le Fonds peut investir jusqu'à 49 % de sa Valeur d'inventaire nette en liquidités ou dans d'autres types de titres que ceux décrits ci-dessus. Le Fonds n'investit pas plus de 20 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des actions privilégiées, pas plus de 10 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des actions ordinaires et pas plus de 10 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des parts d'organismes de placement collectif. Il peut également investir tout montant de sa Valeur d'inventaire nette dans les titres d'émetteurs américains, canadiens et supranationaux, et jusqu'à 50 % de sa Valeur d'inventaire nette dans les titres d'autres émetteurs non américains, non canadiens et non supranationaux. Le Fonds peut investir toute partie de son actif en titres dont la notation est inférieure à investment grade.

#### Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

L'objectif d'investissement du Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (ci-après le « Fonds ») est de générer un rendement total élevé en combinant des revenus courants et une appréciation du capital. Le Fonds investit principalement dans des titres obligataires d'émetteurs du monde entier, sélectionnés en fonction des opportunités qui se présentent. Le Fonds investit au moins deux tiers de sa Valeur d'inventaire nette en titres obligataires de qualité investment grade émis par des émetteurs établis partout dans le monde, qui sont cotés ou négociés sur les marchés mondiaux définis dans le Prospectus et, à des fins de couverture du risque et de gestion efficace de portefeuille, dans des devises internationales, y compris des opérations de change. Les titres obligataires dans lesquels le Fonds peut investir incluent des titres d'entreprises, des titres obligataires émis ou garantis par des gouvernements souverains ou des organismes publics internationaux ainsi que des titres à coupon zéro, des titres régis par la Regulation S, des titres régis par la Rule 144A, des titres adossés à des actifs et des titres garantis par des prêts hypothécaires. Les titres obligataires investment grade sont des titres dont la notation est au moins égale à BBB- (Standard & Poor's Ratings Services), Baa3 (Moody's Investors Services, Inc.), ou une notation équivalente par Fitch Ratings, ou, si aucune notation n'est attribuée, qui possèdent selon le Gestionnaire Financier une qualité comparable.

Le Fonds peut investir en titres obligataires libellés dans n'importe quelle devise et émis par des émetteurs de pays émergents. Le Fonds peut investir en titres obligataires de n'importe quelle échéance. Le Fonds peut investir dans des devises autres que la Devise de référence.

Le Fonds peut investir jusqu'à un tiers de sa Valeur d'inventaire nette dans des liquidités ou des titres autres que ceux susmentionnés, tels que des obligations hybrides, des effets de commerce, des obligations garanties par créances hypothécaires, des titres convertibles, des actions et autres titres assimilés conformément à la Réglementation OPCVM, et jusqu'à 20 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des titres dont la notation est inférieure à investment grade (communément appelés « junk bonds »). Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa Valeur d'inventaire nette en parts d'organismes de placement collectif. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa Valeur d'inventaire nette en titres obligataires cotés sur le marché d'obligations interbancaire de Chine grâce à l'accès réciproque aux marchés d'obligations entre la Chine continentale et Hong Kong (le « Bond Connect »). Le Fonds ne peut investir plus de 25 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des obligations convertibles ni plus de 10 % de sa Valeur d'inventaire nette en actions et autres titres assimilés, tels que les actions ordinaires, les warrants et les depositary receipts représentant de ce genre.

#### Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund

L'objectif d'investissement du Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (le « Fonds ») consiste à chercher à atteindre un rendement absolu positif et une croissance du capital. Le Fonds cherchera à atteindre cet objectif d'investissement en cherchant à obtenir des primes de risque liées à plusieurs facteurs d'investissement dans un large éventail de classes d'actifs.

**Présentation de la Société (suite)**

**Objectifs et politiques d'investissement (suite)**

Le Fonds cherchera à investir dans le monde entier dans toute la gamme des investissements autorisés, à savoir les titres de créance, les actions, les actions ou les parts d'organismes de placement collectif (y compris les fonds cotés en bourse), les instruments dérivés, les liquidités et les quasi-liquidités. Le Fonds peut recourir de manière significative aux instruments dérivés. Le Fonds peut également être exposé aux matières premières par le biais de titres de créance indiciels cotés (ETN) admissibles considérés comme des valeurs mobilières au sens de la Règle 3(1) du Règlement, et par le biais de swaps de rendement total (TRS).

Les titres de créance dans lesquels le Fonds peut investir comprennent des obligations publiques (par exemple les obligations d'État) ou les obligations privées (par exemple les obligations d'entreprises). Ils sont émis ou garantis par des émetteurs du monde entier, y compris, mais sans s'y limiter, des entreprises, des gouvernements (y compris leurs administrations, organismes et entités parrainées) et des entités supranationales (par exemple la Banque mondiale). Le Fonds peut investir dans des titres à taux variable, des effets de commerce, des titres régis par la Regulation S, des titres régis par la Rule 144A et des titres convertibles émis par des entreprises.

Le Fonds peut investir n'importe quelle proportion de sa Valeur d'inventaire nette dans des titres dont la notation est investment grade et inférieure à investment grade. Les titres investment grade sont des titres dont la notation est supérieure à BBB- (Standard & Poor's Ratings Services), Baa3 (Moody's Investors Services, Inc.), ou une notation équivalente par Fitch Ratings, ou, si aucune notation n'est attribuée, qui possèdent selon le Gestionnaire Financier une qualité comparable. Les titres dont la notation est inférieure à investment grade sont des titres notés en deçà de BBB- (Standard & Poor's Ratings Services), Baa3 (Moody's Investors Service, Inc.), ou d'une notation équivalente par Fitch Ratings, ou, si aucune notation n'est attribuée, qui possèdent des caractéristiques que le Gestionnaire Financier juge de qualité équivalente.

Les titres de participation dans lesquels le Fonds peut investir sont des actions ordinaires, des actions privilégiées, des instruments liés à des actions à titre accessoire tels que warrants et billets indexés sur actions dont la valeur est dérivée de la valeur des actions concernées, et des certificats négociables pour n'importe lesquels de ces titres.

Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des organismes de placement collectif, y compris, mais sans s'y limiter, des fonds indiciels cotés ayant le statut d'OPCVM.

À des fins d'investissement et de gestion efficace de portefeuille, le Fonds peut :

- conclure des contrats à terme normalisés et des options sur des indices financiers, des actions, des titres de créance et des taux d'intérêt afin d'obtenir une exposition mondiale sur l'ensemble de la gamme d'actifs autorisés, y compris les actions et les titres de créance ;
- conclure des contrats à terme normalisés et des options sur les devises, et des contrats de change à terme permettant au Fonds d'obtenir une exposition à diverses devises ;
- conclure des swaps de rendement total sur indices financiers afin d'obtenir une exposition à des matières premières ou actifs dont l'accès par le biais d'investissements traditionnels en titres physiques pourrait autrement être inefficace ou onéreux ;
- s'engager sur le marché des dérivés de crédit en concluant des swaps de défaillance de crédit et en obtenant des expositions aux indices basés sur le crédit par le biais de contrats à terme normalisés et d'options sur ces indices afin de vendre et d'acheter une protection ;
- conclure des swaps de taux d'intérêt afin d'extraire de manière adéquate la prime de taux des marchés mondiaux en échangeant des paiements d'intérêts à taux fixe (sur un marché haussier) contre des paiements d'intérêts à taux variable (sur un marché baissier) ou inversement (selon les fluctuations du marché) ; et
- investir dans des ETN afin d'obtenir une exposition indirecte aux matières premières.

Pour soutenir l'utilisation des instruments dérivés par le Fonds, celui-ci peut investir dans des instruments du marché monétaire, des titres de créance à court terme et conserver des liquidités. Les instruments du marché monétaire, les titres de créance à court terme, les liquidités et quasi-liquidités peuvent comprendre, entre autres, des certificats de dépôt, des effets de commerce, des bons du Trésor américain, des titres de créance de sociétés (comme des obligations d'entreprises) et des obligations à court terme émises ou garanties par des États souverains, des organismes internationaux publics ou d'autres émetteurs publics et des dépôts à terme.

**Présentation de la Société (suite)**

**Objectifs et politiques d'investissement (suite)**

En plus de prendre des positions longues sur chacune des classes d'actifs mentionnées ci-dessus, le Fonds peut prendre des positions courtes synthétiques par le biais d'instruments dérivés dans toute classe d'actifs. Le Fonds n'est pas autorisé à conclure des « ventes à découvert physiques ». Le Fonds investira généralement dans un portefeuille jusqu'à 250 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des positions longues et jusqu'à 250 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des positions courtes. Le Gestionnaire Financier peut chercher à générer des rendements positifs à partir de positions longues et courtes, bien que des positions courtes puissent également être utilisées pour couvrir certaines expositions au risque du portefeuille (par exemple, le risque de change ou de taux d'intérêt).

**Loomis Sayles Euro High Yield Fund**

L'objectif d'investissement du Loomis Sayles Euro High Yield Fund (ci-après le « Fonds ») est de générer un rendement élevé en combinant des revenus courants et une plus-value du capital.

Le Fonds peut investir toute partie de sa Valeur d'inventaire nette dans des titres de créance émis par des entreprises (comme des obligations d'entreprise) libellés en euros dont la notation est inférieure à investment grade. Les titres de créance dans lesquels le Fonds peut investir peuvent être émis par des entreprises basées n'importe où dans le monde et sont également cotés ou négociés sur un marché réglementé. Les titres de créance dont la notation est inférieure à investment grade sont des titres notés en deçà de BBB- (Standard & Poor's Ratings Services), Baa3 (Moody's Investors Service, Inc.), ou d'une notation équivalente par Fitch Ratings, ou, si aucune notation n'est attribuée, qui possèdent des caractéristiques que le Gestionnaire Financier juge de qualité équivalente. Pas plus de 10 % de la Valeur d'inventaire nette du Fonds ne peuvent être investis dans des titres de créance dont la notation est inférieure à investment grade, de nature hautement spéculative, à savoir des titres notés B+, B ou B- (Standard & Poor's Ratings Services), B1, B2 ou B3 (Moody's Investors Service, Inc.), ou une notation équivalente par Fitch Ratings, ou, si aucune notation n'est attribuée, qui possèdent des caractéristiques que le Gestionnaire Financier juge de qualité équivalente. Le Fonds peut investir jusqu'à 30 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des titres de créance investment grade, à savoir des titres dont la notation est supérieure ou égale à BBB- (Standard & Poor's Ratings Services), Baa3 (Moody's Investors Services, Inc.), ou une notation équivalente par Fitch Ratings, ou, si aucune notation n'est attribuée, qui possèdent des caractéristiques que le Gestionnaire Financier juge de qualité équivalente. Dans le cas d'une émission à double notation, la moyenne de la notation sera d'application.

Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur d'inventaire nette dans des titres de créance publics investment grade et/ou dont la notation est inférieure à investment grade (tels que les obligations d'État). Ils sont émis ou garantis par des émetteurs du monde entier, y compris, mais sans s'y limiter, des gouvernements (y compris leurs administrations, organismes et entités parrainées) et des entités supranationales (par exemple la Banque mondiale). Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa Valeur d'inventaire nette, au moment de l'achat, dans des titres de créance libellés dans des devises autres que l'euro.

Le Fonds ne peut pas investir dans des titres adossés à des actifs et n'investira pas dans des actions. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa Valeur d'inventaire nette en parts d'organismes de placement collectif.

Le Fonds ne peut pas investir dans des titres de créance dont la notation est égale ou inférieure à CCC+ (Standard & Poor's Ratings Services), Caa1 (Moody's Investors Service, Inc.), ou à une notation équivalente de Fitch Ratings, ou, si aucune notation n'est attribuée, à une notation que le Gestionnaire Financier estime être de qualité équivalente. Si les notations de crédit de tout titre de créance sont abaissées en dessous de B- (Standard & Poor's Ratings Services), B3 (Moody's Investors Services, Inc.), ou une notation équivalente par Fitch Ratings, le Fonds peut continuer à détenir les titres de créance concernés. En fonction de l'état du marché au moment concerné et sous réserve que cela soit dans l'intérêt des investisseurs, le titre en question sera vendu dans les six mois suivant cette baisse de notation de crédit sauf si une augmentation ultérieure rétablit la notation de crédit à un niveau répondant aux limites indiquées ci-dessus au cours de la même période.

À des fins d'investissement et dans le but d'assurer une gestion de portefeuille efficace, le Fonds peut :

- utiliser des contrats à terme normalisés, des swaps, des options sur devises et des contrats à terme afin de s'exposer et/ou de couvrir ses actifs contre les risques liés aux taux d'intérêt, taux de change ou crédit dans les limites décrites à l'Annexe II du Prospectus, à la section intitulée « Investissement dans des Instruments Financiers Dérivés (« IFD ») – Gestion de portefeuille efficace/Investissements directs » ;
- conclure des swaps de taux d'intérêt afin d'extraire de manière adéquate la prime de taux des marchés mondiaux en échangeant des paiements d'intérêts à taux fixe (sur un marché haussier) contre des paiements d'intérêts à taux variable (sur un marché baissier) ou inversement (selon les fluctuations du marché) ;

## Présentation de la Société (suite)

### Objectifs et politiques d'investissement (suite)

- s'engager sur le marché des dérivés de crédit en concluant, entre autres, des contrats d'échange (swaps) de défaillance de crédit afin de vendre et d'acheter une protection. Le Fonds peut utiliser des dérivés de crédit afin de couvrir les risques de crédit spécifiques de certains émetteurs présents en portefeuille en achetant une protection. En outre, le Fonds pourra, à condition que cela réponde au mieux à ses intérêts, acheter une protection en utilisant des dérivés de crédit sans en détenir les actifs sous-jacents. À condition que cela réponde au mieux à ses intérêts, le Fonds pourra également vendre une protection en utilisant des dérivés de crédit afin d'acquérir une exposition de crédit spécifique ; et
- à titre accessoire, investir dans des instruments financiers dérivés liés à un ou plusieurs indice(s) de crédit, dont Markit iTraxx® Europe Main Index et Markit iTraxx® Crossover Index (liste non exhaustive). Des informations concernant ces indices sont disponibles sur le site Internet de Markit ([www.markit.com](http://www.markit.com)). Les composants de ces indices sont généralement rééquilibrés chaque semestre. Il est généralement convenu que les frais associés au rééquilibrage de ces indices seront négligeables.

Pour soutenir l'utilisation des instruments dérivés par le Fonds, celui-ci peut investir dans des instruments du marché monétaire, des titres de créance à court terme et conserver des liquidités. Les instruments financiers dérivés peuvent être utilisés à des fins d'investissement et de gestion de portefeuille efficace sous réserve qu'ils se conforment aux conditions et limites définies dans l'Annexe II du Prospectus. Veuillez consulter la section sur l'« Utilisation d'instruments financiers dérivés » dans le Prospectus pour plus de détails. Le Fonds peut initier un effet de levier pouvant aller jusqu'à 100 % de sa Valeur d'inventaire nette, selon la méthode dite « approche par les engagements ».

La proportion maximale de la Valeur d'inventaire nette d'un Fonds qui peut faire l'objet de swaps de rendement total est de 100 %. La proportion attendue de la Valeur d'inventaire nette d'un Fonds qui fera l'objet de swaps de rendement total est de 0 %. La proportion maximale de la Valeur d'inventaire nette d'un Fonds qui peut faire l'objet d'opérations de financement sur titres (OFT) est de 100 %. La proportion attendue de la Valeur d'inventaire nette d'un Fonds qui fera l'objet d'OFT est de 0 %. Veuillez vous reporter à l'Annexe II du Prospectus, à la section intitulée « Investissement dans des Instruments Financiers Dérivés (« IFD ») – Gestion de portefeuille efficace/Investissements directs » pour de plus amples informations sur les swaps de rendement total et les OFT.

Si les limites d'investissement en pourcentages susmentionnées ne sont pas respectées pour des raisons échappant au contrôle du Fonds ou des suites de l'exercice de droits de souscription, le Fonds doit s'efforcer en priorité, dans le cadre de ses transactions de vente, de remédier à la situation, en prenant dûment en compte les intérêts des Actionnaires.

### Loomis Sayles Euro Credit Fund

L'objectif d'investissement du Loomis Sayles Euro Credit Fund (ci-après le « Fonds ») est de générer un rendement en combinant des revenus et une appréciation du capital.

Le Fonds peut investir toute partie de sa Valeur d'inventaire nette dans des titres de créance émis par des entreprises (comme des obligations d'entreprise) libellés en euros de qualité investment grade. Les titres de créance dans lesquels le Fonds peut investir peuvent être émis par des entreprises basées n'importe où dans le monde et sont également cotés ou négociés sur un marché réglementé. Les titres de créance investment grade sont des titres dont la notation est supérieure ou égale à BBB- (Standard & Poor's Ratings Services), Baa3 (Moody's Investors Services, Inc.), ou une notation équivalente par Fitch Ratings, ou, si aucune notation n'est attribuée, qui possèdent des caractéristiques que le Gestionnaire Financier juge de qualité équivalente. Dans le cas d'une émission à double notation, la notation la plus faible sera d'application. Le Fonds peut également investir toute partie de sa Valeur d'inventaire nette dans des titres de créance publics investment grade (comme des obligations d'État) émis par les gouvernements (y compris leurs administrations, organismes et entités parrainées) et des entités supranationales (par exemple la Banque mondiale).

Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de son actif dans des titres ayant une note inférieure à investment grade ; ces titres ne pouvant cependant pas avoir une note inférieure à BB- (Standard & Poor's Ratings Services), Ba3 (Moody's Investors Services, Inc.) ou une notation équivalente par Fitch Ratings au moment de l'acquisition. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa Valeur d'inventaire nette, au moment de l'achat, dans des titres de créance libellés dans des devises autres que l'euro.

Le Fonds ne peut pas investir dans des titres adossés à des actifs et n'investira pas dans des actions. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa Valeur d'inventaire nette en parts d'organismes de placement collectif.

**Présentation de la Société (suite)**

**Objectifs et politiques d'investissement (suite)**

Le Fonds ne peut pas investir dans des titres de créance dont la notation est inférieure ou égale à B+ (Standard & Poor's Ratings Services), B1 (Moody's Investors Service, Inc.), ou une notation équivalente de Fitch Ratings. Si les notations de crédit de tout titre de créance sont abaissées en dessous de BB- (Standard & Poor's Ratings Services), Ba3 (Moody's Investors Services, Inc.), ou une notation équivalente par Fitch Ratings, le Fonds peut continuer à détenir les titres de créance concernés. En fonction de l'état du marché au moment concerné et sous réserve que cela soit dans l'intérêt des investisseurs, le titre en question sera vendu dans les six mois suivant cette baisse de notation de crédit sauf si une augmentation ultérieure rétablit la notation de crédit à un niveau répondant aux limites indiquées ci-dessus au cours de la même période.

À des fins d'investissement et dans le but d'assurer une gestion de portefeuille efficace, le Fonds peut :

- utiliser des contrats à terme normalisés, des swaps, des options sur devises et des contrats à terme afin de s'exposer et/ou de couvrir ses actifs contre les risques liés aux taux d'intérêt, taux de change ou crédit dans les limites décrites à l'Annexe II du Prospectus, à la section intitulée « Investissement dans des Instruments Financiers Dérivés (« IFD ») – Gestion de portefeuille efficace/Investissements directs » ;
- conclure des swaps de taux d'intérêt afin d'extraire de manière adéquate la prime de taux des marchés mondiaux en échangeant des paiements d'intérêts à taux fixe (sur un marché haussier) contre des paiements d'intérêts à taux variable (sur un marché baissier) ou inversement (selon les fluctuations du marché) ;
- s'engager sur le marché des dérivés de crédit en concluant, entre autres, des contrats d'échange (swaps) de défaillance de crédit afin de vendre et d'acheter une protection. Le Fonds peut utiliser des dérivés de crédit afin de couvrir les risques de crédit spécifiques de certains émetteurs présents en portefeuille en achetant une protection. En outre, le Fonds pourra, à condition que cela réponde au mieux à ses intérêts, acheter une protection en utilisant des dérivés de crédit sans en détenir les actifs sous-jacents. À condition que cela réponde au mieux à ses intérêts, le Fonds pourra également vendre une protection en utilisant des dérivés de crédit afin d'acquérir une exposition de crédit spécifique ; et
- à titre accessoire, investir dans des instruments financiers dérivés liés à un ou plusieurs indice(s) de crédit, dont Markit iTraxx® Europe Main Index et Markit iTraxx® Crossover Index (liste non exhaustive). Des informations concernant ces indices sont disponibles sur le site Internet de Markit ([www.markit.com](http://www.markit.com)). Les composants de ces indices sont généralement rééquilibrés chaque semestre. Il est généralement convenu que les frais associés au rééquilibrage de ces indices seront négligeables.

Pour soutenir l'utilisation des instruments dérivés par le Fonds, celui-ci peut investir dans des instruments du marché monétaire, des titres de créance à court terme et conserver des liquidités. Les instruments financiers dérivés peuvent être utilisés à des fins d'investissement et de gestion de portefeuille efficace sous réserve qu'ils se conforment aux conditions et limites définies dans l'Annexe II du Prospectus. Veuillez consulter la section sur l'« Utilisation d'instruments financiers dérivés » dans le Prospectus pour plus de détails. Le Fonds peut initier un effet de levier pouvant aller jusqu'à 100 % de sa Valeur d'inventaire nette, selon la méthode dite « approche par les engagements ».

La proportion maximum de la Valeur d'inventaire nette d'un Fonds qui fera l'objet de swaps de rendement total est de 0 %. La proportion maximale de la Valeur d'inventaire nette d'un Fonds qui peut faire l'objet d'opérations de financement sur titres (OFT) est de 100 %. La proportion attendue de la Valeur d'inventaire nette d'un Fonds qui fera l'objet d'OFT est de 0 %. Veuillez vous reporter à l'Annexe II du Prospectus, à la section intitulée « Investissement dans des Instruments Financiers Dérivés (« IFD ») – Gestion de portefeuille efficace/Investissements directs » pour de plus amples informations sur les swaps de rendement total et les OFT.

Si les limites d'investissement en pourcentages susmentionnées ne sont pas respectées pour des raisons échappant au contrôle du Fonds ou des suites de l'exercice de droits de souscription, le Fonds doit s'efforcer en priorité, dans le cadre de ses transactions de vente, de remédier à la situation, en prenant dûment en compte les intérêts des Actionnaires.

**Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund**

L'objectif d'investissement du Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (ci-après le « Fonds ») est de chercher à générer un rendement d'investissement sous la forme d'une appréciation du capital et d'un revenu, dans le cadre d'un processus d'investissement intégrant des considérations environnementales, sociales et de gouvernance (« ESG »).

## Présentation de la Société (suite)

### Objectifs et politiques d'investissement (suite)

Le Fonds peut investir toute partie de sa Valeur d'inventaire nette dans des titres de créance émis par des entreprises (c'est-à-dire des obligations d'entreprise) libellés en euros de qualité investment grade. Les titres de créance dans lesquels le Fonds peut investir peuvent être émis par des entreprises basées n'importe où dans le monde et sont également cotés ou négociés sur un marché réglementé.

Les titres de créance dans lesquels le Fonds peut investir peuvent également être des Obligations vertes, sous réserve de la Stratégie d'investissement principale décrite ci-dessus et des spécifications énoncées dans la présente Politique d'investissement. Les titres de créance investment grade sont des titres dont la notation est supérieure ou égale à BBB- (Standard & Poor's Ratings Services), Baa3 (Moody's Investors Services, Inc.), ou une notation équivalente par Fitch Ratings, ou, si aucune notation n'est attribuée, qui possèdent des caractéristiques que le Gestionnaire Financier juge de qualité équivalente. Dans le cas d'une émission à double notation, la notation la plus faible sera d'application. Le Fonds peut également investir toute partie de sa Valeur d'inventaire nette dans des titres de créance publics investment grade (comme des obligations d'État) émis par les gouvernements (y compris leurs administrations, organismes et entités parrainées) et des entités supranationales (par exemple la Banque mondiale).

Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de son actif dans des titres ayant une note inférieure à investment grade ; ces titres ne pouvant cependant pas avoir une note inférieure à BB- (Standard & Poor's Ratings Services), Ba3 (Moody's Investors Services, Inc.) ou une notation équivalente par Fitch Ratings au moment de l'acquisition. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa Valeur d'inventaire nette, au moment de l'achat, dans des titres de créance libellés dans des devises autres que l'euro.

Le Fonds ne peut pas investir dans des titres adossés à des actifs et n'investira pas dans des actions. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa Valeur d'inventaire nette en parts d'organismes de placement collectif.

Le Fonds ne peut pas investir dans des titres de créance dont la notation est inférieure ou égale à B+ (Standard & Poor's Ratings Services), B1 (Moody's Investors Service, Inc.), ou une notation équivalente de Fitch Ratings. Si les notations de crédit de tout titre de créance sont abaissées en dessous de BB- (Standard & Poor's Ratings Services), Ba3 (Moody's Investors Services, Inc.), ou une notation équivalente par Fitch Ratings, le Fonds peut continuer à détenir les titres de créance concernés. En fonction de l'état du marché au moment concerné et sous réserve que cela soit dans l'intérêt des investisseurs, le titre en question sera vendu dans les six mois suivant cette baisse de notation de crédit sauf si une augmentation ultérieure rétablit la notation de crédit à un niveau répondant aux limites indiquées ci-dessus au cours de la même période.

À des fins d'investissement et dans le but d'assurer une gestion de portefeuille efficace, le Fonds peut :

- utiliser des contrats à terme normalisés, des swaps, des options sur devises et des contrats à terme afin de s'exposer et/ou de couvrir ses actifs contre les risques liés aux taux d'intérêt, taux de change ou crédit dans les limites décrites à l'Annexe II du Prospectus, à la section intitulée « Investissement dans des Instruments Financiers Dérivés (« IFD ») – Gestion de portefeuille efficace/Investissements directs » ;
- conclure des swaps de taux d'intérêt afin d'extraire de manière adéquate la prime de taux des marchés mondiaux en échangeant des paiements d'intérêts à taux fixe (sur un marché haussier) contre des paiements d'intérêts à taux variable (sur un marché baissier) ou inversement (selon les fluctuations du marché) ;
- s'engager sur le marché des dérivés de crédit en concluant des contrats d'échange (swaps) sur défaillance de crédit afin de vendre et d'acheter une protection. Le Fonds peut utiliser des contrats d'échange (swaps) sur défaillance de crédit afin de couvrir les risques de crédit spécifiques de certains émetteurs présents en portefeuille en achetant une protection. En outre, le Fonds peut, à condition que cela réponde au mieux à ses intérêts, acheter une protection en utilisant des contrats d'échange (swaps) sur défaillance de crédit sans en détenir les actifs sous-jacents. À condition que cela réponde au mieux à ses intérêts, le Fonds peut également vendre une protection en utilisant des contrats d'échange (swaps) sur défaillance de crédit afin d'acquérir une exposition de crédit spécifique ; et
- à titre accessoire, investir dans des instruments financiers dérivés liés à un ou plusieurs indice(s) de crédit, dont Markit iTraxx® Europe Main Index et Markit iTraxx® Crossover Index (liste non exhaustive). Des informations concernant ces indices sont disponibles sur le site Internet de Markit ([www.markit.com](http://www.markit.com)). Les composants de ces indices sont généralement rééquilibrés chaque semestre. Il est généralement convenu que les frais associés au rééquilibrage de ces indices seront négligeables.

**Présentation de la Société (suite)**

**Objectifs et politiques d'investissement (suite)**

Pour soutenir l'utilisation des instruments dérivés par le Fonds, celui-ci peut investir dans des instruments du marché monétaire, des titres de créance à court terme et conserver des liquidités. Les instruments financiers dérivés peuvent être utilisés à des fins d'investissement et de gestion de portefeuille efficace sous réserve qu'ils se conforment aux conditions et limites définies dans l'Annexe II du Prospectus. Veuillez consulter la section sur l'« Utilisation d'instruments financiers dérivés » dans le Prospectus pour plus de détails. Le Fonds peut initier un effet de levier pouvant aller jusqu'à 100 % de sa Valeur d'inventaire nette, selon la méthode dite « approche par les engagements ».

La proportion maximale de la Valeur d'inventaire nette d'un Fonds qui peut faire l'objet de swaps de rendement total est de 100 %. La proportion attendue de la Valeur d'inventaire nette d'un Fonds qui fera l'objet de swaps de rendement total est de 0 %. La proportion maximale de la Valeur d'inventaire nette d'un Fonds qui peut faire l'objet d'opérations de financement sur titres (OFT) est de 100 %. La proportion attendue de la Valeur d'inventaire nette d'un Fonds qui fera l'objet d'OFT est de 0 %. Veuillez vous reporter à l'Annexe II du Prospectus, à la section intitulée « Investissement dans des Instruments Financiers Dérivés (« IFD ») – Gestion de portefeuille efficace/Investissements directs » pour de plus amples informations sur les swaps de rendement total et les OFT.

Si les limites d'investissement en pourcentages susmentionnées ne sont pas respectées pour des raisons échappant au contrôle du Fonds ou des suites de l'exercice de droits de souscription, le Fonds doit s'efforcer en priorité, dans le cadre de ses transactions de vente, de remédier à la situation, en prenant dûment en compte les intérêts des Actionnaires.

**Gestion efficace du portefeuille**

Chaque Fonds peut recourir à des instruments dérivés financiers à des fins de gestion efficace du portefeuille. Le Loomis Sayles Multisector Income Fund peut également conclure des contrats de mise en pension à ces fins.

**Autres informations importantes**

Les rapports annuels audités et les rapports semestriels non audités sont disponibles auprès de Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited (ci-après « l'Agent administratif ») à l'adresse indiquée au chapitre « Organisation » en page 1 et peuvent être envoyés aux actionnaires qui le souhaitent à l'adresse indiquée dans le registre. La dernière version du prospectus est également disponible auprès de l'Agent administratif à l'adresse indiquée en page 1.



**Rapports du Gestionnaire Financier**

**Loomis Sayles Multisector Income Fund**

| Performance sur 6 mois                                              |               |
|---------------------------------------------------------------------|---------------|
| <b>Loomis Sayles Multisector Income Fund (Classe I/D (USD))*</b>    | <b>2,58 %</b> |
| Bloomberg Barclays U.S. Government/Credit Bond Index (Total Return) | <b>2,21 %</b> |

À titre indicatif, la performance du Fonds est comparée à l'indice Bloomberg Barclays U.S. Government/Credit Bond Index (Total Return) (ci-après, « l'Indice de Référence »). Le Fonds a surperformé son Indice de Référence au cours du semestre clos le 30 juin 2023.

- Le Fonds a surperformé son Indice de Référence, principalement en raison de la sélection des titres.
- La sélection des titres dans les entreprises de qualité investment grade a contribué aux rendements relatifs, en particulier dans le secteur bancaire.
- Le haut rendement a contribué à la performance, en particulier les émetteurs de biens de consommation cycliques.
- L'utilisation de contrats à terme normalisés sur des bons du Trésor pour gérer le positionnement en matière de duration a contribué à la performance.
- L'exposition au crédit des marchés émergents a pesé sur la performance, en particulier les émetteurs immobiliers chinois.

\* Les performances indiquées sont représentatives de performances passées et ne sauraient constituer une garantie de résultats futurs. Les performances récentes pourront être supérieures ou inférieures aux performances passées. La valeur du principal et les rendements évoluant au fil du temps (notamment du fait des fluctuations de change), le prix de rachat des actions sera supérieur ou inférieur à leur prix initial. Les performances indiquées sont nettes de toutes les charges imputées aux Fonds, mais excluent l'impact des commissions de souscription et des frais de banque correspondants, et supposent un réinvestissement des distributions. Si de tels droits et frais avaient été inclus, les rendements auraient été inférieurs. Les performances d'autres classes d'actions peuvent être supérieures ou inférieures selon les écarts de commissions et de commissions de souscription. Sauf indication contraire, tous les termes définis et utilisés dans le présent document ont le même sens que celui qui leur est donné dans le prospectus de la Société.

**Loomis, Sayles & Company, L.P.**  
**18 août 2023**

Rapports du Gestionnaire Financier (suite)

Loomis Sayles High Income Fund

| Performance sur 6 mois                                                 |               |
|------------------------------------------------------------------------|---------------|
| <b>Loomis Sayles High Income Fund (Classe I/D (USD))*</b>              | <b>3,45 %</b> |
| Bloomberg Barclays U.S. Corporate High-Yield Bond Index (Total Return) | <b>5,38 %</b> |

À titre indicatif, la performance du Fonds est comparée à l'indice Bloomberg Barclays U.S. Corporate High-Yield Bond Index (Total Return) (ci-après, « l'Indice de Référence »). Le Fonds a sous-performé son Indice de Référence au cours du semestre clos le 30 juin 2023.

- Le Fonds a sous-performé son Indice de Référence, principalement en raison de la sélection des titres.
- L'exposition aux titres convertibles a été le principal frein à la performance, en raison des émetteurs du secteur des communications.
- Le crédit des marchés émergents, en particulier le crédit asiatique, a pesé sur la performance.
- Les positions défensives de type réserves ainsi que les bons du Trésor américain ont nui à la performance.

\* Les performances indiquées sont représentatives de performances passées et ne sauraient constituer une garantie de résultats futurs. Les performances récentes pourront être supérieures ou inférieures aux performances passées. La valeur du principal et les rendements évoluant au fil du temps (notamment du fait des fluctuations de change), le prix de rachat des actions sera supérieur ou inférieur à leur prix initial. Les performances indiquées sont nettes de toutes les charges imputées aux Fonds, mais excluent l'impact des commissions de souscription et des frais de banque correspondants, et supposent un réinvestissement des distributions. Si de tels droits et frais avaient été inclus, les rendements auraient été inférieurs. Les performances d'autres classes d'actions peuvent être supérieures ou inférieures selon les écarts de commissions et de commissions de souscription. Sauf indication contraire, tous les termes définis et utilisés dans le présent document ont le même sens que celui qui leur est donné dans le prospectus de la Société.

**Loomis, Sayles & Company, L.P.**  
**18 août 2023**

**Rapports du Gestionnaire Financier (suite)**

**Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund**

| Performance sur 6 mois                                                  |               |
|-------------------------------------------------------------------------|---------------|
| <b>Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (Classe I/D (USD))*</b> | <b>1,73 %</b> |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (Total Return)                | <b>1,43 %</b> |

À titre indicatif, la performance du Fonds est comparée à l'indice Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (Total Return) (ci-après, « l'Indice de Référence »). Le Fonds a surperformé son Indice de Référence au cours du semestre clos le 30 juin 2023.

- Le Fonds a surperformé son Indice de Référence au cours de la période.
- L'allocation aux secteurs et aux émetteurs du crédit aux entreprises a été le principal moteur de la performance relative positive. Les surpondérations ajustées du risque des secteurs de l'assurance et des transports ont contribué à la performance relative, les obligations de qualité investment grade ayant bénéficié du resserrement des spreads sur fond d'appétit pour le risque.
- Le positionnement sur la courbe des taux et en matière de duration a contribué à la performance relative en raison du positionnement sur les marchés locaux dans certains pays émergents tels que le Brésil, la Colombie et l'Indonésie. La surpondération de la duration au Brésil et en Indonésie s'est avérée payante, les rendements ayant baissé dans un contexte d'atténuation de l'inflation.
- L'allocation en devises a pesé sur la performance relative, principalement en raison du positionnement sur le yen japonais et de la surpondération du rand sud-africain.

\* Les performances indiquées sont représentatives de performances passées et ne sauraient constituer une garantie de résultats futurs. Les performances récentes pourront être supérieures ou inférieures aux performances passées. La valeur du principal et les rendements évoluant au fil du temps (notamment du fait des fluctuations de change), le prix de rachat des actions sera supérieur ou inférieur à leur prix initial. Les performances indiquées sont nettes de toutes les charges imputées aux Fonds, mais excluent l'impact des commissions de souscription et des frais de banque correspondants, et supposent un réinvestissement des distributions. Si de tels droits et frais avaient été inclus, les rendements auraient été inférieurs. Les performances d'autres classes d'actions peuvent être supérieures ou inférieures selon les écarts de commissions et de commissions de souscription. Sauf indication contraire, tous les termes définis et utilisés dans le présent document ont le même sens que celui qui leur est donné dans le prospectus de la Société.

**Loomis, Sayles & Company, L.P.**  
**18 août 2023**

Rapports du Gestionnaire Financier (suite)

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund

| Performance sur 6 mois                                                |               |
|-----------------------------------------------------------------------|---------------|
| <b>Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (Classe I/A (USD))*</b> | <b>4,57 %</b> |
| Pas d'Indice de Référence                                             |               |

- Puisqu'il s'agit d'un fonds de primes de risque alternatives, toutes les opérations sont menées de façon systématique.
- Les actions ont apporté la principale contribution à la performance, tandis que le facteur « volatilité » a été le principal moteur de la performance des actions. Les taux ont également contribué à la performance ; des facteurs tels que la dynamique des marchés émergents et la valeur jouant un rôle moteur. La dynamique du crédit a également été porteuse.
- Côté négatif, les devises ont freiné la performance, en particulier le facteur « valeur ».

\* Les performances indiquées sont représentatives de performances passées et ne sauraient constituer une garantie de résultats futurs. Les performances récentes pourront être supérieures ou inférieures aux performances passées. La valeur du principal et les rendements évoluant au fil du temps (notamment du fait des fluctuations de change), le prix de rachat des actions sera supérieur ou inférieur à leur prix initial. Les performances indiquées sont nettes de toutes les charges imputées aux Fonds, mais excluent l'impact des commissions de souscription et des frais de banque correspondants, et supposent un réinvestissement des distributions. Si de tels droits et frais avaient été inclus, les rendements auraient été inférieurs. Les performances d'autres classes d'actions peuvent être supérieures ou inférieures selon les écarts de commissions et de commissions de souscription. Sauf indication contraire, tous les termes définis et utilisés dans le présent document ont le même sens que celui qui leur est donné dans le prospectus de la Société.

**Loomis, Sayles & Company, L.P.**  
**18 août 2023**

**Rapports du Gestionnaire Financier (suite)**

**Loomis Sayles Euro High Yield Fund**

| Performance sur 6 mois                                                                                                                             |               |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
| <b>Loomis Sayles Euro High Yield Fund (Classe I/A (EUR))*</b>                                                                                      | <b>4,42 %</b> |
| 85 % ICE BofA BB Euro High Yield Non-Financial Constrained Index (Total Return),<br>15 % ICE BofA Euro Subordinated Financial Index (Total Return) | <b>3,82 %</b> |

À titre indicatif, la performance du Fonds est comparée à celle d'un indice composite composé à 85 % de l'indice ICE BofA BB Euro High Yield Non-Financial Constrained Index et à 15 % de l'indice ICE BofA Euro Subordinated Financial Index (l'« Indice de Référence »). Le Fonds a surperformé son Indice de Référence au cours du semestre clos le 30 juin 2023.

- Le Fonds a surperformé son Indice de Référence.
- La surperformance a été favorisée par des résultats positifs dus aux effets de sélection et de l'allocation des titres.
- Les secteurs qui ont le plus contribué à la performance ont été les banques, l'assurance ainsi que l'automobile et les pièces détachées.
- Les secteurs qui ont le plus freiné la performance ont été les services aux collectivités, l'immobilier et la vente au détail.
- Deutsche Lufthansa AG, Stena Rederi AB et Abertis Infraestruturas SA ont apporté les principales contributions aux rendements relatifs.
- EP Infrastructure AS (exclu), British American Tobacco PLC (exclu) et Pemex Project Funding Master Trust (exclu) ont constitué les principaux freins aux rendements relatifs.

\* Les performances indiquées sont représentatives de performances passées et ne sauraient constituer une garantie de résultats futurs. Les performances récentes pourront être supérieures ou inférieures aux performances passées. La valeur du principal et les rendements évoluant au fil du temps (notamment du fait des fluctuations de change), le prix de rachat des actions sera supérieur ou inférieur à leur prix initial. Les performances indiquées sont nettes de toutes les charges imputées aux Fonds, mais excluent l'impact des commissions de souscription et des frais de banque correspondants, et supposent un réinvestissement des distributions. Si de tels droits et frais avaient été inclus, les rendements auraient été inférieurs. Les performances d'autres classes d'actions peuvent être supérieures ou inférieures selon les écarts de commissions et de commissions de souscription. Sauf indication contraire, tous les termes définis et utilisés dans le présent document ont le même sens que celui qui leur est donné dans le prospectus de la Société.

**Loomis, Sayles & Company, L.P.**  
**18 août 2023**

Rapports du Gestionnaire Financier (suite)

Loomis Sayles Euro Credit Fund

| Performance sur 6 mois                                    |               |
|-----------------------------------------------------------|---------------|
| <b>Loomis Sayles Euro Credit Fund (Classe I/A (EUR))*</b> | <b>2,56 %</b> |
| iBoxx Euro Corporates Overall Index (Total Return)        | <b>2,16 %</b> |

À titre indicatif, la performance du Fonds est comparée à l'indice iBoxx Euro Corporates Overall Index (Total Return) (ci-après, l'« Indice de Référence »). Le Fonds a surperformé son Indice de Référence au cours du semestre clos le 30 juin 2023.

- Le Fonds a surperformé son Indice de Référence.
- La surperformance a été favorisée par des résultats positifs dus aux effets de sélection et de l'allocation des titres.
- Les secteurs qui ont le plus contribué à la performance ont été les banques, les services financiers ainsi que les biens et services industriels.
- Les secteurs qui ont le plus freiné la performance ont été les infrastructures ainsi que les articles personnels et ménagers.
- Credit Suisse AG, Deutsche Bank AG et Vilmorin & Cie SA ont apporté les principales contributions aux rendements relatifs.
- Fresenius SE & Co KGaA, Philip Morris International Inc (exclu) et BAWAG Group AG ont constitué les principaux freins aux rendements relatifs.

\* Les performances indiquées sont représentatives de performances passées et ne sauraient constituer une garantie de résultats futurs. Les performances récentes pourront être supérieures ou inférieures aux performances passées. La valeur du principal et les rendements évoluant au fil du temps (notamment du fait des fluctuations de change), le prix de rachat des actions sera supérieur ou inférieur à leur prix initial. Les performances indiquées sont nettes de toutes les charges imputées aux Fonds, mais excluent l'impact des commissions de souscription et des frais de banque correspondants, et supposent un réinvestissement des distributions. Si de tels droits et frais avaient été inclus, les rendements auraient été inférieurs. Les performances d'autres classes d'actions peuvent être supérieures ou inférieures selon les écarts de commissions et de commissions de souscription. Sauf indication contraire, tous les termes définis et utilisés dans le présent document ont le même sens que celui qui leur est donné dans le prospectus de la Société.

**Loomis, Sayles & Company, L.P.**

**18 août 2023**

**Rapports du Gestionnaire Financier (suite)**

**Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund**

| Performance sur 6 mois                                                |               |
|-----------------------------------------------------------------------|---------------|
| <b>Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (Classe I/A (EUR))*</b> | <b>2,42 %</b> |
| iBoxx Euro Corporates Overall Index (Total Return)                    | <b>2,16 %</b> |

À titre indicatif, la performance du Fonds est comparée à l'indice iBoxx Euro Corporates Overall Index (Total Return) (ci-après, l'« Indice de Référence »). Le Fonds a surperformé son Indice de Référence au cours du semestre clos le 30 juin 2023.

- Le Fonds a surperformé son Indice de Référence.
- La surperformance a été favorisée par des résultats positifs dus aux effets de sélection et de l'allocation des titres.
- Les secteurs qui ont le plus contribué à la performance ont été les banques, les biens et services industriels ainsi que les services financiers.
- Les secteurs qui ont le plus pesé sur la performance ont été le pétrole et le gaz (exclu), les articles personnels et ménagers ainsi que les ressources de base (exclu).
- Credit Suisse AG, Deutsche Bank AG et ABN AMRO Bank NV ont apporté les principales contributions aux rendements relatifs.
- CNH International NV, Volkswagen AG (exclu) et Enel SpA (exclu) ont constitué les principaux freins aux rendements relatifs.

\* Les performances indiquées sont représentatives de performances passées et ne sauraient constituer une garantie de résultats futurs. Les performances récentes pourront être supérieures ou inférieures aux performances passées. La valeur du principal et les rendements évoluant au fil du temps (notamment du fait des fluctuations de change), le prix de rachat des actions sera supérieur ou inférieur à leur prix initial. Les performances indiquées sont nettes de toutes les charges imputées aux Fonds, mais excluent l'impact des commissions de souscription et des frais de banque correspondants, et supposent un réinvestissement des distributions. Si de tels droits et frais avaient été inclus, les rendements auraient été inférieurs. Les performances d'autres classes d'actions peuvent être supérieures ou inférieures selon les écarts de commissions et de commissions de souscription. Sauf indication contraire, tous les termes définis et utilisés dans le présent document ont le même sens que celui qui leur est donné dans le prospectus de la Société.

**Loomis, Sayles & Company, L.P.**  
**18 août 2023**

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## État condensé de la situation financière

Au 30 juin 2023

|                                                                                    |       | LOOMIS<br>SAYLES<br>MULTISECTOR<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES<br>MULTISECTOR<br>INCOME FUND<br>USD<br>31 décembre<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES HIGH<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES HIGH<br>INCOME FUND<br>USD<br>31 décembre<br>2022 | LOOMIS SAYLES<br>GLOBAL<br>OPPORTUNISTIC<br>BOND FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS SAYLES<br>GLOBAL<br>OPPORTUNISTIC<br>BOND FUND<br>USD<br>31 décembre<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES<br>ALTERNATIVE<br>RISK PREMIA<br>FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES<br>ALTERNATIVE<br>RISK PREMIA<br>FUND<br>USD<br>31 décembre<br>2022 |
|------------------------------------------------------------------------------------|-------|--------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                                    | Notes |                                                                          |                                                                              |                                                                |                                                                    |                                                                                 |                                                                                     |                                                                                  |                                                                                      |
| <b>ACTIF CIRCULANT</b>                                                             |       |                                                                          |                                                                              |                                                                |                                                                    |                                                                                 |                                                                                     |                                                                                  |                                                                                      |
| Avoirs en banque                                                                   | 1(b)  | –                                                                        | 5 787 909                                                                    | 289 719                                                        | 242 955                                                            | 795 577                                                                         | 1 322 082                                                                           | 2 716 288                                                                        | 2 012 911                                                                            |
| Dépôts auprès du courtier pour les garanties sur instruments dérivés               |       | 161 300                                                                  | 385 360                                                                      | –                                                              | –                                                                  | 210 335                                                                         | –                                                                                   | 2 889 677                                                                        | 3 077 260                                                                            |
| Créances                                                                           | 6     | 30 031 524                                                               | 6 506 064                                                                    | 384 840                                                        | 86 176                                                             | 306 041                                                                         | 475 668                                                                             | 1 575 186                                                                        | 1 175 793                                                                            |
| Investissements :                                                                  |       |                                                                          |                                                                              |                                                                |                                                                    |                                                                                 |                                                                                     |                                                                                  |                                                                                      |
| Actif financier à sa juste valeur par le biais du compte de résultat               |       | 552 630 598                                                              | 583 653 653                                                                  | 7 121 375                                                      | 8 506 967                                                          | 37 571 463                                                                      | 58 202 162                                                                          | 20 421 429                                                                       | 20 808 345                                                                           |
| Total de l'actif                                                                   |       | 582 823 422                                                              | 596 332 986                                                                  | 7 795 934                                                      | 8 836 098                                                          | 38 883 416                                                                      | 59 999 912                                                                          | 27 602 580                                                                       | 27 074 309                                                                           |
| <b>PASSIF CIRCULANT</b>                                                            |       |                                                                          |                                                                              |                                                                |                                                                    |                                                                                 |                                                                                     |                                                                                  |                                                                                      |
| Découverts bancaires                                                               |       | (13 336 422)                                                             | –                                                                            | –                                                              | –                                                                  | –                                                                               | –                                                                                   | –                                                                                | –                                                                                    |
| Dépôts dus au courtier pour les garanties sur instruments dérivés                  |       | –                                                                        | –                                                                            | –                                                              | –                                                                  | –                                                                               | (41 198)                                                                            | –                                                                                | –                                                                                    |
| Dettes - (montants arrivant à échéance dans l'exercice financier)                  |       | (2 791 322)                                                              | (2 973 395)                                                                  | (746 600)                                                      | (208 775)                                                          | (165 671)                                                                       | (200 258)                                                                           | (486 639)                                                                        | (1 441 353)                                                                          |
| Investissements :                                                                  |       |                                                                          |                                                                              |                                                                |                                                                    |                                                                                 |                                                                                     |                                                                                  |                                                                                      |
| Passif financier à sa juste valeur par le biais du compte de résultat              |       | (698 770)                                                                | (573 309)                                                                    | (6 796)                                                        | (188)                                                              | (126 037)                                                                       | (1 026 200)                                                                         | (643 825)                                                                        | (587 857)                                                                            |
| <b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D' ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES</b> |       |                                                                          |                                                                              |                                                                |                                                                    |                                                                                 |                                                                                     |                                                                                  |                                                                                      |
|                                                                                    |       | 565 996 908                                                              | 592 786 282                                                                  | 7 042 538                                                      | 8 627 135                                                          | 38 591 708                                                                      | 58 732 256                                                                          | 26 472 116                                                                       | 25 045 099                                                                           |
| Au 31 décembre 2022                                                                |       | 592 786 282                                                              | 592 786 282                                                                  | 8 627 135                                                      | 8 627 135                                                          | 58 732 256                                                                      | 58 732 256                                                                          | 25 045 099                                                                       | 25 045 099                                                                           |
| Au 31 décembre 2021                                                                |       | 819 775 029                                                              | 819 775 029                                                                  | 16 489 497                                                     | 16 489 497                                                         | 81 275 147                                                                      | 81 275 147                                                                          | 30 183 827                                                                       | 30 183 827                                                                           |
| Au 31 décembre 2020                                                                |       | 1 000 775 311                                                            | 1 000 775 311                                                                | 18 692 099                                                     | 18 692 099                                                         | 192 280 202                                                                     | 192 280 202                                                                         | 31 326 728                                                                       | 31 326 728                                                                           |

Les notes des pages 29 à 55 font partie intégrante des présents états financiers condensés



# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## État condensé de la situation financière (suite)

Au 30 juin 2023 (suite)

|                                                                                            |       | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>HIGH YIELD<br>FUND*<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>HIGH YIELD<br>FUND*<br>EUR<br>31 décembre<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>CREDIT FUND**<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>CREDIT FUND**<br>EUR<br>31 décembre<br>2022 | LOOMIS SAYLES<br>SUSTAINABLE<br>EURO CREDIT<br>FUND***<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS SAYLES<br>SUSTAINABLE<br>EURO CREDIT<br>FUND***<br>EUR<br>31 décembre<br>2022 | TOTAL<br>USD<br>30 juin<br>2023 | TOTAL<br>USD<br>31 décembre<br>2022 |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-------|------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|
|                                                                                            | Notes |                                                                        |                                                                            |                                                                  |                                                                      |                                                                                  |                                                                                      |                                 |                                     |
| <b>ACTIF CIRCULANT</b>                                                                     |       |                                                                        |                                                                            |                                                                  |                                                                      |                                                                                  |                                                                                      |                                 |                                     |
| Avoirs en banque                                                                           | 1(b)  | 1 413 147                                                              | 1 155 055                                                                  | 3 103 407                                                        | 1 177 081                                                            | 11 880 304                                                                       | 5 128 996                                                                            | 21 690 556                      | 17 328 750                          |
| Dépôts auprès du courtier pour les garanties sur instruments dérivés                       |       | 51 450                                                                 | 68 164                                                                     | 227 419                                                          | 548 463                                                              | 528 834                                                                          | 1 386 075                                                                            | 4 142 516                       | 5 600 004                           |
| Créances                                                                                   | 6     | 854 709                                                                | 392 172                                                                    | 2 865 592                                                        | 907 844                                                              | 9 269 702                                                                        | 4 395 124                                                                            | 46 469 684                      | 14 321 839                          |
| Investissements :<br>Actif financier à sa juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | 28 294 854                                                             | 26 020 249                                                                 | 107 005 207                                                      | 99 591 878                                                           | 525 129 459                                                                      | 388 796 035                                                                          | 1 338 273 472                   | 1 220 173 238                       |
| Total de l'actif                                                                           |       | 30 614 160                                                             | 27 635 640                                                                 | 113 201 625                                                      | 102 225 266                                                          | 546 808 299                                                                      | 399 706 230                                                                          | 1 410 576 228                   | 1 257 423 831                       |
| <b>PASSIF CIRCULANT</b>                                                                    |       |                                                                        |                                                                            |                                                                  |                                                                      |                                                                                  |                                                                                      |                                 |                                     |
| Découverts bancaires                                                                       |       | —                                                                      | —                                                                          | —                                                                | —                                                                    | —                                                                                | —                                                                                    | (13 336 422)                    | —                                   |
| Dépôts dus au courtier pour les garanties sur instruments dérivés                          |       | —                                                                      | —                                                                          | —                                                                | —                                                                    | —                                                                                | —                                                                                    | —                               | (41 198)                            |
| Dettes - (montants arrivant à échéance dans l'exercice financier)                          |       | (472 707)                                                              | (132 538)                                                                  | (2 811 955)                                                      | (193 303)                                                            | (9 724 141)                                                                      | (1 221 831)                                                                          | (18 382 836)                    | (6 475 534)                         |
| Investissements :<br>Passif financier à sa juste valeur par le biais du compte de résultat |       | (24 090)                                                               | (61 116)                                                                   | (62 870)                                                         | (369 193)                                                            | (323 820)                                                                        | (1 053 447)                                                                          | (1 923 589)                     | (3 771 093)                         |
| <b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES</b>          |       |                                                                        |                                                                            |                                                                  |                                                                      |                                                                                  |                                                                                      |                                 |                                     |
|                                                                                            |       | 30 117 363                                                             | 27 441 986                                                                 | 110 326 800                                                      | 101 662 770                                                          | 536 760 338                                                                      | 397 430 952                                                                          | 1 376 933 381                   | 1 247 136 006                       |
| Au 31 décembre 2022                                                                        |       | 27 441 986                                                             | 27 441 986                                                                 | 101 662 770                                                      | 101 662 770                                                          | 397 430 952                                                                      | 397 430 952                                                                          | 1 247 136 006                   | 1 247 136 006                       |
| Au 31 décembre 2021                                                                        |       | 32 273 023                                                             | 32 273 023                                                                 | 120 603 868                                                      | 120 603 868                                                          | 181 058 544                                                                      | 181 058 544                                                                          | 1 327 474 875                   | 1 327 474 875                       |
| Au 31 décembre 2020                                                                        |       |                                                                        |                                                                            |                                                                  |                                                                      |                                                                                  |                                                                                      | 1 243 074 340                   | 1 243 074 340                       |

\* Fonds lancé le 9 février 2021.

\*\* Fonds lancé le 2 février 2021.

\*\*\* Fonds lancé le 19 mai 2021.

Les notes des pages 30 à 56 font partie intégrante des présents états financiers condensés

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Compte de résultat global condensé

Pour le semestre clos le 30 juin 2023

|                                                                                                                                                      |   | LOOMIS<br>SAYLES<br>MULTISECTOR<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES<br>MULTISECTOR<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES HIGH<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES HIGH<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS SAYLES<br>GLOBAL<br>OPPORTUNISTIC<br>BOND FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS SAYLES<br>GLOBAL<br>OPPORTUNISTIC<br>BOND FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES<br>ALTERNATIVE<br>RISK PREMIA<br>FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES<br>ALTERNATIVE<br>RISK PREMIA<br>FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|--------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|
| Notes                                                                                                                                                |   |                                                                          |                                                                          |                                                                |                                                                |                                                                                 |                                                                                 |                                                                                  |                                                                                  |
| Produit des investissements                                                                                                                          |   | 12 821 631                                                               | 13 646 145                                                               | 231 680                                                        | 350 588                                                        | 577 580                                                                         | 857 546                                                                         | 504 884                                                                          | 363 674                                                                          |
| Gain (perte) net(te) réalisé(e) sur<br>l'actif et le passif financiers à leur<br>juste valeur par le biais du compte de<br>résultat                  |   | 4 763 123                                                                | (118 115 985)                                                            | 118 003                                                        | (2 806 450)                                                    | 1 352 420                                                                       | (13 583 433)                                                                    | 1 093 253                                                                        | (4 482 970)                                                                      |
| <b>Total du produit des<br/>investissements</b>                                                                                                      |   | <u>17 584 754</u>                                                        | <u>(104 469 840)</u>                                                     | <u>349 683</u>                                                 | <u>(2 455 862)</u>                                             | <u>1 930 000</u>                                                                | <u>(12 725 887)</u>                                                             | <u>1 598 137</u>                                                                 | <u>(4 119 296)</u>                                                               |
| Charges d'exploitation                                                                                                                               | 3 | (3 681 968)                                                              | (4 640 480)                                                              | (102 515)                                                      | (218 171)                                                      | (209 179)                                                                       | (484 028)                                                                       | (56 152)                                                                         | (326 614)                                                                        |
| Remboursement des charges                                                                                                                            | 3 | 128 990                                                                  | 156 800                                                                  | 48 262                                                         | 129 254                                                        | 28 143                                                                          | 189 735                                                                         | —                                                                                | 259 957                                                                          |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                        |   | <u>(3 552 978)</u>                                                       | <u>(4 483 680)</u>                                                       | <u>(54 253)</u>                                                | <u>(88 917)</u>                                                | <u>(181 036)</u>                                                                | <u>(294 293)</u>                                                                | <u>(56 152)</u>                                                                  | <u>(66 657)</u>                                                                  |
| <b>Résultat net issu de l'exploitation<br/>avant charges financières</b>                                                                             |   | 14 031 776                                                               | (108 953 520)                                                            | 295 430                                                        | (2 544 779)                                                    | 1 748 964                                                                       | (13 020 180)                                                                    | 1 541 985                                                                        | (4 185 953)                                                                      |
| <b>Charges financières</b>                                                                                                                           |   |                                                                          |                                                                          |                                                                |                                                                |                                                                                 |                                                                                 |                                                                                  |                                                                                  |
| Distributions aux Détenteurs                                                                                                                         |   |                                                                          |                                                                          |                                                                |                                                                |                                                                                 |                                                                                 |                                                                                  |                                                                                  |
| d'actions participantes remboursables                                                                                                                |   | (1 965 848)                                                              | (2 061 685)                                                              | (98 911)                                                       | (810 762)                                                      | (160 913)                                                                       | (4 899 450)                                                                     | —                                                                                | —                                                                                |
| Intérêts de découvert                                                                                                                                |   | (2 623)                                                                  | —                                                                        | —                                                              | —                                                              | (367)                                                                           | —                                                                               | —                                                                                | —                                                                                |
| <b>Total des charges financières</b>                                                                                                                 |   | <u>(1 968 471)</u>                                                       | <u>(2 061 685)</u>                                                       | <u>(98 911)</u>                                                | <u>(810 762)</u>                                               | <u>(161 280)</u>                                                                | <u>(4 899 450)</u>                                                              | <u>—</u>                                                                         | <u>—</u>                                                                         |
| <b>Bénéfice avant impôt</b>                                                                                                                          |   | 12 063 305                                                               | (111 015 205)                                                            | 196 519                                                        | (3 355 541)                                                    | 1 587 684                                                                       | (17 919 630)                                                                    | 1 541 985                                                                        | (4 185 953)                                                                      |
| Impôt retenu à la source                                                                                                                             |   | (104 412)                                                                | (129 298)                                                                | (1 985)                                                        | (1 903)                                                        | (4 283)                                                                         | (13 052)                                                                        | (34 903)                                                                         | (27 108)                                                                         |
| <b>Variation nette des actifs nets<br/>attribuables aux détenteurs<br/>d'actions participantes<br/>remboursables résultant de<br/>l'exploitation</b> |   | <u>11 958 893</u>                                                        | <u>(111 144 503)</u>                                                     | <u>194 534</u>                                                 | <u>(3 357 444)</u>                                             | <u>1 583 401</u>                                                                | <u>(17 932 682)</u>                                                             | <u>1 507 082</u>                                                                 | <u>(4 213 061)</u>                                                               |

Il n'existe aucun résultat autre que celui indiqué au Compte de résultat global condensé. Tous les montants susmentionnés correspondant aux résultats de la période sous revue concernent les activités en cours.

Les notes des pages 29 à 55 font partie intégrante des présents états financiers condensés

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Compte de résultat global condensé (suite)

### Pour le semestre clos le 30 juin 2023 (suite)

|                                                                                                                                                      |       | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>HIGH YIELD<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>HIGH YIELD<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>CREDIT FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>CREDIT FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS SAYLES<br>SUSTAINABLE<br>EURO CREDIT<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS SAYLES<br>SUSTAINABLE<br>EURO CREDIT<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2022 | TOTAL<br>USD<br>30 juin<br>2023 | TOTAL<br>USD<br>30 juin<br>2022 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|-----------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                                                                                                                                                      | Notes |                                                                       |                                                                       |                                                                |                                                                |                                                                               |                                                                               |                                 |                                 |
| Produit des investissements                                                                                                                          |       | 632 729                                                               | 328 366                                                               | 1 620 595                                                      | 446 113                                                        | 7 503 126                                                                     | 1 327 612                                                                     | 24 780 062                      | 17 415 584                      |
| Gain (perte) net(te) réalisé(e) sur<br>l'actif et le passif financiers à leur<br>juste valeur par le biais du compte de<br>résultat                  |       | 588 391                                                               | (4 756 778)                                                           | 1 301 199                                                      | (14 288 812)                                                   | 3 177 936                                                                     | (34 046 786)                                                                  | 12 855 470                      | (194 494 262)                   |
| <b>Total du produit des<br/>investissements</b>                                                                                                      |       | <b>1 221 120</b>                                                      | <b>(4 428 412)</b>                                                    | <b>2 921 794</b>                                               | <b>(13 842 699)</b>                                            | <b>10 681 062</b>                                                             | <b>(32 719 174)</b>                                                           | <b>37 635 532</b>               | <b>(177 078 678)</b>            |
| Charges d'exploitation                                                                                                                               | 3     | (100 853)                                                             | (128 251)                                                             | (409 927)                                                      | (304 741)                                                      | (1 570 265)                                                                   | (903 171)                                                                     | (6 320 232)                     | (7 066 185)                     |
| Remboursement des charges                                                                                                                            | 3     | 46 171                                                                | 76 216                                                                | 271 391                                                        | 148 473                                                        | 949 849                                                                       | 543 523                                                                       | 1 588 140                       | 1 538 873                       |
| Charges d'exploitation nettes                                                                                                                        |       | (54 682)                                                              | (52 035)                                                              | (138 536)                                                      | (156 268)                                                      | (620 416)                                                                     | (359 648)                                                                     | (4 732 092)                     | (5 527 312)                     |
| <b>Résultat net issu de l'exploitation<br/>avant charges financières</b>                                                                             |       | <b>1 166 438</b>                                                      | <b>(4 480 447)</b>                                                    | <b>2 783 258</b>                                               | <b>(13 998 967)</b>                                            | <b>10 060 646</b>                                                             | <b>(33 078 822)</b>                                                           | <b>32 903 440</b>               | <b>(182 605 990)</b>            |
| <b>Charges financières</b>                                                                                                                           |       |                                                                       |                                                                       |                                                                |                                                                |                                                                               |                                                                               |                                 |                                 |
| Distributions aux Détenteurs<br>d'actions participantes remboursables                                                                                |       | —                                                                     | —                                                                     | —                                                              | —                                                              | —                                                                             | —                                                                             | (2 225 672)                     | (7 771 897)                     |
| Intérêts de découvert                                                                                                                                |       | —                                                                     | —                                                                     | —                                                              | —                                                              | —                                                                             | —                                                                             | (2 992)                         | —                               |
| <b>Total des charges financières</b>                                                                                                                 |       | <b>—</b>                                                              | <b>—</b>                                                              | <b>—</b>                                                       | <b>—</b>                                                       | <b>—</b>                                                                      | <b>—</b>                                                                      | <b>(2 228 664)</b>              | <b>(7 771 897)</b>              |
| <b>Bénéfice avant impôt</b>                                                                                                                          |       | <b>1 166 438</b>                                                      | <b>(4 480 447)</b>                                                    | <b>2 783 258</b>                                               | <b>(13 998 967)</b>                                            | <b>10 060 646</b>                                                             | <b>(33 078 822)</b>                                                           | <b>30 674 776</b>               | <b>(190 377 887)</b>            |
| Impôt retenu à la source                                                                                                                             |       | (1 120)                                                               | (386)                                                                 | (3 280)                                                        | 604                                                            | (23 881)                                                                      | (10 056)                                                                      | (176 437)                       | (181 646)                       |
| <b>Variation nette des actifs nets<br/>attribuables aux détenteurs<br/>d'actions participantes<br/>remboursables résultant de<br/>l'exploitation</b> |       | <b>1 165 318</b>                                                      | <b>(4 480 833)</b>                                                    | <b>2 779 978</b>                                               | <b>(13 998 363)</b>                                            | <b>10 036 765</b>                                                             | <b>(33 088 878)</b>                                                           | <b>30 498 339</b>               | <b>(190 559 533)</b>            |

Il n'existe aucun résultat autre que celui indiqué au Compte de résultat global condensé. Tous les montants susmentionnés correspondant aux résultats de la période sous revue concernent les activités en cours.

Les notes des pages 30 à 56 font partie intégrante des présents états financiers condensés

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## État condensé des variations de l'actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables

Pour le semestre clos le 30 juin 2023

|                                                                                                                                      |   | LOOMIS SAYLES<br>MULTISECTOR<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES<br>MULTISECTOR<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES HIGH<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES HIGH<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS SAYLES<br>GLOBAL<br>OPPORTUNISTIC<br>BOND FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS SAYLES<br>GLOBAL<br>OPPORTUNISTIC<br>BOND FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES<br>ALTERNATIVE<br>RISK PREMIA<br>FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES<br>ALTERNATIVE<br>RISK PREMIA<br>FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|-----------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|
| Notes                                                                                                                                |   |                                                                       |                                                                          |                                                                |                                                                |                                                                                 |                                                                                 |                                                                                  |                                                                                  |
| <b>Actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables au 1<sup>er</sup> janvier 2023 (2022)</b>              |   | 592 786 282                                                           | 819 775 029                                                              | 8 627 135                                                      | 16 489 497                                                     | 58 732 256                                                                      | 81 275 147                                                                      | 25 045 099                                                                       | 30 183 827                                                                       |
| <b>Variation nette des actifs nets attribuables aux détenteurs d'actions participantes remboursables résultant de l'exploitation</b> |   | 11 958 893                                                            | (111 144 503)                                                            | 194 534                                                        | (3 357 444)                                                    | 1 583 401                                                                       | (17 932 682)                                                                    | 1 507 082                                                                        | (4 213 061)                                                                      |
| <b>Opérations sur actions</b>                                                                                                        |   |                                                                       |                                                                          |                                                                |                                                                |                                                                                 |                                                                                 |                                                                                  |                                                                                  |
| Produit de la vente des actions participantes remboursables émises <sup>1</sup>                                                      | 2 | 57 719 060                                                            | 72 812 320                                                               | 68 780                                                         | 1 525 576                                                      | 7 858 394                                                                       | 10 295 551                                                                      | –                                                                                | 2 606 874                                                                        |
| Produit du rachat des actions participantes remboursables <sup>2</sup>                                                               | 2 | (96 467 327)                                                          | (174 273 723)                                                            | (1 847 911)                                                    | (4 025 217)                                                    | (29 582 343)                                                                    | (10 055 842)                                                                    | (80 065)                                                                         | (350 173)                                                                        |
| <b>Hausse/(baisse) totale de l'actif net résultant des opérations sur actions</b>                                                    |   | (38 748 267)                                                          | (101 461 403)                                                            | (1 779 131)                                                    | (2 499 641)                                                    | (21 723 949)                                                                    | 239 709                                                                         | (80 065)                                                                         | 2 256 701                                                                        |
| Hausse/(baisse) totale de l'actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables                               |   | (26 789 374)                                                          | (212 605 906)                                                            | (1 584 597)                                                    | (5 857 085)                                                    | (20 140 548)                                                                    | (17 692 973)                                                                    | 1 427 017                                                                        | (1 956 360)                                                                      |
| Écart de conversion                                                                                                                  |   | –                                                                     | –                                                                        | –                                                              | –                                                              | –                                                                               | –                                                                               | –                                                                                | –                                                                                |
| <b>Actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables au 30 juin 2023 (2022)</b>                             |   | 565 996 908                                                           | 607 169 123                                                              | 7 042 538                                                      | 10 632 412                                                     | 38 591 708                                                                      | 63 582 174                                                                      | 26 472 116                                                                       | 28 227 467                                                                       |

<sup>1</sup> Comprend des distributions réinvesties de 487 238 USD sur le Loomis Sayles Multisector Income Fund (30 juin 2022 : 412 349 USD), 38 864 USD sur le Loomis Sayles High Income Fund (30 juin 2022 : 235 157 USD), 11 494 USD sur le Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (30 juin 2022 : 771 564 USD), 0 USD sur le Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (30 juin 2022 : 0 USD), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro High Yield Fund (30 juin 2022 : 0 EUR), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro Credit Fund (30 juin 2022 : 0 EUR) et 0 EUR sur le Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (30 juin 2022 : 0 EUR).

<sup>2</sup> Le produit des Actions participantes remboursables émises et le produit des rachats des Actions participantes remboursables comprennent des ajustements de régularisation des revenus de 0 USD sur le Loomis Sayles Multisector Income Fund (30 juin 2022 : 0 USD), 8 180 USD sur le Loomis Sayles High Income Fund (30 juin 2022 : 6 897 USD), 50 907 USD sur le Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (30 juin 2022 : 0 USD), 0 USD sur le Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (30 juin 2022 : 0 USD), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro High Yield Fund (30 juin 2022 : 0 EUR), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro Credit Fund (30 juin 2022 : 0 EUR) et 0 EUR sur le Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (30 juin 2022 : 0 EUR).

## État condensé des variations de l'actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2023 (suite)

|       |                                                                                                                                      | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>HIGH YIELD<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>HIGH YIELD<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>CREDIT FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>CREDIT FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS SAYLES<br>SUSTAINABLE<br>EURO CREDIT<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS SAYLES<br>SUSTAINABLE<br>EURO CREDIT<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2022 | TOTAL<br>USD<br>30 juin<br>2023 | TOTAL<br>USD<br>30 juin<br>2022 |
|-------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| Notes |                                                                                                                                      |                                                                       |                                                                       |                                                                |                                                                |                                                                               |                                                                               |                                 |                                 |
|       | <b>Actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables au 1<sup>er</sup> janvier 2023 (2022)</b>              | 27 441 986                                                            | 32 273 023                                                            | 101 662 770                                                    | 120 603 868                                                    | 397 430 952                                                                   | 181 058 544                                                                   | 1 247 136 006                   | 1 327 474 875                   |
|       | <b>Variation nette des actifs nets attribuables aux détenteurs d'actions participantes remboursables résultant de l'exploitation</b> | 1 165 318                                                             | (4 480 833)                                                           | 2 779 978                                                      | (13 998 363)                                                   | 10 036 765                                                                    | (33 088 878)                                                                  | 30 498 339                      | (190 559 533)                   |
|       | <b>Opérations sur actions</b>                                                                                                        |                                                                       |                                                                       |                                                                |                                                                |                                                                               |                                                                               |                                 |                                 |
|       | Produit de la vente des actions participantes remboursables émises <sup>1</sup>                                                      | 2 986 294                                                             | 1 602 191                                                             | 28 254 913                                                     | 2 577 761                                                      | 181 212 396                                                                   | 242 332 848                                                                   | 297 433 115                     | 344 957 128                     |
|       | Produit du rachat des actions participantes remboursables <sup>2</sup>                                                               | (1 476 235)                                                           | (2 986 926)                                                           | (22 370 861)                                                   | (8 917 667)                                                    | (51 919 775)                                                                  | (45 952 482)                                                                  | (210 639 302)                   | (249 191 634)                   |
|       | <b>Augmentation (diminution) totale de l'actif net résultant des transactions sur actions</b>                                        | 1 510 059                                                             | (1 384 735)                                                           | 5 884 052                                                      | (6 339 906)                                                    | 129 292 621                                                                   | 196 380 366                                                                   | 86 793 813                      | 95 765 494                      |
|       | Hausse/(baisse) totale de l'actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables                               | 2 675 377                                                             | (5 865 568)                                                           | 8 664 030                                                      | (20 338 269)                                                   | 139 329 386                                                                   | 163 291 488                                                                   | 117 292 152                     | (94 794 039)                    |
|       | Écart de conversion                                                                                                                  | –                                                                     | –                                                                     | –                                                              | –                                                              | –                                                                             | –                                                                             | 12 505 223                      | (30 638 575)                    |
|       | <b>Actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables au 30 juin 2023 (2022)</b>                             | 30 117 363                                                            | 26 407 455                                                            | 110 326 800                                                    | 100 265 599                                                    | 536 760 338                                                                   | 344 350 032                                                                   | 1 376 933 381                   | 1 202 042 261                   |

<sup>1</sup> Comprend des distributions réinvesties de 487 238 USD sur le Loomis Sayles Multisector Income Fund (30 juin 2022 : 412 349 USD), 38 864 USD sur le Loomis Sayles High Income Fund (30 juin 2022 : 235 157 USD), 11 494 USD sur le Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (30 juin 2022 : 771 564 USD), 0 USD sur le Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (30 juin 2022 : 0 USD), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro High Yield Fund (30 juin 2022 : 0 EUR), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro Credit Fund (30 juin 2022 : 0 EUR) et 0 EUR sur le Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (30 juin 2022 : 0 EUR).

<sup>2</sup> Le produit des Actions participantes remboursables émises et le produit des rachats des Actions participantes remboursables comprennent des ajustements de régularisation des revenus de 0 USD sur le Loomis Sayles Multisector Income Fund (30 juin 2022 : 0 USD), 8 180 USD sur le Loomis Sayles High Income Fund (30 juin 2022 : 6 897 USD), 50 907 USD sur le Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (30 juin 2022 : 0 USD), 0 USD sur le Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (30 juin 2022 : 0 USD), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro High Yield Fund (30 juin 2022 : 0 EUR), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro Credit Fund (30 juin 2022 : 0 EUR) et 0 EUR sur le Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (30 juin 2022 : 0 EUR).

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## État condensé des flux de trésorerie

Pour le semestre clos le 30 juin 2023

|                                                                                              | LOOMIS<br>SAYLES<br>MULTISECTOR<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES<br>MULTISECTOR<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES HIGH<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES HIGH<br>INCOME FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES<br>GLOBAL<br>OPPORTUNISTIC<br>BOND FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES<br>GLOBAL<br>OPPORTUNISTIC<br>BOND FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES<br>ALTERNATIVE<br>RISK PREMIA<br>FUND<br>USD<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES<br>ALTERNATIVE<br>RISK PREMIA<br>FUND<br>USD<br>30 juin<br>2022 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Flux de trésorerie résultant des activités d'exploitation</b>                             |                                                                          |                                                                          |                                                                |                                                                |                                                                                    |                                                                                    |                                                                                  |                                                                                  |
| Achat d'actif financier et règlement de passif financier                                     | (208 715 560)                                                            | (97 839 663)                                                             | (2 456 373)                                                    | (3 101 200)                                                    | (17 282 364)                                                                       | (50 084 547)                                                                       | (67 672 335)                                                                     | (106 270 315)                                                                    |
| Produit de la vente d'investissements à leur juste valeur par le biais du compte de résultat | 221 521 551                                                              | 179 688 013                                                              | 4 088 594                                                      | 6 410 777                                                      | 38 368 370                                                                         | 53 434 128                                                                         | 68 136 167                                                                       | 105 783 983                                                                      |
| Revenu perçu sur les obligations                                                             | 11 689 419                                                               | 13 173 846                                                               | 251 386                                                        | 390 803                                                        | 776 945                                                                            | 914 075                                                                            | 205 267                                                                          | 316 540                                                                          |
| Revenu perçu sur les intérêts de dépôt                                                       | 190 100                                                                  | 12 223                                                                   | 4 517                                                          | 331                                                            | 18 756                                                                             | 905                                                                                | 98 933                                                                           | 5 073                                                                            |
| Autres revenus perçus                                                                        | 586 173                                                                  | 934 341                                                                  | (52 299)                                                       | 39 875                                                         | (142 287)                                                                          | 17 237                                                                             | (55 730)                                                                         | 80 437                                                                           |
| Charges d'exploitation payées                                                                | (3 499 367)                                                              | (4 744 843)                                                              | (64 395)                                                       | (89 491)                                                       | (209 150)                                                                          | (291 412)                                                                          | (116 443)                                                                        | (2 918)                                                                          |
| <b>Entrée/(sortie) nette du flux de trésorerie résultant des activités d'exploitation</b>    | <b>21 772 316</b>                                                        | <b>91 223 917</b>                                                        | <b>1 771 430</b>                                               | <b>3 651 095</b>                                               | <b>21 530 270</b>                                                                  | <b>3 990 386</b>                                                                   | <b>595 859</b>                                                                   | <b>(87 200)</b>                                                                  |
| <b>Flux de trésorerie résultant des activités de financement</b>                             |                                                                          |                                                                          |                                                                |                                                                |                                                                                    |                                                                                    |                                                                                  |                                                                                  |
| Produit de l'émission d'actions participantes remboursables                                  | 57 198 814                                                               | 72 436 758                                                               | 28 777                                                         | 1 310 436                                                      | 7 933 361                                                                          | 9 551 830                                                                          | —                                                                                | 2 606 874                                                                        |
| Dividendes versés aux détenteurs d'actions participantes remboursables                       | (1 965 848)                                                              | (2 061 685)                                                              | (98 911)                                                       | (810 762)                                                      | (160 913)                                                                          | (4 899 450)                                                                        | —                                                                                | —                                                                                |
| Dividendes réinvestis                                                                        | 487 238                                                                  | 412 349                                                                  | 38 864                                                         | 235 157                                                        | 11 494                                                                             | 771 564                                                                            | —                                                                                | —                                                                                |
| Intérêts de découvert payés                                                                  | (2 623)                                                                  | —                                                                        | —                                                              | —                                                              | (367)                                                                              | —                                                                                  | —                                                                                | —                                                                                |
| Paievements sur les rachats des actions participantes remboursables                          | (96 838 285)                                                             | (179 047 091)                                                            | (1 693 396)                                                    | (4 086 877)                                                    | (29 588 817)                                                                       | (10 296 881)                                                                       | (80 065)                                                                         | (350 173)                                                                        |
| <b>Entrée/(sortie) du flux de trésorerie résultant des activités de financement</b>          | <b>(41 120 704)</b>                                                      | <b>(108 259 669)</b>                                                     | <b>(1 724 666)</b>                                             | <b>(3 352 046)</b>                                             | <b>(21 805 242)</b>                                                                | <b>(4 872 937)</b>                                                                 | <b>(80 065)</b>                                                                  | <b>2 256 701</b>                                                                 |
| <b>Hausse/(baisse) nette des liquidités et des quasi-liquidités pour la période</b>          | <b>(19 348 388)</b>                                                      | <b>(17 035 752)</b>                                                      | <b>46 764</b>                                                  | <b>299 049</b>                                                 | <b>(274 972)</b>                                                                   | <b>(882 551)</b>                                                                   | <b>515 794</b>                                                                   | <b>2 169 501</b>                                                                 |
| Liquidités et quasi-liquidités au dimanche 1 janvier 2023 (2022)                             | 6 173 266                                                                | 22 669 049                                                               | 242 955                                                        | 156 323                                                        | 1 280 884                                                                          | 2 512 479                                                                          | 5 090 171                                                                        | 6 203 018                                                                        |
| Écart de conversion                                                                          | —                                                                        | —                                                                        | —                                                              | —                                                              | —                                                                                  | —                                                                                  | —                                                                                | —                                                                                |
| <b>Liquidités et quasi-liquidités au 30 juin 2023 (2022)</b>                                 | <b>(13 175 122)</b>                                                      | <b>5 633 297</b>                                                         | <b>289 719</b>                                                 | <b>455 372</b>                                                 | <b>1 005 912</b>                                                                   | <b>1 629 928</b>                                                                   | <b>5 605 965</b>                                                                 | <b>8 372 519</b>                                                                 |

Les notes des pages 29 à 55 font partie intégrante des présents états financiers condensés

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## État des flux de trésorerie condensé (suite)

### Pour le semestre clos le 30 juin 2023 (suite)

|                                                                                               | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>HIGH YIELD<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>HIGH YIELD<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>CREDIT FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES EURO<br>CREDIT FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2022 | LOOMIS<br>SAYLES<br>SUSTAINABLE<br>EURO CREDIT<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2023 | LOOMIS<br>SAYLES<br>SUSTAINABLE<br>EURO CREDIT<br>FUND<br>EUR<br>30 juin<br>2022 | TOTAL<br>USD<br>30 juin<br>2023 | TOTAL<br>USD<br>30 juin<br>2022 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| <b>Flux de trésorerie résultant des activités d'exploitation</b>                              |                                                                       |                                                                       |                                                                |                                                                |                                                                                  |                                                                                  |                                 |                                 |
| Achat d'actif financier et règlement de passif financier                                      | (20 068 815)                                                          | (21 340 765)                                                          | (97 579 425)                                                   | (114 768 101)                                                  | (504 871 509)                                                                    | (414 732 132)                                                                    | (975 295 678)                   | (832 572 446)                   |
| Produit de la vente d'investissements à leur juste valeur par le biais du compte de résultat  | 18 359 843                                                            | 22 956 437                                                            | 92 008 132                                                     | 121 292 472                                                    | 376 824 424                                                                      | 231 687 960                                                                      | 863 641 589                     | 737 740 101                     |
| Revenu perçu sur les obligations                                                              | 616 015                                                               | 424 597                                                               | 1 522 949                                                      | 670 162                                                        | 6 231 154                                                                        | 673 719                                                                          | 22 054 816                      | 16 644 119                      |
| Revenu perçu sur les intérêts de dépôt                                                        | 11 772                                                                | (3 529)                                                               | 20 355                                                         | (11 599)                                                       | 93 139                                                                           | (24 410)                                                                         | 448 971                         | (22 803)                        |
| Autres revenus perçus                                                                         | (31 083)                                                              | 18 167                                                                | (50 098)                                                       | 17 763                                                         | (164 231)                                                                        | (23 830)                                                                         | 68 113                          | 1 084 540                       |
| Charges d'exploitation payées                                                                 | (58 221)                                                              | (51 397)                                                              | (145 495)                                                      | (163 124)                                                      | (645 660)                                                                        | (269 492)                                                                        | (4 816 023)                     | (5 634 675)                     |
| <b>Entrée/(sortie) nette du flux de trésorerie résultant des activités d'exploitation</b>     | <b>(1 170 489)</b>                                                    | <b>2 003 510</b>                                                      | <b>(4 223 582)</b>                                             | <b>7 037 573</b>                                               | <b>(122 532 683)</b>                                                             | <b>(182 688 185)</b>                                                             | <b>(93 898 212)</b>             | <b>(82 761 164)</b>             |
| <b>Flux de trésorerie résultant des activités de financement</b>                              |                                                                       |                                                                       |                                                                |                                                                |                                                                                  |                                                                                  |                                 |                                 |
| Produit de l'émission d'actions participantes remboursables                                   | 2 895 637                                                             | 1 603 798                                                             | 28 214 412                                                     | 2 861 240                                                      | 178 750 321                                                                      | 238 671 848                                                                      | 294 118 616                     | 340 093 355                     |
| Dividendes versés aux détenteurs d'actions participantes remboursables                        | —                                                                     | —                                                                     | —                                                              | —                                                              | —                                                                                | —                                                                                | (2 225 672)                     | (7 771 897)                     |
| Dividendes réinvestis                                                                         | —                                                                     | —                                                                     | —                                                              | —                                                              | —                                                                                | —                                                                                | 537 596                         | 1 419 070                       |
| Intérêts de découvert payés                                                                   | —                                                                     | —                                                                     | —                                                              | —                                                              | —                                                                                | —                                                                                | (2 992)                         | —                               |
| Paiements sur les rachats des actions participantes remboursables                             | (1 483 770)                                                           | (2 998 006)                                                           | (22 385 549)                                                   | (8 960 105)                                                    | (50 323 571)                                                                     | (46 159 340)                                                                     | (209 145 006)                   | (254 539 911)                   |
| <b>Entrée/(sortie) nette du flux de trésorerie résultant des activités de financement</b>     | <b>1 411 867</b>                                                      | <b>(1 394 208)</b>                                                    | <b>5 828 863</b>                                               | <b>(6 098 865)</b>                                             | <b>128 426 750</b>                                                               | <b>192 512 508</b>                                                               | <b>83 282 542</b>               | <b>79 200 617</b>               |
| <b>Augmentation/(diminution) nette des liquidités et des quasi-liquidités pour la période</b> | <b>241 378</b>                                                        | <b>609 302</b>                                                        | <b>1 605 281</b>                                               | <b>938 708</b>                                                 | <b>5 894 067</b>                                                                 | <b>9 824 323</b>                                                                 | <b>(10 615 670)</b>             | <b>(3 560 547)</b>              |
| Liquidités et quasi-liquidités au 1 <sup>er</sup> janvier 2023 (2022)                         | 1 223 219                                                             | 534 589                                                               | 1 725 545                                                      | 2 125 711                                                      | 6 515 071                                                                        | 1 432 606                                                                        | 22 887 556                      | 36 195 322                      |
| Écart de conversion                                                                           | —                                                                     | —                                                                     | —                                                              | —                                                              | —                                                                                | —                                                                                | 224 764                         | (375 525)                       |
| <b>Liquidités et quasi-liquidités au 30 juin 2023 (2022)</b>                                  | <b>1 464 597</b>                                                      | <b>1 143 891</b>                                                      | <b>3 330 826</b>                                               | <b>3 064 419</b>                                               | <b>12 409 138</b>                                                                | <b>11 256 929</b>                                                                | <b>12 496 650</b>               | <b>32 259 250</b>               |

Les notes des pages 30 à 56 font partie intégrante des présents états financiers condensés

**Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023**

**1. PRINCIPALES POLITIQUES COMPTABLES**

Les principales politiques comptables utilisées pour la préparation de ces états financiers condensés sont définies ci-dessous. Elles ont été utilisées systématiquement pour toutes les périodes présentées, sauf indication contraire dans le texte suivant. Les politiques appliquées sont conformes aux politiques utilisées pour la préparation des états financiers de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

**a) Principes comptables**

Les états financiers condensés ont été préparés conformément aux normes IFRS adoptées par l'Union européenne (UE) et la loi irlandaise intégrant la Loi sur les sociétés de 2014 et la Réglementation relative aux OPCVM. Les états financiers ont été préparés conformément aux prises de position de l'IAS 34 « Information financière intermédiaire », publié par le Conseil des normes comptables internationales (IASB). Il convient de lire ces états financiers condensés non révisés en parallèle des états financiers révisés de l'exercice clos le 31 décembre 2022. Les états financiers condensés ont été préparés conformément au modèle de coût historique tel que modifié par la réévaluation des actif et passif financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat.

La préparation des états financiers en conformité avec les normes IFRS nécessite de recourir à certaines estimations comptables cruciales. Elle exige également du conseil d'administration qu'il exerce son jugement dans la procédure d'application des politiques comptables de la Société.

Le Gestionnaire Financier est agréé et réglementé par la Securities and Exchange Commission (« SEC ») aux États-Unis en tant que conseiller en investissements. La Société estime qu'il n'existe aucune différence importante entre les normes IFRS et les informations équivalentes des principes comptables généralement reconnus aux États-Unis (« PCGR des États-Unis ») à rapprocher aux fins de la Rule 206 de la SEC relative à la garde de titres.

Le Loomis Sayles Multisector Income Fund est agréé en vertu de la Section 104 de la Securities and Futures Ordinance (la « SFO ») de Hong Kong et le Fonds est soumis aux exigences du Code on Unit Trusts and Mutual Funds (code sur les fonds communs de placement).

La Société estime que les présents états financiers condensés sont préparés conformément aux exigences des lois de Hong Kong.

La Société n'a identifié aucune incertitude significative liée à des événements ou des conditions qui, individuellement ou collectivement, pourraient jeter un doute important sur la capacité de la Société et des Fonds à poursuivre leurs activités.

Lors de la préparation des états financiers, la Société a conclu que l'utilisation par les Administrateurs de la base comptable de la continuité d'exploitation dans la préparation des états financiers était appropriée. Toutefois, étant donné que les événements ou conditions futurs ne peuvent pas être tous prédits, cette conclusion ne constitue pas une garantie quant à la capacité de la Société et des Fonds à poursuivre leurs activités.

**b) Liquidités et quasi-liquidités**

Les liquidités et les quasi-liquidités incluent les avoirs en caisse, les dépôts bancaires à vue, les autres investissements à court terme (échéance initiale de trois mois au plus) extrêmement liquides et les découverts bancaires.

Tous les avoirs en banque sont déposés auprès de Brown Brothers Harriman & Co., ou auprès d'établissements tiers agréés par la Société des dépôts au jour le jour, ou directement auprès du sous-dépositaire. Tous les dépôts bancaires à vue sont restitués au Dépositaire le jour suivant.

En réponse à la publication par la Banque centrale d'Irlande de la Loi de 2013 relative à la Banque centrale (Application et Contrôle) (Article 48 (1)) et au Règlement de 2015 relatif aux versements des investisseurs pour les Prestataires de services du Fonds (le « Règlement sur les versements des investisseurs » ou « IMR ») en mars 2015 (en vigueur depuis le 1er juillet 2016), la Société a procédé à une évaluation avec l'Agent administratif de la manière dont les règlements des souscriptions, des distributions et des rachats sont acheminés à destination de et depuis la Société. À l'issue de cette évaluation, et depuis le 1er juillet 2016, les règlements des souscriptions et des rachats sont acheminés par le biais d'un compte regroupé d'encaissement des fonds, au nom de la Société.



Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

1. PRINCIPALES POLITIQUES COMPTABLES (suite)

c) Taux de change

Les états financiers condensés sont présentés en dollars américains (USD) et en euros (EUR). Un écart de conversion est inclus dans l'état des résultats et des variations de l'actif net pour déterminer les résultats de la période comptable. Les taux de change suivants, en vigueur au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, ont été utilisés pour convertir l'actif et le passif libellés dans des devises autres que le dollar américain :

|             | 30 juin<br>2023 | 31 décembre<br>2022 |     | 30 juin<br>2023 | 31 décembre<br>2022 |
|-------------|-----------------|---------------------|-----|-----------------|---------------------|
| 1 USD = AUD | 1,5023          | 1,4994              | JPY | 144,5350        | 131,9450            |
| BRL         | 4,8240          | 5,2798              | KRW | 1 317,6500      | 1 264,5000          |
| CAD         | 1,3233          | 1,3550              | MXN | 17,1505         | 19,4873             |
| CHF         | 0,8947          | 0,9252              | MYR | 4,6675          | 4,4050              |
| CLP         | 802,1500        | 851,9500            | NOK | 10,7136         | 9,8510              |
| CNH         | 7,2748          | 6,9189              | NZD | 1,6323          | 1,5812              |
| CNY         | 7,2641          | 6,9517              | PEN | 3,6248          | 3,8135              |
| COP         | 4 175,7750      | 4 848,8850          | PLN | 4,0630          | 4,3863              |
| CZK         | 21,7769         | S/O                 | RUB | 89,5000         | 73,0000             |
| DKK         | 6,8249          | 6,9679              | SEK | 10,8013         | 10,4195             |
| EGP         | 30,9000         | 24,7550             | SGD | 1,3534          | 1,3412              |
| EUR         | 0,9166          | 0,9370              | THB | 35,4550         | 34,6350             |
| GBP         | 0,7866          | 0,8313              | TRY | 26,0700         | 18,7195             |
| HKD         | 7,8366          | 7,8050              | TWD | 31,1445         | 30,7355             |
| IDR         | 14 992,5000     | 15 567,5000         | UYU | 37,3750         | 39,7650             |
| ILS         | 3,7110          | 3,5285              | ZAR | 18,8913         | 17,0150             |
| INR         | 82,0363         | 82,7300             |     |                 |                     |
|             | 30 juin<br>2023 | 31 décembre<br>2022 |     |                 |                     |
| 1 EUR = AUD | 1,6390          | 1,5738              |     |                 |                     |
| CHF         | 0,9761          | S/O                 |     |                 |                     |
| USD         | 1,0910          | 1,0673              |     |                 |                     |

d) Dividendes payables aux détenteurs d'Actions participantes remboursables

Les dividendes versés aux détenteurs d'Actions participantes remboursables sont comptabilisés au poste des charges financières dans le compte de résultat global condensé.

e) Swing Pricing

Les Fonds peuvent appliquer un mécanisme de swing pricing unique conformément au Supplément concerné du Prospectus au lieu du mécanisme de prix unique. Au cours de la période close le 30 juin 2023, seuls les Loomis Sayles High Income Fund, Loomis Sayles Euro Credit Fund, Loomis Sayles Euro High Yield Fund et Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund ont été en mesure d'appliquer un mécanisme de swing pricing unique conformément à leurs Suppléments au Prospectus.

Au cours de la période close le 30 juin 2023, seuls les Loomis Sayles Euro Credit Fund, Loomis Sayles Euro High Yield Fund et Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund ont appliqué des ajustements de swing pricing.

Au cours de la période close le 30 juin 2023, la Valeur d'inventaire nette par action d'aucun autre Fonds n'a fait l'objet d'un ajustement de swing pricing (à la clôture de l'exercice le 31 décembre 2022 : néant).

**1. PRINCIPALES POLITIQUES COMPTABLES (suite)**

**e) Swing Pricing (suite)**

Dans le cadre de la méthodologie du swing pricing, le Prix lors d'un Jour d'opération donné peut être ajusté afin de prendre en compte l'effet des dilutions et de protéger les intérêts des Actionnaires en cas de souscriptions, de rachats et/ou de conversions significatifs vers et/ou en dehors d'un Fonds lors de ce Jour d'opération. Ainsi, si, à un Jour d'opération, le montant total des opérations sur Actions d'un Fonds dépasse un seuil déterminé par les Administrateurs, la Valeur d'inventaire nette peut être corrigée d'un certain montant, qui doit rester inférieur à 2 % de la Valeur d'inventaire nette concernée, afin de refléter les charges fiscales et les frais de transaction estimé(e)s éventuellement encouru(e)s par le Fonds et l'écart de négociation estimé pour les actifs que le Fonds achète ou vend. Dans ce cas, la Valeur d'inventaire nette par Action publiée correspond à la Valeur d'inventaire nette ayant fait l'objet d'une tarification ajustée. Cet ajustement éventuel fait habituellement augmenter la Valeur d'inventaire nette par Action en cas d'entrées de capitaux nettes significatives au sein du Fonds et la fait habituellement diminuer en cas de sorties de capitaux nettes significatives.

**2. CAPITAL SOCIAL**

**Autorisé**

Le capital social autorisé de la Société est de 70 000 USD divisés en 70 000 Actions de souscripteur d'une valeur nominale de 1 USD chacune et 5 000 000 000 actions sans valeur nominale désignées comme actions non classifiées. Les actions non classifiées peuvent être émises en tant qu'actions participantes remboursables.

Afin d'apporter le capital minimum de constitution requis par la loi irlandaise, le Gestionnaire Financier a souscrit 69 993 Actions de souscripteur en espèces, à leur valeur nominale et entièrement libérées, et sept autres Actions de souscripteur ont été émises, entièrement libérées en espèces à leur valeur nominale à des nommées. Après l'émission des Actions participantes, le Gestionnaire Financier a racheté ses 69 993 actions à leur valeur nominale et aucune autre Action de souscripteur ne sera émise.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

### 2. CAPITAL SOCIAL (suite)

#### Nombre d'actions émises et entièrement libérées

##### LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

|                                | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2023 |
|--------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions C/A (USD)     | 780 909                                                   | 940               | —                      | (82 413)             | 699 436                                   |
| Classe d'Actions C/D (USD)     | 463 361                                                   | —                 | 2 831                  | (43 669)             | 422 523                                   |
| Classe d'Actions CT/A (USD)    | 4 267                                                     | 4 933             | —                      | (2 135)              | 7 065                                     |
| Classe d'Actions CT/DG (USD)   | 1 018                                                     | —                 | 19                     | —                    | 1 037                                     |
| Classe d'Actions CT/DM (USD)   | 10 130                                                    | 6 557             | —                      | (10 130)             | 6 557                                     |
| Classe d'Actions F/A (USD)     | 82 155                                                    | —                 | —                      | —                    | 82 155                                    |
| Classe d'Actions F/DM (USD)    | 53 123                                                    | —                 | 893                    | —                    | 54 016                                    |
| Classe d'Actions H-I/A (EUR)   | 375 733                                                   | 5 934             | —                      | (122 658)            | 259 009                                   |
| Classe d'Actions H-I/D (EUR)   | 44 975                                                    | 45 416            | —                      | (2 250)              | 88 141                                    |
| Classe d'Actions H-I/D (GBP)   | 152 589                                                   | —                 | —                      | (9 095)              | 143 494                                   |
| Classe d'Actions H-N/A (CHF)   | 750                                                       | —                 | —                      | —                    | 750                                       |
| Classe d'Actions H-N/A (EUR)   | 214 822                                                   | —                 | —                      | —                    | 214 822                                   |
| Classe d'Actions H-N/D (EUR)   | 2 450                                                     | —                 | —                      | (2 450)              | —                                         |
| Classe d'Actions H-N1/A (EUR)  | 273 009                                                   | 130 138           | —                      | (94 353)             | 308 794                                   |
| Classe d'Actions H-R/A (EUR)   | 2 794 167                                                 | 73 819            | —                      | (631 983)            | 2 236 003                                 |
| Classe d'Actions H-R/A (SGD)   | 2 554 156                                                 | 298 218           | —                      | (204 321)            | 2 648 053                                 |
| Classe d'Actions H-R/D (SGD)   | 549 825                                                   | 1 166             | 1 997                  | (23 837)             | 529 151                                   |
| Classe d'Actions H-RE/DM (AUD) | 99 258                                                    | —                 | —                      | (2 153)              | 97 105                                    |
| Classe d'Actions H-S/D (EUR)   | 76 550                                                    | —                 | —                      | (2 566)              | 73 984                                    |
| Classe d'Actions I/A (EUR)     | 88 171                                                    | 3 072             | —                      | (17 780)             | 73 463                                    |
| Classe d'Actions I/A (USD)     | 6 759 896                                                 | 599 800           | —                      | (2 442 810)          | 4 916 886                                 |
| Classe d'Actions I/D (GBP)     | 9 990                                                     | —                 | —                      | —                    | 9 990                                     |
| Classe d'Actions I/D (USD)     | 3 081 784                                                 | 1 031 037         | 21 266                 | (722 953)            | 3 411 134                                 |
| Classe d'Actions I/DG (USD)    | 1 018                                                     | —                 | 19                     | —                    | 1 037                                     |
| Classe d'Actions N/A (EUR)     | —                                                         | 464 688           | —                      | (8 401)              | 456 287                                   |
| Classe d'Actions N/A (USD)     | 4 882                                                     | —                 | —                      | —                    | 4 882                                     |
| Classe d'Actions N/DM (USD)    | 47 510                                                    | —                 | —                      | —                    | 47 510                                    |
| Classe d'Actions N1/A (USD)    | 848 598                                                   | 53 539            | —                      | (154 005)            | 748 132                                   |
| Classe d'Actions N1/D (USD)    | 497 279                                                   | 71 261            | 386                    | —                    | 568 926                                   |
| Classe d'Actions R/A (EUR)     | 564 229                                                   | 632 673           | —                      | (101 190)            | 1 095 712                                 |
| Classe d'Actions R/A (SGD)     | 71 101                                                    | 339               | —                      | (1 037)              | 70 403                                    |
| Classe d'Actions R/A (USD)     | 5 639 617                                                 | 156 802           | —                      | (612 491)            | 5 183 928                                 |
| Classe d'Actions R/D (EUR)     | 44 529                                                    | —                 | 671                    | —                    | 45 200                                    |
| Classe d'Actions R/D (GBP)     | 110 742                                                   | 2 553             | —                      | (769)                | 112 526                                   |
| Classe d'Actions R/D (SGD)     | 239 943                                                   | 1 444             | 226                    | (7 639)              | 233 974                                   |
| Classe d'Actions R/D (USD)     | 3 611 239                                                 | 40 639            | 16 000                 | (328 963)            | 3 338 915                                 |
| Classe d'Actions R/DG (USD)    | 1 018                                                     | 935               | 20                     | (10)                 | 1 963                                     |
| Classe d'Actions R/DM (USD)    | 2 077 008                                                 | 77 590            | 941                    | (146 555)            | 2 008 984                                 |
| Classe d'Actions RE/A (EUR)    | 269 448                                                   | 450               | —                      | (43 678)             | 226 220                                   |
| Classe d'Actions RE/A (USD)    | 6 044 123                                                 | 192 740           | —                      | (556 691)            | 5 680 172                                 |
| Classe d'Actions RE/D (USD)    | 97                                                        | —                 | —                      | —                    | 97                                        |
| Classe d'Actions RE/DM (USD)   | 106                                                       | —                 | —                      | —                    | 106                                       |
| Classe d'Actions S/A (USD)     | 3 886 871                                                 | 97 702            | —                      | (59 209)             | 3 925 364                                 |
| Classe d'Actions S/D (GBP)     | 678                                                       | —                 | —                      | —                    | 678                                       |
| Classe d'Actions S/D (USD)     | 38 300                                                    | —                 | —                      | —                    | 38 300                                    |

##### LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

|                              | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2023 |
|------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions H-I/A (EUR) | 80 106                                                    | —                 | —                      | —                    | 80 106                                    |
| Classe d'Actions H-N/D (EUR) | 422                                                       | —                 | 4                      | —                    | 426                                       |
| Classe d'Actions H-R/A (EUR) | 1 161                                                     | —                 | —                      | —                    | 1 161                                     |
| Classe d'Actions I/A (EUR)   | 68 640                                                    | —                 | —                      | (60 790)             | 7 850                                     |
| Classe d'Actions I/A (USD)   | 141                                                       | —                 | —                      | —                    | 141                                       |
| Classe d'Actions I/D (USD)   | 294 030                                                   | —                 | 8 093                  | (61 079)             | 241 044                                   |
| Classe d'Actions N/DM (USD)  | 434                                                       | —                 | —                      | —                    | 434                                       |
| Classe d'Actions R/A (EUR)   | 64 306                                                    | 543               | —                      | (8 557)              | 56 292                                    |
| Classe d'Actions R/A (USD)   | 4 280                                                     | —                 | —                      | —                    | 4 280                                     |
| Classe d'Actions R/D (USD)   | 255 873                                                   | 3 376             | 561                    | (20 623)             | 239 187                                   |
| Classe d'Actions R/DM (USD)  | 211 048                                                   | —                 | —                      | (4 396)              | 206 652                                   |
| Classe d'Actions S/A (USD)   | 5 500                                                     | —                 | —                      | (2 400)              | 3 100                                     |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

### 2. CAPITAL SOCIAL (suite)

#### Nombre d'Actions émises et entièrement libérées (suite)

##### LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

|                              | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2023 |
|------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions C/A (USD)   | 12 930                                                    | —                 | —                      | —                    | 12 930                                    |
| Classe d'Actions H-I/A (SGD) | 152 582                                                   | 34 954            | —                      | (38 035)             | 149 501                                   |
| Classe d'Actions H-N/D (EUR) | 388                                                       | —                 | 2                      | —                    | 390                                       |
| Classe d'Actions H-R/A (EUR) | 43 286                                                    | 142               | —                      | —                    | 43 428                                    |
| Classe d'Actions H-S/D (GBP) | 2 475 360                                                 | —                 | —                      | (2 475 360)          | —                                         |
| Classe d'Actions I/A (USD)   | 2 228 246                                                 | 575 775           | —                      | (408 504)            | 2 395 517                                 |
| Classe d'Actions I/D (USD)   | 69 367                                                    | —                 | 588                    | (11 001)             | 58 954                                    |
| Classe d'Actions N/A (EUR)   | 6                                                         | —                 | —                      | —                    | 6                                         |
| Classe d'Actions N1/A (USD)  | 14 888                                                    | 161               | —                      | (41)                 | 15 008                                    |
| Classe d'Actions R/A (EUR)   | 193 934                                                   | 5 249             | —                      | (13 562)             | 185 621                                   |
| Classe d'Actions R/A (USD)   | 28 898                                                    | 284               | —                      | (162)                | 29 020                                    |
| Classe d'Actions R/D (GBP)   | 13 382                                                    | 402               | —                      | —                    | 13 784                                    |
| Classe d'Actions R/D (USD)   | 163 571                                                   | 3 437             | 574                    | (29 654)             | 137 928                                   |

##### LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

|                              | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2023 |
|------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions H-I/A (EUR) | 49 122                                                    | —                 | —                      | (7 724)              | 41 398                                    |
| Classe d'Actions H-Q/A (EUR) | 2 257 517                                                 | —                 | —                      | —                    | 2 257 517                                 |
| Classe d'Actions I/A (USD)   | 287                                                       | —                 | —                      | —                    | 287                                       |
| Classe d'Actions R/A (USD)   | 287                                                       | —                 | —                      | —                    | 287                                       |

##### LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

|                              | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2023 |
|------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions H-I/A (CHF) | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions H-N/A (CHF) | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions H-R/A (CHF) | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions I/A (EUR)   | 10                                                        | —                 | —                      | —                    | 10                                        |
| Classe d'Actions N/A (EUR)   | 10                                                        | —                 | —                      | —                    | 10                                        |
| Classe d'Actions Q/A (EUR)   | 1 762 817                                                 | —                 | —                      | —                    | 1 762 817                                 |
| Classe d'Actions R/A (EUR)   | 205                                                       | —                 | —                      | —                    | 205                                       |
| Classe d'Actions RE/A (EUR)  | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions S/A (EUR)   | 10                                                        | —                 | —                      | —                    | 10                                        |
| Classe d'Actions S2/A (EUR)  | 1 266 362                                                 | 321 049           | —                      | (159 974)            | 1 427 437                                 |

##### LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

|                              | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2023 |
|------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions H-I/A (USD) | —                                                         | 70 000            | —                      | —                    | 70 000                                    |
| Classe d'Actions I/A (EUR)   | 33 488                                                    | 7 962             | —                      | (2 560)              | 38 890                                    |
| Classe d'Actions I/D (EUR)   | —                                                         | 129 500           | —                      | —                    | 129 500                                   |
| Classe d'Actions N/A (EUR)   | 10                                                        | —                 | —                      | —                    | 10                                        |
| Classe d'Actions Q/A (EUR)   | 4 058 366                                                 | —                 | —                      | (1 850 432)          | 2 207 934                                 |
| Classe d'Actions R/A (EUR)   | 3 418                                                     | 231               | —                      | —                    | 3 649                                     |
| Classe d'Actions RE/A (EUR)  | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions S/A (EUR)   | 505 145                                                   | 617 665           | —                      | (8 304)              | 1 114 506                                 |
| Classe d'Actions S1/A (EUR)  | —                                                         | 1 479 620         | —                      | —                    | 1 479 620                                 |
| Classe d'Actions S2/A (EUR)  | 7 200 534                                                 | 700 779           | —                      | (688 349)            | 7 212 964                                 |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

### 2. CAPITAL SOCIAL (suite)

#### Nombre d'Actions émises et entièrement libérées (suite)

##### LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

|                             | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2023 |
|-----------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions I/A (EUR)  | 300                                                       | 438 937           | —                      | —                    | 439 237                                   |
| Classe d'Actions N/A (EUR)  | 14 900                                                    | —                 | —                      | —                    | 14 900                                    |
| Classe d'Actions Q/A (EUR)  | 10 754 005                                                | 5 747 052         | —                      | (81 720)             | 16 419 337                                |
| Classe d'Actions R/A (EUR)  | 1 425                                                     | 1 135             | —                      | —                    | 2 560                                     |
| Classe d'Actions RE/A (EUR) | 299                                                       | —                 | —                      | —                    | 299                                       |
| Classe d'Actions S/D (EUR)  | 23 170 387                                                | 5 222 935         | —                      | (2 326 179)          | 26 067 143                                |
| Classe d'Actions S2/A (EUR) | 625 458                                                   | 812 916           | —                      | (21 555)             | 1 416 819                                 |
| Classe d'Actions S3/A (EUR) | 10 751 259                                                | 7 835 446         | —                      | (3 309 051)          | 15 277 654                                |
| Classe d'Actions S3/D (EUR) | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |

##### LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

|                                | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2022 |
|--------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions C/A (USD)     | 820 190                                                   | —                 | —                      | (24 537)             | 795 653                                   |
| Classe d'Actions C/D (USD)     | 607 577                                                   | —                 | 1 983                  | (94 006)             | 515 554                                   |
| Classe d'Actions CT/A (USD)    | 458 775                                                   | —                 | —                      | (411 530)            | 47 245                                    |
| Classe d'Actions CT/DG (USD)   | —                                                         | 1 000             | 2                      | —                    | 1 002                                     |
| Classe d'Actions CT/DM (USD)   | 449 260                                                   | —                 | —                      | (380 190)            | 69 070                                    |
| Classe d'Actions F/A (USD)     | 179 248                                                   | —                 | —                      | (78 160)             | 101 088                                   |
| Classe d'Actions F/DM (USD)    | 51 709                                                    | —                 | 657                    | —                    | 52 366                                    |
| Classe d'Actions H-I/A (EUR)   | 434 957                                                   | 1 951             | —                      | (71 628)             | 365 280                                   |
| Classe d'Actions H-I/D (EUR)   | 23 330                                                    | —                 | —                      | —                    | 23 330                                    |
| Classe d'Actions H-I/D (GBP)   | 154 667                                                   | —                 | —                      | —                    | 154 667                                   |
| Classe d'Actions H-N/A (CHF)   | 750                                                       | —                 | —                      | —                    | 750                                       |
| Classe d'Actions H-N/A (EUR)   | 213 560                                                   | 1 276             | —                      | —                    | 214 836                                   |
| Classe d'Actions H-N/D (EUR)   | 3 400                                                     | —                 | 23                     | (23)                 | 3 400                                     |
| Classe d'Actions H-N1/A (EUR)  | 149 747                                                   | —                 | —                      | —                    | 149 747                                   |
| Classe d'Actions H-R/A (EUR)   | 5 363 933                                                 | 12 794            | —                      | (1 764 774)          | 3 611 953                                 |
| Classe d'Actions H-R/A (SGD)   | 3 392 053                                                 | 226 828           | —                      | (510 103)            | 3 108 778                                 |
| Classe d'Actions H-R/D (SGD)   | 584 152                                                   | 963               | 1 334                  | (43 240)             | 543 209                                   |
| Classe d'Actions H-RE/DM (AUD) | 119 826                                                   | 399               | —                      | (15 431)             | 104 794                                   |
| Classe d'Actions H-S/D (EUR)   | 76 550                                                    | —                 | —                      | —                    | 76 550                                    |
| Classe d'Actions I/A (EUR)     | 94 286                                                    | 316               | —                      | (21 222)             | 73 380                                    |
| Classe d'Actions I/A (USD)     | 6 411 557                                                 | 1 364 953         | —                      | (2 734 013)          | 5 042 497                                 |
| Classe d'Actions I/D (GBP)     | 9 990                                                     | —                 | —                      | —                    | 9 990                                     |
| Classe d'Actions I/D (USD)     | 3 934 924                                                 | 28 086            | 16 545                 | (500 399)            | 3 479 156                                 |
| Classe d'Actions I/DG (USD)    | —                                                         | 1 000             | 2                      | —                    | 1 002                                     |
| Classe d'Actions N/A (USD)     | 4 882                                                     | —                 | —                      | —                    | 4 882                                     |
| Classe d'Actions N/DM (USD)    | 101 081                                                   | —                 | —                      | —                    | 101 081                                   |
| Classe d'Actions N1/A (USD)    | 890 495                                                   | —                 | —                      | (134 727)            | 755 768                                   |
| Classe d'Actions N1/D (USD)    | 413 758                                                   | 82 873            | 288                    | —                    | 496 919                                   |
| Classe d'Actions R/A (EUR)     | 1 252 653                                                 | 87 347            | —                      | (769 493)            | 570 507                                   |
| Classe d'Actions R/A (SGD)     | 73 425                                                    | 489               | —                      | (1 140)              | 72 774                                    |
| Classe d'Actions R/A (USD)     | 7 069 042                                                 | 703 178           | —                      | (1 809 125)          | 5 963 095                                 |
| Classe d'Actions R/D (EUR)     | —                                                         | 43 750            | 193                    | —                    | 43 943                                    |
| Classe d'Actions R/D (GBP)     | 112 981                                                   | 1 532             | —                      | (752)                | 113 761                                   |
| Classe d'Actions R/D (SGD)     | 261 747                                                   | 5 533             | 202                    | (20 311)             | 247 171                                   |
| Classe d'Actions R/D (USD)     | 4 227 000                                                 | 250 687           | 12 200                 | (812 549)            | 3 677 338                                 |
| Classe d'Actions R/DG (USD)    | —                                                         | 1 000             | 1                      | —                    | 1 001                                     |
| Classe d'Actions R/DM (USD)    | 2 432 677                                                 | 279 832           | 656                    | (495 221)            | 2 217 944                                 |
| Classe d'Actions RE/A (EUR)    | 340 197                                                   | 681               | —                      | (45 377)             | 295 501                                   |
| Classe d'Actions RE/A (USD)    | 6 482 821                                                 | 398 297           | —                      | (639 831)            | 6 241 287                                 |
| Classe d'Actions RE/D (USD)    | 97                                                        | —                 | —                      | —                    | 97                                        |
| Classe d'Actions RE/DM (USD)   | 106                                                       | —                 | —                      | —                    | 106                                       |
| Classe d'Actions S/A (USD)     | 3 198 512                                                 | 853 077           | —                      | (34 845)             | 4 016 744                                 |
| Classe d'Actions S/D (GBP)     | 3 327                                                     | —                 | —                      | (1 000)              | 2 327                                     |
| Classe d'Actions S/D (USD)     | 1 199 159                                                 | —                 | —                      | —                    | 1 199 159                                 |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

### 2. CAPITAL SOCIAL (suite)

#### Nombre d'Actions émises et entièrement libérées (suite)

##### LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

|                              | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2022 |
|------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions CT/DM (USD) | 168 539                                                   | —                 | —                      | (168 539)            | —                                         |
| Classe d'Actions H-I/A (EUR) | 131 106                                                   | —                 | —                      | (51 000)             | 80 106                                    |
| Classe d'Actions H-N/D (EUR) | 414                                                       | —                 | 3                      | —                    | 417                                       |
| Classe d'Actions H-R/A (EUR) | —                                                         | 1 161             | —                      | —                    | 1 161                                     |
| Classe d'Actions I/A (EUR)   | 165 384                                                   | —                 | —                      | —                    | 165 384                                   |
| Classe d'Actions I/A (USD)   | 141                                                       | —                 | —                      | —                    | 141                                       |
| Classe d'Actions I/D (USD)   | 327 785                                                   | —                 | 40 686                 | (82 150)             | 286 321                                   |
| Classe d'Actions N/DM (USD)  | 434                                                       | —                 | —                      | —                    | 434                                       |
| Classe d'Actions R/A (EUR)   | 82 202                                                    | 991               | —                      | (13 804)             | 69 389                                    |
| Classe d'Actions R/A (USD)   | 4 280                                                     | —                 | —                      | —                    | 4 280                                     |
| Classe d'Actions R/D (SGD)   | 550                                                       | —                 | 77                     | —                    | 627                                       |
| Classe d'Actions R/D (USD)   | 311 256                                                   | 5 259             | 2 722                  | (58 651)             | 260 586                                   |
| Classe d'Actions R/DM (USD)  | 129 193                                                   | 163 637           | —                      | (38 815)             | 254 015                                   |
| Classe d'Actions S/A (USD)   | 5 500                                                     | —                 | —                      | —                    | 5 500                                     |

##### LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

|                              | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2022 |
|------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions C/A (USD)   | 11 926                                                    | —                 | —                      | —                    | 11 926                                    |
| Classe d'Actions C/D (USD)   | 339                                                       | —                 | 56                     | —                    | 395                                       |
| Classe d'Actions H-I/A (SGD) | 134 996                                                   | 23 723            | —                      | (8 255)              | 150 464                                   |
| Classe d'Actions H-N/D (EUR) | 359                                                       | —                 | 28                     | —                    | 387                                       |
| Classe d'Actions H-R/A (EUR) | 65 155                                                    | 1 150             | —                      | (7 326)              | 58 979                                    |
| Classe d'Actions H-S/A (EUR) | 170 573                                                   | —                 | —                      | (170 573)            | —                                         |
| Classe d'Actions H-S/A (SEK) | 2 448                                                     | —                 | —                      | (2 448)              | —                                         |
| Classe d'Actions H-S/D (GBP) | 2 475 502                                                 | —                 | 18                     | (160)                | 2 475 360                                 |
| Classe d'Actions I/A (USD)   | 1 901 811                                                 | 567 594           | —                      | (52 279)             | 2 417 126                                 |
| Classe d'Actions I/D (USD)   | 521 713                                                   | 6 745             | 59 234                 | (517 773)            | 69 919                                    |
| Classe d'Actions N/A (EUR)   | 308                                                       | —                 | —                      | (302)                | 6                                         |
| Classe d'Actions N1/A (USD)  | 12 754                                                    | 1 438             | —                      | (1 081)              | 13 111                                    |
| Classe d'Actions R/A (EUR)   | 189 914                                                   | 30 374            | —                      | (21 799)             | 198 489                                   |
| Classe d'Actions R/A (USD)   | 28 788                                                    | —                 | —                      | —                    | 28 788                                    |
| Classe d'Actions R/D (GBP)   | 13 204                                                    | 1 109             | —                      | (1 492)              | 12 821                                    |
| Classe d'Actions R/D (USD)   | 171 550                                                   | 17 195            | 5 781                  | (31 610)             | 162 916                                   |
| Classe d'Actions RE/A (USD)  | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |

##### LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

|                              | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2022 |
|------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions H-I/A (EUR) | —                                                         | 230 335           | —                      | (32 234)             | 198 101                                   |
| Classe d'Actions H-Q/A (EUR) | 2 500 000                                                 | —                 | —                      | —                    | 2 500 000                                 |
| Classe d'Actions I/A (USD)   | 287                                                       | —                 | —                      | —                    | 287                                       |
| Classe d'Actions R/A (USD)   | 287                                                       | —                 | —                      | —                    | 287                                       |

##### LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

|                              | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2022 |
|------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions H-I/A (CHF) | —                                                         | 300               | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions H-N/A (CHF) | —                                                         | 300               | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions H-R/A (CHF) | —                                                         | 300               | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions I/A (EUR)   | 10                                                        | —                 | —                      | —                    | 10                                        |
| Classe d'Actions N/A (EUR)   | 10                                                        | —                 | —                      | —                    | 10                                        |
| Classe d'Actions Q/A (EUR)   | 1 762 817                                                 | —                 | —                      | —                    | 1 762 817                                 |
| Classe d'Actions R/A (EUR)   | 10                                                        | —                 | —                      | —                    | 10                                        |
| Classe d'Actions RE/A (EUR)  | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions S/A (EUR)   | 10                                                        | —                 | —                      | —                    | 10                                        |
| Classe d'Actions S2/A (EUR)  | 1 452 152                                                 | 168 040           | —                      | (317 472)            | 1 302 720                                 |

Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

2. CAPITAL SOCIAL (suite)

Nombre d'Actions émises et entièrement libérées (suite)

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

|                             | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2022 |
|-----------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions I/A (EUR)  | 50 688                                                    | 30 218            | —                      | (22 545)             | 58 361                                    |
| Classe d'Actions N/A (EUR)  | 10                                                        | —                 | —                      | —                    | 10                                        |
| Classe d'Actions Q/A (EUR)  | 7 000 000                                                 | —                 | —                      | —                    | 7 000 000                                 |
| Classe d'Actions R/A (EUR)  | 10                                                        | —                 | —                      | —                    | 10                                        |
| Classe d'Actions RE/A (EUR) | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions S/A (EUR)  | 10                                                        | —                 | —                      | —                    | 10                                        |
| Classe d'Actions S2/A (EUR) | 5 127 128                                                 | 248 384           | —                      | (1 000 544)          | 4 374 968                                 |

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

|                             | Actions en circulation<br>au 1 <sup>er</sup> janvier 2022 | Actions<br>émises | Actions<br>réinvesties | Actions<br>rachetées | Actions en circulation<br>au 30 juin 2022 |
|-----------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-------------------------------------------|
| Classe d'Actions I/A (EUR)  | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions N/A (EUR)  | 14 900                                                    | —                 | —                      | —                    | 14 900                                    |
| Classe d'Actions Q/A (EUR)  | 6 636 246                                                 | 4 023 217         | —                      | (2 391 605)          | 8 267 858                                 |
| Classe d'Actions R/A (EUR)  | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions RE/A (EUR) | 299                                                       | —                 | —                      | —                    | 299                                       |
| Classe d'Actions S/D (EUR)  | 11 378 962                                                | 9 991 940         | —                      | (1 938 257)          | 19 432 645                                |
| Classe d'Actions S2/A (EUR) | 300                                                       | —                 | —                      | —                    | 300                                       |
| Classe d'Actions S3/A (EUR) | —                                                         | 11 300 712        | —                      | (510 504)            | 10 790 208                                |
| Classe d'Actions S3/D (EUR) | —                                                         | 300               | —                      | —                    | 300                                       |

Les sept Actions de souscripteur ont été totalement libérées à la valeur de 7 USD et, comme elles ne font pas partie intégrante des Actions participantes remboursables de la Société, elles ne sont pas incluses dans la Valeur d'inventaire nette de la Société. Elles ne sont donc communiquées dans les états financiers que par le biais de la présente note.

Droits liés aux actions

Les détenteurs des Actions de souscripteur ont droit à une voix par détenteur pour les votes à main levée et à une voix par Action de souscripteur pour les scrutins. Les détenteurs d'Actions de souscripteur ne peuvent prétendre à aucun dividende et ont droit, en cas de liquidation ou de dissolution de la Société, au remboursement du capital, dans la mesure où les fonds sont suffisants. Les détenteurs d'Actions participantes remboursables ont droit à un vote par détenteur lors d'un vote à main levée, et lors d'un scrutin, à un vote par Action participante remboursable. Les détenteurs d'Actions participantes remboursables peuvent prétendre aux dividendes déclarés par les Administrateurs. En cas de liquidation ou de dissolution de la Société, ils jouissent des droits définis dans le prospectus de la Société.

Ni les Actions de souscripteur ni les Actions participantes remboursables ne sont assorties de droits de préemption.

Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

3. COMMISSIONS

La Société verse à la Société de gestion une commission fixe mensuelle aux taux indiqués ci-dessous. La Société de gestion a reçu 5 174 106 USD au cours du semestre clos le 30 juin 2023 (30 juin 2022 : 5 373 041 USD) dont 1 152 284 USD étaient en souffrance au 30 juin 2023 (30 juin 2022 : 853 427 USD).

| Classe d'Actions | Loomis Sayles Multisector Income Fund | Loomis Sayles High Income Fund | Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund | Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund | Loomis Sayles Euro High Yield Fund | Loomis Sayles Euro Credit Fund | Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|--------------------------------------------|
| Classe C         | 1,95 %                                | S/O                            | 1,95 %                                       | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe CT        | 1,35 %                                | 1,60 %                         | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe CW        | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe F         | 1,05 %                                | S/O                            | 1,05 %                                       | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe H-CW      | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe H-I       | 0,75 %                                | 0,75 %                         | 0,75 %                                       | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe H-N       | 0,50 %                                | 0,75 %                         | 0,75 %                                       | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe H-N1      | 0,75 %                                | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe H-R       | 1,25 %                                | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe H-RE      | 1,60 %                                | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe H-S       | 0,75 %                                | S/O                            | 0,75 %                                       | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe H-Q       | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | 0,00 %                                     | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe I         | 0,75 %                                | 0,75 %                         | 0,75 %                                       | 0,75 %                                     | 0,75 %                             | 0,75 %                         | 0,75 %                                     |
| Classe J         | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe N         | 0,75 %                                | 0,75 %                         | 0,75 %                                       | S/O                                        | 0,75 %                             | 0,75 %                         | 0,75 %                                     |
| Classe N1        | 0,75 %                                | S/O                            | 0,75 %                                       | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe Q         | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | 0,00 %                             | 0,00 %                         | 0,00 %                                     |
| Classe R         | 1,25 %                                | 1,65 %                         | 1,25 %                                       | 1,35 %                                     | 1,25 %                             | 1,25 %                         | 1,25 %                                     |
| Classe RE        | 1,60 %                                | S/O                            | 1,60 %                                       | S/O                                        | 1,60 %                             | 1,60 %                         | 1,60 %                                     |
| Classe S         | 0,75 %                                | 0,75 %                         | S/O                                          | S/O                                        | 0,75 %                             | 0,75 %                         | 0,75 %                                     |
| Classe S2        | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | 0,75 %                             | 0,75 %                         | 0,75 %                                     |

Les commissions de distribution pour la Classe CT sont incluses dans les commissions de gestion financière et se sont élevées à 233 USD et 0 USD pour les Fonds Loomis Sayles Multisector Income Fund et Loomis Sayles High Income Fund, respectivement, pour le semestre clos le 30 juin 2023 (30 juin 2022 : 32 281 USD et 3 367 USD respectivement).

La Société de gestion rembourse les Fonds de toutes les dépenses supérieures au pourcentage de la Valeur d'inventaire nette respectif de chaque Fonds, comme suit\* :

| Classe d'Actions | Loomis Sayles Multisector Income Fund | Loomis Sayles High Income Fund | Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund | Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund | Loomis Sayles Euro High Yield Fund | Loomis Sayles Euro Credit Fund | Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|--------------------------------------------|
| Classe C         | 2,25 %                                | S/O                            | 2,25 %                                       | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe CT        | 2,50 %                                | 2,95 %                         | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe CW        | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe F         | 1,25 %                                | S/O                            | 1,25 %                                       | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe H-CW      | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe H-I       | 0,90 %                                | 0,90 %                         | 0,90 %                                       | 1,00 %                                     | 0,65 %                             | 0,50 %                         | 0,50 %                                     |
| Classe H-N       | 0,90 %                                | 0,90 %                         | 0,90 %                                       | S/O                                        | 0,75 %                             | 0,60 %                         | 0,60 %                                     |
| Classe H-N1      | 1,80 %                                | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe H-R       | 1,50 %                                | 1,95 %                         | 1,50 %                                       | S/O                                        | 1,30 %                             | 1,00 %                         | 1,00 %                                     |
| Classe H-RE      | 1,80 %                                | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | 1,50 %                             | 1,20 %                         | 1,20 %                                     |
| Classe H-S       | 0,60 %                                | S/O                            | 0,55 %                                       | S/O                                        | 0,50 %                             | 0,40 %                         | 0,40 %                                     |
| Classe H-S2      | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | 0,45 %                             | 0,35 %                         | 0,35 %                                     |
| Classe H-Q       | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | 0,25 %                                     | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe I         | 0,90 %                                | 0,90 %                         | 0,90 %                                       | 1,00 %                                     | 0,65 %                             | 0,50 %                         | 0,50 %                                     |
| Classe J         | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe N         | 0,90 %                                | 0,90 %                         | 0,90 %                                       | S/O                                        | 0,75 %                             | 0,60 %                         | 0,60 %                                     |
| Classe N1        | 0,80 %                                | S/O                            | 0,80 %                                       | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | S/O                                        |
| Classe Q         | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | 0,25 %                             | 0,25 %                         | 0,25 %                                     |
| Classe R         | 1,50 %                                | 1,95 %                         | 1,50 %                                       | 1,75 %                                     | 1,30 %                             | 1,00 %                         | 1,00 %                                     |
| Classe RE        | 1,80 %                                | S/O                            | 1,80 %                                       | S/O                                        | 1,50 %                             | 1,20 %                         | 1,20 %                                     |
| Classe S         | 0,60 %                                | 0,75 %                         | S/O                                          | S/O                                        | 0,50 %                             | 0,40 %                         | 0,40 %                                     |
| Classe S2        | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | 0,45 %                             | 0,35 %                         | 0,35 %                                     |
| Classe S3        | S/O                                   | S/O                            | S/O                                          | S/O                                        | S/O                                | S/O                            | 0,25 %                                     |

\* Les classes d'actions qui ne présentent aucun plafond de frais sont soit inactives, soit non financées.



**Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)**

**3. COMMISSIONS (suite)**

Des montants de 128 990 USD, 48 262 USD, 28 143 USD, 0 USD, 46 170 EUR, 271 392 EUR et 949 849 EUR ont été remboursés aux Fonds Loomis Sayles Multisector Income Fund, Loomis Sayles High Income Fund, Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund, Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund, Loomis Sayles Euro High Yield Fund, Loomis Sayles Euro Credit Fund et Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund, respectivement, pour le semestre clos le 30 juin 2023 (30 juin 2022 : 156 800 USD, 129 254 USD, 189 735 USD, 259 957 USD, 76 216 EUR, 148 473 EUR et 543 523 EUR respectivement).

Jusqu'au 31 décembre 2021, la Société verse à l'Agent administratif une commission mensuelle en arriérés de 1/12 des pourcentages suivants de la Valeur d'inventaire nette de chaque Fonds à chaque point de valorisation : 0,03 % sur les 75 premiers millions de dollars, 0,02 % sur les 75 millions de dollars suivants et 0,01 % sur le solde excédant 150 millions de dollars (ou équivalent), TVA incluse (le cas échéant). Les frais administratifs s'accumulent chaque jour et sont payables tous les mois en arriérés.

Jusqu'au 31 décembre 2021, la Société verse au Dépositaire une commission mensuelle comprise entre 0,005 % et 0,45 % de la Valeur d'inventaire nette de chaque Fonds telle qu'elle apparaît au moment d'évaluation pour les frais de conservation, ainsi que des frais d'opération au taux habituel du marché. La Société verse à terme échu une commission mensuelle en arriérés d'1/12 de 0,012 % de la Valeur d'inventaire nette de chaque Fonds pour les frais de fiducie.

À compter du 1er janvier 2022, la Société verse à l'Agent administratif et au Dépositaire une commission mensuelle s'élevant à 2 points de base de la Valeur d'inventaire nette de chaque Fonds à chaque point de valorisation.

Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited a reçu une commission de gestion de 79 413 USD pour le semestre clos le 30 juin 2023 (30 juin 2022 : 536 025 USD), dont 0 USD (30 juin 2022 : 186 133 USD) étaient toujours en cours à la clôture de la période.

Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited a reçu une commission de conservation et de transaction de 65 424 USD pour le semestre clos le 30 juin 2023 (30 juin 2022 : 326 833 USD), dont 278 424 USD (30 juin 2022 : 108 367 USD) étaient toujours en cours à la clôture de la période.

Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited a reçu une commission d'administration de 24 171 USD pour le semestre clos le 30 juin 2023 (30 juin 2022 : 91 085 USD), dont 0 USD (30 juin 2022 : 21 737 USD) étaient toujours en cours à la clôture de la période.

Les coûts de transaction se sont élevés à 950 USD, 0 USD, 833 USD, 21 476 USD, 0 EUR, 0 EUR et 0 EUR (30 juin 2022 : 2 904 USD, 6 USD, 0 USD, 5 378 USD, 0 EUR, 0 EUR et 0 EUR) pour les Loomis Sayles Multisector Income Fund, Loomis Sayles High Income Fund, Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund, Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund, Loomis Sayles Euro High Yield Fund, Loomis Sayles Euro Credit Fund et Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund, respectivement, pour le semestre clos le 30 juin 2023.

Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

4. PUBLICATION D'INFORMATIONS SUR LES TIERS APPARENTÉS

Les tiers sont considérés comme « apparentés » si l'une des parties peut contrôler l'autre partie ou exercer une influence significative sur cette autre partie dans le cadre de ses décisions financières ou opérationnelles.

Les Administrateurs de la Société et Natixis Investment Managers S.A., Société de gestion et Distributeur de la Société, sont présentés en page 1. Loomis, Sayles & Company, L.P. est le Gestionnaire Financier de la Société. La Société de gestion est tenue de payer les frais et dépenses du Gestionnaire Financier à partir de ses propres commissions.

Natixis Investment Managers S.A. et Loomis, Sayles & Company, L.P. sont tous deux des filiales de Natixis Investment Managers, un groupe international de gestion d'actifs. Natixis Investment Managers, dont le siège social est situé à Paris et à Boston, est la propriété exclusive de Natixis. Natixis est une filiale de BPCE, le deuxième groupe bancaire en France.

M. Jason Trepanier est Administrateur de la Société et également cadre de Natixis Investment Managers S.A., la Société de gestion et le Promoteur et Distributeur de la Société. Mme Lynda Wood (née Schweitzer) est Administratrice de la Société et également cadre de Loomis, Sayles & Company, L.P., le Gestionnaire Financier. M. Christopher Yiannakou est Administrateur de la Société (nommé le 8 juin 2022) et également cadre de Loomis Sayles Investments Limited, UK (une filiale à 100 % du Gestionnaire Financier).

La capacité à orienter la politique financière et opérationnelle des Fonds, et donc leur contrôle, demeure du ressort des Actionnaires lors des assemblées générales. Au 30 juin 2023, et pour comparaison au 31 décembre 2022, les entités suivantes avaient des intérêts excédant 20 % du capital social émis du Fonds.

| Actions participantes remboursables                 | 30/06/2023     |            | 31/12/2022     |            |
|-----------------------------------------------------|----------------|------------|----------------|------------|
|                                                     | Nbre d'Actions | % du Fonds | Nbre d'Actions | % du Fonds |
| <b>Loomis Sayles Multisector Income Fund</b>        |                |            |                |            |
| Allfunds Bank                                       | 8 121 876      | 20 %       | 9 107 726      | 21 %       |
| Actions participantes remboursables                 | 30/06/2023     |            | 31/12/2022     |            |
|                                                     | Nbre d'Actions | % du Fonds | Nbre d'Actions | % du Fonds |
| <b>Loomis Sayles High Income Fund</b>               |                |            |                |            |
| RBC cees Nominees Ltd                               | 241 044        | 29 %       | 294 030        | 30 %       |
| Agent taïwanais - Natixis                           | 275 030        | 33 %       | 277 374        | 28 %       |
| Actions participantes remboursables                 | 30/06/2023     |            | 31/12/2022     |            |
|                                                     | Nbre d'Actions | % du Fonds | Nbre d'Actions | % du Fonds |
| <b>Loomis Sayles Global Opportunistic Fund</b>      |                |            |                |            |
| FundSettle EOC Nominees                             | 1 628 487      | 54 %       | 2 010 250      | 37 %       |
| Agent taïwanais - Natixis                           | 651 206        | 21 %       | —              | —          |
| The Royal Literary Fund                             | —              | —          | 2 475 360      | 46 %       |
| Actions participantes remboursables                 | 30/06/2023     |            | 31/12/2022     |            |
|                                                     | Nbre d'Actions | % du Fonds | Nbre d'Actions | % du Fonds |
| <b>Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund</b>   |                |            |                |            |
| Kennedy Fin Lux s.à r.l.-Natixis Dub                | 2 257 517      | 98 %       | 2 257 517      | 98 %       |
| Actions participantes remboursables                 | 30/06/2023     |            | 31/12/2022     |            |
|                                                     | Nbre d'Actions | % du Fonds | Nbre d'Actions | % du Fonds |
| <b>Loomis Sayles Euro High Yield Fund</b>           |                |            |                |            |
| Clearstream Banking S.A.-Natixis                    | 1 143 811      | 36 %       | 1 075 712      | 35 %       |
| Kennedy Fin Lux s.à r.l.-Natixis Dub                | 1 762 817      | 55 %       | 1 762 817      | 58 %       |
| Actions participantes remboursables                 | 30/06/2023     |            | 31/12/2022     |            |
|                                                     | Nbre d'Actions | % du Fonds | Nbre d'Actions | % du Fonds |
| <b>Loomis Sayles Euro Credit Fund</b>               |                |            |                |            |
| International Fund Services & Asset Management S.A. | 5 116 672      | 42 %       | 4 974 526      | 42 %       |
| Kennedy Fin Lux s.à r.l.-Natixis Dub                | —              | —          | 4 058 366      | 34 %       |

Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

4. PUBLICATION D'INFORMATIONS SUR LES TIERS APPARENTÉS (suite)

| Actions participantes remboursables                                   | 30/06/2023     |            | 31/12/2022     |            |
|-----------------------------------------------------------------------|----------------|------------|----------------|------------|
|                                                                       | Nbre d'Actions | % du Fonds | Nbre d'Actions | % du Fonds |
| Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund<br>FundSettle EOC Nominees | 17 302 834     | 29 %       | 11 373 678     | 25 %       |

5. PERSONNES LIÉES

La Réglementation relative aux OPCVM stipule, entre autres, que toute opération effectuée avec un OPCVM par la société de gestion ou le dépositaire ; et les éventuels délégués ou sous-délégués de la société de gestion ou du dépositaire (à l'exclusion de tous dépositaires délégués d'une société extérieure au groupe désignés par un dépositaire) ; et toute société associée ou appartenant au groupe de ces (« personnes liées ») doit être négociée dans des conditions de concurrence normale. Les opérations doivent être effectuées au mieux des intérêts des Actionnaires de la Société. En outre, des opérations peuvent également être effectuées par des parties liées pour le compte de la Société, auxquelles les Administrateurs ne peuvent pas accéder directement et pour lesquelles les Administrateurs doivent se fier à l'assurance des délégués de la Société confirmant que ces parties liées effectuent lesdites opérations dans les mêmes conditions.

Les Actionnaires sont priés d'examiner la structure de gouvernance de la Société, définie de manière plus détaillée dans la section de gouvernance d'entreprise du rapport des Administrateurs inclus dans le Rapport annuel et les États financiers audités pour l'exercice clos le 31 décembre 2022, ainsi que les rôles et responsabilités des délégués de la Société soumis à la supervision globale du Conseil d'administration.

Les Actionnaires sont également priés de consulter le prospectus, qui identifie un grand nombre des opérations avec les parties liées et la nature générale des accords contractuels conclus avec les principales personnes liées (sans toutefois en faire la liste complète).

Les Actionnaires sont également priés de lire les dispositions du prospectus concernant les conflits d'intérêts.

Pour cette raison, en ce qui concerne les confirmations de la direction de la Société et de ses délégués concernés, les Administrateurs de la Société estiment que :

- (i) des dispositions (attestées par des procédures écrites) ont été mises en place pour que les obligations définies par la Réglementation relative aux OPCVM soient appliquées à toutes les transactions impliquant des personnes liées ; et
- (ii) les transactions impliquant des personnes liées conclues pendant la période ont respecté les obligations énoncées par la Réglementation relative aux OPCVM.

6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS

Estimation de la juste valeur

La Société a classé les instruments financiers évalués à la juste valeur selon des niveaux censés refléter l'importance des facteurs de calcul. Ces niveaux sont les suivants :

- (i) Niveau 1 : les investissements dont la valeur repose sur des prix cotés sur un marché actif, et qui sont par conséquent classés dans le niveau 1, incluent les actions dont la cotation est active, les bons du Trésor de l'État américain et certaines obligations américaines non souveraines. Les prix cotés pour ces instruments ne sont pas ajustés.
- (ii) Niveau 2 : les instruments financiers négociés sur des marchés non considérés comme des marchés actifs mais dont la valeur repose néanmoins sur des cotations de marché, des cotations fournies par des négociants ou des sources alternatives appuyées par des facteurs observables sont classés dans le niveau 2. Ils incluent les obligations d'entreprises de la catégorie « Investment Grade » et certaines obligations souveraines non américaines, les actions cotées et les instruments dérivés de gré à gré. Les investissements de niveau 2 incluant des positions non négociées sur des marchés actifs et/ou soumises à des restrictions de transfert, leurs évaluations peuvent être ajustées selon qu'ils sont illiquides et/ou non transférables, généralement selon les données de marché alors disponibles.
- (iii) Niveau 3 : les investissements classés dans le niveau 3 comportent des facteurs non observables significatifs, dans la mesure où ils ne se négocient pas fréquemment. Ils incluent certains titres de créance d'entreprises. Dans la mesure où le prix de ces titres n'est pas observable, les Fonds utilisent certaines techniques d'évaluation pour en estimer la juste valeur.

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

## 6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

## Estimation de la juste valeur (suite)

L'évaluation de la juste valeur est intégralement classée dans tel ou tel niveau en fonction du facteur de calcul réputé important pour évaluer la juste valeur dans son intégralité, sachant que le plus bas niveau est retenu. À ces fins, l'importance d'un facteur de calcul est mesurée au titre de l'évaluation de la juste valeur dans son intégralité. Si une évaluation de juste valeur repose sur des facteurs observables requérant un ajustement significatif en fonction de facteurs non observables, cette évaluation est classée dans le niveau 3.

Pour mesurer l'importance d'un facteur de calcul dans l'évaluation d'une juste valeur dans son intégralité, il est nécessaire de porter un jugement en fonction d'éléments spécifiques à l'actif ou au passif financier concerné.

Pour déterminer si tel ou tel facteur est « observable » ou non, les Administrateurs doivent porter des jugements significatifs. Ils ont délégué cette tâche au Gestionnaire Financier. Ce dernier, en concertation avec l'Agent administratif, considère que les facteurs observables sont les données de marché immédiatement disponibles, régulièrement communiquées ou mises à jour, fiables et vérifiables, non propriétaires et fournies par des sources indépendantes actives sur le marché concerné.

## Loomis Sayles Multisector Income Fund

Les tableaux suivants ventilent l'actif et le passif financiers des Fonds évalués à leur juste valeur selon le classement susmentionné, au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

## Au 30 juin 2023

| Actif                                           | Niveau 1          | Niveau 2           | Niveau 3      | Total              |
|-------------------------------------------------|-------------------|--------------------|---------------|--------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                   |                    |               |                    |
| Obligations                                     | –                 | 531 375 412        | –             | 531 375 412        |
| Actions                                         | 2 764 774         | –                  | –             | 2 764 774          |
| Fonds d'investissement                          | 11 658 727        | –                  | –             | 11 658 727         |
| Actions privilégiées                            | 5 598 876         | 307 390            | 70 832        | 5 977 098          |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –                 | 4 446              | –             | 4 446              |
| Contrats à terme normalisés                     | 850 141           | –                  | –             | 850 141            |
| <b>Passif</b>                                   |                   |                    |               |                    |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                   |                    |               |                    |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –                 | (180 745)          | –             | (180 745)          |
| Contrats à terme normalisés                     | (518 025)         | –                  | –             | (518 025)          |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>20 354 493</b> | <b>531 506 503</b> | <b>70 832</b> | <b>551 931 828</b> |

## Au 31 décembre 2022

| Actif                                           | Niveau 1          | Niveau 2           | Niveau 3      | Total              |
|-------------------------------------------------|-------------------|--------------------|---------------|--------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                   |                    |               |                    |
| Obligations                                     | –                 | 558 716 897        | 15 000        | 558 731 897        |
| Actions                                         | 1 683 996         | –                  | –             | 1 683 996          |
| Fonds d'investissement                          | 12 322 566        | –                  | –             | 12 322 566         |
| Actions privilégiées                            | 8 248 038         | 2 502 791          | 76 582        | 10 827 411         |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –                 | 87 783             | –             | 87 783             |
| <b>Passif</b>                                   |                   |                    |               |                    |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                   |                    |               |                    |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –                 | (78 812)           | –             | (78 812)           |
| Contrats à terme normalisés                     | (494 497)         | –                  | –             | (494 497)          |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>21 760 103</b> | <b>561 228 659</b> | <b>91 582</b> | <b>583 080 344</b> |

Les positions de niveau 3 ont été évaluées à l'aide de cotations fournies par un courtier jugées représentatives de leurs valeurs de marché respectives, sachant toutefois que chaque évaluation comporte des facteurs non observables.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

### 6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

#### Estimation de la juste valeur (suite)

#### Loomis Sayles Multisector Income Fund (suite)

Les tableaux suivants présentent les mouvements au sein du niveau 3 pour la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022 par catégorie d'instrument financier.

Au 30 juin 2023

|                                                                                                                                                                                                                                                    | Obligations   | Actions  | Actions privilégiées | Total         |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------|----------------------|---------------|
| <b>Solde à l'ouverture au 1<sup>er</sup> janvier 2023</b>                                                                                                                                                                                          | <b>15 000</b> | <b>–</b> | <b>76 582</b>        | <b>91 582</b> |
| Achats                                                                                                                                                                                                                                             | –             | –        | –                    | –             |
| Ventes                                                                                                                                                                                                                                             | –             | –        | –                    | –             |
| Décotes accumulées (primes)                                                                                                                                                                                                                        | –             | –        | –                    | –             |
| Transferts vers le niveau 3                                                                                                                                                                                                                        | –             | –        | –                    | –             |
| Transferts hors du niveau 3                                                                                                                                                                                                                        | (15 000)      | –        | –                    | (15 000)      |
| Gains et pertes constatés dans le compte de résultat                                                                                                                                                                                               | –             | –        | (5 750)              | (5 750)       |
| <b>Solde à la clôture au 30 juin 2023</b>                                                                                                                                                                                                          | <b>–</b>      | <b>–</b> | <b>70 832</b>        | <b>70 832</b> |
| Variation des gains et pertes latents sur les actifs de niveau 3 détenus en fin de période incluse dans les autres variations nettes de la juste valeur sur l'actif et le passif financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat | –             | –        | (5 750)              | (5 750)       |

Au 31 décembre 2022

|                                                                                                                                                                                                                                                    | Obligations    | Actions  | Actions privilégiées | Total          |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|----------|----------------------|----------------|
| <b>Solde à l'ouverture au 1<sup>er</sup> janvier 2022</b>                                                                                                                                                                                          | <b>316 596</b> | <b>–</b> | <b>–</b>             | <b>316 596</b> |
| Achats                                                                                                                                                                                                                                             | –              | –        | –                    | –              |
| Ventes                                                                                                                                                                                                                                             | –              | –        | –                    | –              |
| Décotes accumulées (primes)                                                                                                                                                                                                                        | 1 254          | –        | –                    | 1 254          |
| Transferts vers le niveau 3                                                                                                                                                                                                                        | –              | –        | 92 500               | 92 500         |
| Transferts hors du niveau 3                                                                                                                                                                                                                        | (298 596)      | –        | –                    | (298 596)      |
| Gains et pertes constatés dans le compte de résultat                                                                                                                                                                                               | (4 254)        | –        | (15 918)             | (20 172)       |
| <b>Solde à la clôture au 31 décembre 2022</b>                                                                                                                                                                                                      | <b>15 000</b>  | <b>–</b> | <b>76 582</b>        | <b>91 582</b>  |
| Variation des gains et pertes latents sur les actifs de niveau 3 détenus en fin d'exercice incluse dans les autres variations nettes de la juste valeur sur l'actif et le passif financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat | (4 254)        | –        | (15 918)             | (20 172)       |

#### Loomis Sayles High Income Fund

Les tableaux suivants ventilent l'actif et le passif financiers des Fonds évalués à leur juste valeur selon le classement susmentionné, au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Au 30 juin 2023

| Actif                                           | Niveau 1       | Niveau 2         | Niveau 3      | Total            |
|-------------------------------------------------|----------------|------------------|---------------|------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                |                  |               |                  |
| Obligations                                     | –              | 6 869 340        | –             | 6 869 340        |
| Actions                                         | 1 182          | –                | –             | 1 182            |
| Fonds d'investissement                          | 155 446        | –                | –             | 155 446          |
| Actions privilégiées                            | 52 333         | –                | 43 074        | 95 407           |
| <b>Passif</b>                                   |                |                  |               |                  |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                |                  |               |                  |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –              | (6 796)          | –             | (6 796)          |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>208 961</b> | <b>6 862 544</b> | <b>43 074</b> | <b>7 114 579</b> |

Les positions du niveau 3 avaient été valorisées en fonction des cotations fournies par un courtier et jugées représentatives de la valeur de marché respective de ces titres, sachant toutefois que chaque valorisation comporte des facteurs non observables.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

### 6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

#### Estimation de la juste valeur (suite)

#### Loomis Sayles High Income Fund (suite)

Au 31 décembre 2022

| Actif                                           | Niveau 1       | Niveau 2         | Niveau 3      | Total            |
|-------------------------------------------------|----------------|------------------|---------------|------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                |                  |               |                  |
| Obligations                                     | –              | 8 159 155        | –             | 8 159 155        |
| Actions                                         | 2 010          | –                | –             | 2 010            |
| Fonds d'investissement                          | 244 197        | –                | –             | 244 197          |
| Actions privilégiées                            | 54 898         | –                | 46 570        | 101 468          |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –              | 137              | –             | 137              |
| <b>Passif</b>                                   |                |                  |               |                  |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                |                  |               |                  |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –              | (188)            | –             | (188)            |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>301 105</b> | <b>8 159 104</b> | <b>46 570</b> | <b>8 506 779</b> |

Les positions du niveau 3 avaient été valorisées en fonction des cotations fournies par un courtier et jugées représentatives de la valeur de marché respective de ces titres, sachant toutefois que chaque valorisation comporte des facteurs non observables.

Les tableaux suivants présentent les mouvements au sein du niveau 3 pour la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022 par catégorie d'instrument financier.

Au 30 juin 2023

|                                                           | Obligations | Actions privilégiées | Total         |
|-----------------------------------------------------------|-------------|----------------------|---------------|
| <b>Solde à l'ouverture au 1<sup>er</sup> janvier 2023</b> | <b>–</b>    | <b>46 570</b>        | <b>46 570</b> |
| Achats                                                    | –           | –                    | –             |
| Ventes                                                    | –           | –                    | –             |
| Décotes accumulées (primes)                               | –           | –                    | –             |
| Transferts vers le niveau 3                               | –           | –                    | –             |
| Transferts hors du niveau 3                               | –           | –                    | –             |
| Gains et pertes constatés dans le compte de résultat      | –           | (3 496)              | (3 496)       |
| <b>Solde à la clôture au 30 juin 2023</b>                 | <b>–</b>    | <b>43 074</b>        | <b>43 074</b> |

Variation des gains et pertes latents sur les actifs de niveau 3 détenus en fin de période incluse dans les autres variations nettes de la juste valeur sur l'actif et le passif financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat

– (3 496) (3 496)

Au 31 décembre 2022

|                                                           | Obligations   | Actions privilégiées | Total         |
|-----------------------------------------------------------|---------------|----------------------|---------------|
| <b>Solde à l'ouverture au 1<sup>er</sup> janvier 2022</b> | <b>28 056</b> | <b>–</b>             | <b>28 056</b> |
| Achats                                                    | –             | –                    | –             |
| Ventes                                                    | –             | –                    | –             |
| Décotes accumulées (primes)                               | –             | –                    | –             |
| Transferts vers le niveau 3                               | –             | 56 250               | 56 250        |
| Transferts hors du niveau 3                               | (28 056)      | –                    | (28 056)      |
| Gains et pertes constatés dans le compte de résultat      | –             | (9 680)              | (9 680)       |
| <b>Solde à la clôture au 31 décembre 2022</b>             | <b>–</b>      | <b>46 570</b>        | <b>46 570</b> |

Variation des gains et pertes latents sur les actifs de niveau 3 détenus en fin d'exercice incluse dans les autres variations nettes de la juste valeur sur l'actif et le passif financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat

– (9 680) (9 680)

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

## 6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

## Estimation de la juste valeur (suite)

## Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

Les tableaux suivants ventilent l'actif et le passif financiers des Fonds évalués à leur juste valeur selon le classement susmentionné, au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

## Au 30 juin 2023

| Actif                                           | Niveau 1       | Niveau 2          | Niveau 3 | Total             |
|-------------------------------------------------|----------------|-------------------|----------|-------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                |                   |          |                   |
| Obligations                                     | –              | 37 510 189        | –        | 37 510 189        |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –              | 47 483            | –        | 47 483            |
| Contrats à terme normalisés                     | 13 791         | –                 | –        | 13 791            |
| <b>Passif</b>                                   |                |                   |          |                   |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                |                   |          |                   |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –              | (110 422)         | –        | (110 422)         |
| Contrats à terme normalisés                     | (15 615)       | –                 | –        | (15 615)          |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>(1 824)</b> | <b>37 447 244</b> | <b>–</b> | <b>37 445 426</b> |

\* Y compris les titres à juste valeur nulle.

## Au 31 décembre 2022

| Actif                                           | Niveau 1       | Niveau 2          | Niveau 3 | Total             |
|-------------------------------------------------|----------------|-------------------|----------|-------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                |                   |          |                   |
| Obligations                                     | –              | 57 217 806        | –        | 57 217 806        |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –              | 954 115           | –        | 954 115           |
| Contrats à terme normalisés                     | 30 241         | –                 | –        | 30 241            |
| <b>Passif</b>                                   |                |                   |          |                   |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                |                   |          |                   |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –              | (994 673)         | –        | (994 673)         |
| Contrats à terme normalisés                     | (31 527)       | –                 | –        | (31 527)          |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>(1 286)</b> | <b>57 177 248</b> | <b>–</b> | <b>57 175 962</b> |

Au 30 juin 2023, au sein du Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund, aucun titre au niveau 3 n'a été enregistré, aucun transfert entre les niveaux n'a été effectué et aucun mouvement inhérent au niveau 3 n'a été enregistré (31 décembre 2022 : néant).

Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

Estimation de la juste valeur (suite)

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund

Les tableaux suivants ventilent l'actif et le passif financiers des Fonds évalués à leur juste valeur selon le classement susmentionné, au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Au 30 juin 2023

| Actif                                           | Niveau 1         | Niveau 2          | Niveau 3     | Total             |
|-------------------------------------------------|------------------|-------------------|--------------|-------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                  |                   |              |                   |
| Obligations                                     | –                | 12 182 528        | –            | 12 182 528        |
| Actions                                         | 7 458 668        | –                 | 1 404        | 7 460 072         |
| Actions privilégiées                            | 372              | –                 | –            | 372               |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –                | 127 774           | –            | 127 774           |
| Contrats à terme normalisés                     | 503 665          | –                 | –            | 503 665           |
| Indices de swap de défaillance de crédit        | –                | 147 018           | –            | 147 018           |
| <b>Passif</b>                                   |                  |                   |              |                   |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                  |                   |              |                   |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –                | (196 209)         | –            | (196 209)         |
| Contrats à terme normalisés                     | (426 446)        | –                 | –            | (426 446)         |
| Indices de swap de défaillance de crédit        | –                | (21 170)          | –            | (21 170)          |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>7 536 259</b> | <b>12 239 941</b> | <b>1 404</b> | <b>19 777 604</b> |

Les positions du niveau 3 avaient été valorisées en fonction des cotations fournies par un courtier et jugées représentatives de la valeur de marché respective de ces titres, sachant toutefois que chaque valorisation comporte des facteurs non observables.

Au 31 décembre 2022

| Actif                                           | Niveau 1          | Niveau 2         | Niveau 3 | Total             |
|-------------------------------------------------|-------------------|------------------|----------|-------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                   |                  |          |                   |
| Obligations                                     | –                 | 8 372 945        | –        | 8 372 945         |
| Actions                                         | 11 779 840        | –                | –        | 11 779 840        |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –                 | 99 072           | –        | 99 072            |
| Contrats à terme normalisés                     | 533 609           | –                | –        | 533 609           |
| Indices de swap de défaillance de crédit        | –                 | 22 879           | –        | 22 879            |
| <b>Passif</b>                                   |                   |                  |          |                   |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                   |                  |          |                   |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –                 | (59 626)         | –        | (59 626)          |
| Contrats à terme normalisés                     | (521 098)         | –                | –        | (521 098)         |
| Indices de swap de défaillance de crédit        | –                 | (7 133)          | –        | (7 133)           |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>11 792 351</b> | <b>8 428 137</b> | <b>–</b> | <b>20 220 488</b> |

Les positions du niveau 3 avaient été valorisées en fonction des cotations fournies par un courtier et jugées représentatives de la valeur de marché respective de ces titres, sachant toutefois que chaque valorisation comporte des facteurs non observables.



# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

### 6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

#### Estimation de la juste valeur (suite)

#### Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (suite)

Les tableaux suivants présentent les mouvements au sein du niveau 3 pour la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022 par catégorie d'instrument financier.

#### Au 30 juin 2023

|                                                                                                                                                                                                                                                    | <b>Actions</b> | <b>Total</b> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------|
| <b>Solde à l'ouverture au 1<sup>er</sup> janvier 2023</b>                                                                                                                                                                                          | –              | –            |
| Achats                                                                                                                                                                                                                                             | 1 699          | 1 699        |
| Ventes                                                                                                                                                                                                                                             | –              | –            |
| Décotes accumulées (primes)                                                                                                                                                                                                                        | –              | –            |
| Transferts vers le niveau 3                                                                                                                                                                                                                        | –              | –            |
| Transferts hors du niveau 3                                                                                                                                                                                                                        | –              | –            |
| Gains et pertes constatés dans le compte de résultat                                                                                                                                                                                               | (295)          | (295)        |
| <b>Solde à la clôture au 30 juin 2023</b>                                                                                                                                                                                                          | <b>1 404</b>   | <b>1 404</b> |
| Variation des gains et pertes latents sur les actifs de niveau 3 détenus en fin de période incluse dans les autres variations nettes de la juste valeur sur l'actif et le passif financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat | (295)          | (295)        |

#### Au 31 décembre 2022

|                                                                                                                                                                                                                                                    | <b>Swaps de taux de rendement<br/>total</b> | <b>Total</b>   |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------|----------------|
| <b>Solde à l'ouverture au 1<sup>er</sup> janvier 2022</b>                                                                                                                                                                                          | <b>172 851</b>                              | <b>172 851</b> |
| Achats                                                                                                                                                                                                                                             | 13 000 000                                  | 13 000 000     |
| Ventes                                                                                                                                                                                                                                             | (13 040 669)                                | (13 040 669)   |
| Décotes accumulées (primes)                                                                                                                                                                                                                        | –                                           | –              |
| Transferts vers le niveau 3                                                                                                                                                                                                                        | –                                           | –              |
| Transferts hors du niveau 3                                                                                                                                                                                                                        | –                                           | –              |
| Gains et pertes constatés dans le compte de résultat                                                                                                                                                                                               | (132 182)                                   | (132 182)      |
| <b>Solde à la clôture au 31 décembre 2022</b>                                                                                                                                                                                                      | <b>–</b>                                    | <b>–</b>       |
| Variation des gains et pertes latents sur les actifs de niveau 3 détenus en fin d'exercice incluse dans les autres variations nettes de la juste valeur sur l'actif et le passif financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat | (172 851)                                   | (172 851)      |

Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

Estimation de la juste valeur (suite)

Loomis Sayles Euro High Yield Fund

Les tableaux suivants ventilent l'actif et le passif financiers des Fonds évalués à leur juste valeur selon le classement susmentionné, au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Au 30 juin 2023

| Actif                                           | Niveau 1       | Niveau 2          | Niveau 3 | Total             |
|-------------------------------------------------|----------------|-------------------|----------|-------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                |                   |          |                   |
| Obligations                                     | –              | 28 277 171        | –        | 28 277 171        |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –              | 43                | –        | 43                |
| Contrats à terme normalisés                     | 17 640         | –                 | –        | 17 640            |
| <b>Passif</b>                                   |                |                   |          |                   |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                |                   |          |                   |
| Contrats à terme normalisés                     | (24 090)       | –                 | –        | (24 090)          |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>(6 450)</b> | <b>28 277 214</b> | <b>–</b> | <b>28 270 764</b> |

Au 31 décembre 2022

| Actif                                           | Niveau 1        | Niveau 2          | Niveau 3 | Total             |
|-------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------|-------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                 |                   |          |                   |
| Obligations                                     | –               | 25 984 449        | –        | 25 984 449        |
| Contrats à terme normalisés                     | 35 800          | –                 | –        | 35 800            |
| <b>Passif</b>                                   |                 |                   |          |                   |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                 |                   |          |                   |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –               | (4)               | –        | (4)               |
| Contrats à terme normalisés                     | (61 112)        | –                 | –        | (61 112)          |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>(25 312)</b> | <b>25 984 445</b> | <b>–</b> | <b>25 959 133</b> |

Au 30 juin 2023, au sein du Loomis Sayles Euro High Yield Fund, aucun titre au niveau 3 n'a été enregistré, aucun transfert entre les niveaux n'a été effectué et aucun mouvement inhérent au niveau 3 n'a été enregistré (31 décembre : néant).

Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

Estimation de la juste valeur (suite)

Loomis Sayles Euro Credit Fund

Les tableaux suivants ventilent l'actif et le passif financiers des Fonds évalués à leur juste valeur selon le classement susmentionné, au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Au 30 juin 2023

| Actif                                           | Niveau 1     | Niveau 2           | Niveau 3 | Total              |
|-------------------------------------------------|--------------|--------------------|----------|--------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |              |                    |          |                    |
| Obligations                                     | –            | 106 932 224        | –        | 106 932 224        |
| Contrats à terme de gré à gré                   | –            | 2 423              | –        | 2 423              |
| Contrats à terme normalisés                     | 70 560       | –                  | –        | 70 560             |
| <b>Passif</b>                                   |              |                    |          |                    |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |              |                    |          |                    |
| Contrats à terme normalisés                     | (62 870)     | –                  | –        | (62 870)           |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>7 690</b> | <b>106 934 647</b> | <b>–</b> | <b>106 942 337</b> |

Au 31 décembre 2022

| Actif                                           | Niveau 1         | Niveau 2          | Niveau 3 | Total             |
|-------------------------------------------------|------------------|-------------------|----------|-------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                  |                   |          |                   |
| Obligations                                     | –                | 99 548 918        | –        | 99 548 918        |
| Contrats à terme normalisés                     | 42 960           | –                 | –        | 42 960            |
| <b>Passif</b>                                   |                  |                   |          |                   |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                  |                   |          |                   |
| Contrats à terme normalisés                     | (369 193)        | –                 | –        | (369 193)         |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>(326 233)</b> | <b>99 548 918</b> | <b>–</b> | <b>99 222 685</b> |

Au 30 juin 2022, au sein du Loomis Sayles Euro Credit Fund, aucun titre au niveau 3 n'a été enregistré, aucun transfert entre les niveaux n'a été effectué et aucun mouvement inhérent au niveau 3 n'a été enregistré (31 décembre : néant).

## NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

### Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

#### 6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

##### Estimation de la juste valeur (suite)

##### Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund

Les tableaux suivants ventilent l'actif et le passif financiers des Fonds évalués à leur juste valeur selon le classement susmentionné, au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

##### Au 30 juin 2023

| <b>Actif</b>                                    | <b>Niveau 1</b> | <b>Niveau 2</b>    | <b>Niveau 3</b> | <b>Total</b>       |
|-------------------------------------------------|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                 |                    |                 |                    |
| Obligations                                     | –               | 524 656 119        | –               | 524 656 119        |
| Contrats à terme normalisés                     | 473 340         | –                  | –               | 473 340            |
| <b>Passif</b>                                   |                 |                    |                 |                    |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                 |                    |                 |                    |
| Contrats à terme normalisés                     | (323 820)       | –                  | –               | (323 820)          |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>149 520</b>  | <b>524 656 119</b> | <b>–</b>        | <b>524 805 639</b> |

##### Au 31 décembre 2022

| <b>Actif</b>                                    | <b>Niveau 1</b>  | <b>Niveau 2</b>    | <b>Niveau 3</b> | <b>Total</b>       |
|-------------------------------------------------|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Actif financier détenu à des fins de trading :  |                  |                    |                 |                    |
| Obligations                                     | –                | 388 538 295        | –               | 388 538 295        |
| Contrats à terme normalisés                     | 257 740          | –                  | –               | 257 740            |
| <b>Passif</b>                                   |                  |                    |                 |                    |
| Passif financier détenu à des fins de trading : |                  |                    |                 |                    |
| Contrats à terme normalisés                     | (1 050 298)      | –                  | –               | (1 050 298)        |
| swaps de défaillance de crédit                  | –                | (3 149)            | –               | (3 149)            |
| <b>Total de l'actif</b>                         | <b>(792 558)</b> | <b>388 535 146</b> | <b>–</b>        | <b>387 742 588</b> |

Au 30 juin 2023, au sein du Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund, aucun titre au niveau 3 n'a été enregistré, aucun transfert entre les niveaux n'a été effectué et aucun mouvement inhérent au niveau 3 n'a été enregistré (31 décembre : néant).

Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

7. GESTION EFFICACE DU PORTEFEUILLE

À des fins de gestion efficace du portefeuille et de couverture des risques de change, la Société peut mettre en œuvre des instruments financiers dérivés, dans la mesure permise par les objectifs et politiques d'investissement des Fonds et dans le respect des limites ponctuellement définies par la Banque centrale d'Irlande et des dispositions du Prospectus. Au cours du semestre clos le 30 juin 2023, la Société a mis en œuvre des techniques de gestion efficace du portefeuille par le biais de contrats à terme normalisés sur des taux d'intérêt.

La Société a conclu des contrats de change à terme à des fins de couverture du risque de change découlant des investissements et des liquidités, en vue de se prémunir contre le risque lié à l'Indice de Référence. La Société a également conclu des contrats de change à terme afin de couvrir certaines classes d'actions.

Les contrats en cours au 30 juin 2023 figurent au Calendrier des investissements. Les gains et pertes réalisés sur les instruments financiers utilisés dans une optique de gestion efficace du portefeuille sont présentés dans le tableau ci-dessous.

Au 30 juin 2023

| Fonds                                        | Charges liées aux commissions sur les contrats à terme normalisés | Plus-value/(moins-value) réalisée | Variation de la plus-value/(moins-value) latente |
|----------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|
| Loomis Sayles Multisector Income Fund        | 6901 USD                                                          | (1 400 648) USD                   | 826613 USD                                       |
| Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund | 248 USD                                                           | (60 030) USD                      | (538) USD                                        |
| Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund   | 31314 USD                                                         | (339 371) USD                     | 64708 USD                                        |
| Loomis Sayles Euro High Yield Fund           | 300 EUR                                                           | (19 537) EUR                      | 18862 EUR                                        |
| Loomis Sayles Euro Credit Fund               | 1038 EUR                                                          | (215 053) EUR                     | 333923 EUR                                       |
| Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund   | 4859 EUR                                                          | (565 638) EUR                     | 942078 EUR                                       |

Au 31 décembre 2022

| Fonds                                        | Charges liées aux commissions sur les contrats à terme normalisés | Plus-value/(moins-value) réalisée | Variation de la plus-value/(moins-value) latente |
|----------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|
| Loomis Sayles Multisector Income Fund        | 10870 USD                                                         | (9 276 198) USD                   | 585039 USD                                       |
| Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund | 1626 USD                                                          | 137569 USD                        | 57924 USD                                        |
| Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund   | 33249 USD                                                         | (1 643 104) USD                   | (240 370) USD                                    |
| Loomis Sayles Euro High Yield Fund           | 397 EUR                                                           | 41560 EUR                         | (33 337) EUR                                     |
| Loomis Sayles Euro Credit Fund               | 1414 EUR                                                          | 1010550 EUR                       | (266 658) EUR                                    |
| Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund   | 4077 EUR                                                          | 2148320 EUR                       | (731 898) EUR                                    |

8. ACCORDS DE COMMISSIONS EN NATURE

La Société de gestion et tout Gestionnaire Financier n'ont conclu aucun accord de commissions en nature pour l'un quelconque des Fonds pour la période du 1er janvier 2022 au 30 juin 2023 (31 décembre 2022 : zéro).

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

### 9. TABLEAU DE COMPARAISON DES VALEURS D'INVENTAIRE NETTES

|                                              | Au 30 juin 2023 |       | Au 31 décembre 2022 |       | Au 30 juin 2022 |       |
|----------------------------------------------|-----------------|-------|---------------------|-------|-----------------|-------|
|                                              | Actions         | USD   | Actions             | USD   | Actions         | USD   |
| <b>LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND</b> |                 |       |                     |       |                 |       |
| - Classe d'Actions C/A (USD)                 | 699 436         | 21,24 | 780 909             | 20,84 | 795 653         | 20,87 |
| - Classe d'Actions C/D (USD)                 | 422 523         | 11,86 | 463 361             | 11,77 | 515 554         | 11,90 |
| - Classe d'Actions CT/A (USD)                | 7 065           | 9,78  | 4 267               | 9,62  | 47 245          | 9,66  |
| - Classe d'Actions CT/DG (USD)               | 1 037           | 9,56  | 1 018               | 9,53  | 1 002           | 9,66  |
| - Classe d'Actions CT/DM (USD)               | 6 557           | 9,19  | 10 130              | 9,07  | 69 070          | 9,17  |
| - Classe d'Actions F/A (USD)                 | 82 155          | 14,10 | 82 155              | 13,78 | 101 088         | 13,73 |
| - Classe d'Actions F/DM (USD)                | 54 016          | 7,97  | 53 123              | 7,92  | 52 366          | 8,00  |
| - Classe d'Actions H-I/A (EUR)               | 259 009         | 16,95 | 375 733             | 16,38 | 365 280         | 16,21 |
| - Classe d'Actions H-I/D (EUR)               | 88 141          | 9,55  | 44 975              | 9,39  | 23 330          | 9,44  |
| - Classe d'Actions H-I/D (GBP)               | 143 494         | 12,84 | 152 589             | 12,11 | 154 667         | 12,47 |
| - Classe d'Actions H-N/A (CHF)               | 750             | 10,18 | 750                 | 9,81  | 750             | 9,63  |
| - Classe d'Actions H-N/A (EUR)               | 214 822         | 9,93  | 214 822             | 9,60  | 214 836         | 9,49  |
| - Classe d'Actions H-N/D (EUR)               | –               | –     | 2 450               | 7,22  | 3 400           | 7,25  |
| - Classe d'Actions H-N1/A (EUR)              | 308 794         | 10,07 | 273 009             | 9,71  | 149 747         | 9,60  |
| - Classe d'Actions H-R/A (EUR)               | 2 236 003       | 10,53 | 2 794 167           | 10,19 | 3 611 953       | 10,12 |
| - Classe d'Actions H-R/A (SGD)               | 2 648 053       | 7,72  | 2 554 156           | 7,67  | 3 108 778       | 7,39  |
| - Classe d'Actions H-R/D (SGD)               | 529 151         | 5,83  | 549 825             | 5,87  | 543 209         | 5,74  |
| - Classe d'Actions H-RE/DM (AUD)             | 97 105          | 5,71  | 99 258              | 5,82  | 104 794         | 6,00  |
| - Classe d'Actions H-S/D (EUR)               | 73 984          | 7,65  | 76 550              | 7,52  | 76 550          | 7,57  |
| - Classe d'Actions I/A (EUR)                 | 73 463          | 34,41 | 88 171              | 33,57 | 73 380          | 33,40 |
| - Classe d'Actions I/A (USD)                 | 4 916 886       | 18,06 | 6 759 896           | 17,62 | 5 042 497       | 17,53 |
| - Classe d'Actions I/D (GBP)                 | 9 990           | 13,53 | 9 990               | 13,43 | 9 990           | 13,58 |
| - Classe d'Actions I/D (USD)                 | 3 411 134       | 11,01 | 3 081 784           | 10,93 | 3 479 156       | 11,06 |
| - Classe d'Actions I/DG (USD)                | 1 037           | 9,62  | 1 018               | 9,56  | 1 002           | 9,67  |
| - Classe d'Actions N/A (EUR)                 | 456 287         | 10,88 | –                   | –     | –               | –     |
| - Classe d'Actions N/A (USD)                 | 4 882           | 10,26 | 4 882               | 10,01 | 4 882           | 9,96  |
| - Classe d'Actions N/DM (USD)                | 47 510          | 8,47  | 47 510              | 8,41  | 101 081         | 8,51  |
| - Classe d'Actions N1/A (USD)                | 748 132         | 10,36 | 848 598             | 10,11 | 755 768         | 10,05 |
| - Classe d'Actions N1/D (USD)                | 568 926         | 8,61  | 497 279             | 8,55  | 496 919         | 8,65  |
| - Classe d'Actions R/A (EUR)                 | 1 095 712       | 23,51 | 564 229             | 22,99 | 570 507         | 22,94 |
| - Classe d'Actions R/A (SGD)                 | 70 403          | 8,53  | 71 101              | 8,34  | 72 774          | 8,32  |
| - Classe d'Actions R/A (USD)                 | 5 183 928       | 16,12 | 5 639 617           | 15,76 | 5 963 095       | 15,73 |
| - Classe d'Actions R/D (EUR)                 | 45 200          | 9,86  | 44 529              | 9,79  | 43 943          | 9,90  |
| - Classe d'Actions R/D (GBP)                 | 112 526         | 17,96 | 110 742             | 17,83 | 113 761         | 18,03 |
| - Classe d'Actions R/D (SGD)                 | 233 974         | 6,21  | 239 943             | 6,16  | 247 171         | 6,23  |
| - Classe d'Actions R/D (USD)                 | 3 338 915       | 11,02 | 3 611 239           | 10,95 | 3 677 338       | 11,07 |
| - Classe d'Actions R/DG (USD)                | 1 963           | 9,61  | 1 018               | 9,58  | 1 001           | 9,72  |
| - Classe d'Actions R/DM (USD)                | 2 008 984       | 12,72 | 2 077 008           | 12,64 | 2 217 944       | 12,78 |
| - Classe d'Actions RE/A (EUR)                | 226 220         | 20,95 | 269 448             | 20,52 | 295 501         | 20,51 |
| - Classe d'Actions RE/A (USD)                | 5 680 172       | 14,83 | 6 044 123           | 14,53 | 6 241 287       | 14,52 |
| - Classe d'Actions RE/D (USD)                | 97              | 10,21 | 97                  | 9,99  | 97              | 9,97  |
| - Classe d'Actions RE/DM (USD)               | 106             | 10,18 | 106                 | 9,98  | 106             | 9,97  |
| - Classe d'Actions S/A (USD)                 | 3 925 364       | 18,11 | 3 886 871           | 17,64 | 4 016 744       | 17,53 |
| - Classe d'Actions S/D (GBP)                 | 678             | 13,56 | 678                 | 13,39 | 2 327           | 13,54 |
| - Classe d'Actions S/D (USD)                 | 38 300          | 13,40 | 38 300              | 13,29 | 1 199 159       | 13,44 |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

### 9. TABLEAU DE COMPARAISON DES VALEURS D'INVENTAIRE NETTES (suite)

|                                       | Au 30 juin 2023 |       | Au 31 décembre 2022 |       | Au 30 juin 2022 |       |
|---------------------------------------|-----------------|-------|---------------------|-------|-----------------|-------|
|                                       | Actions         | USD   | Actions             | USD   | Actions         | USD   |
| <b>LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND</b> |                 |       |                     |       |                 |       |
| - Classe d'Actions H-I/A (EUR)        | 80 106          | 22,65 | 80 106              | 21,65 | 80 106          | 20,80 |
| - Classe d'Actions H-N/D (EUR)        | 426             | 7,28  | 422                 | 7,03  | 417             | 6,84  |
| - Classe d'Actions H-R/A (EUR)        | 1 161           | 9,48  | 1 161               | 9,11  | 1 161           | 8,80  |
| - Classe d'Actions I/A (EUR)          | 7 850           | 20,19 | 68 640              | 19,48 | 165 384         | 18,82 |
| - Classe d'Actions I/A (USD)          | 141             | 23,85 | 141                 | 23,02 | 141             | 22,24 |
| - Classe d'Actions I/D (USD)          | 241 044         | 4,44  | 294 030             | 4,41  | 286 321         | 4,37  |
| - Classe d'Actions N/DM (USD)         | 434             | 7,03  | 434                 | 6,87  | 434             | 6,71  |
| - Classe d'Actions R/A (EUR)          | 56 292          | 18,81 | 64 306              | 18,24 | 69 389          | 17,72 |
| - Classe d'Actions R/A (USD)          | 4 280           | 10,13 | 4 280               | 9,83  | 4 280           | 9,54  |
| - Classe d'Actions R/D (SGD)          | —               | —     | —                   | —     | 627             | 4,50  |
| - Classe d'Actions R/D (USD)          | 239 187         | 5,96  | 255 873             | 5,91  | 260 586         | 5,86  |
| - Classe d'Actions R/DM (USD)         | 206 652         | 6,72  | 211 048             | 6,66  | 254 015         | 6,61  |
| - Classe d'Actions S/A (USD)          | 3 100           | 20,10 | 5 500               | 19,39 | 5 500           | 18,71 |

|                                                     | Au 30 juin 2023 |       | Au 31 décembre 2022 |       | Au 30 juin 2022 |       |
|-----------------------------------------------------|-----------------|-------|---------------------|-------|-----------------|-------|
|                                                     | Actions         | USD   | Actions             | USD   | Actions         | USD   |
| <b>LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND</b> |                 |       |                     |       |                 |       |
| - Classe d'Actions C/A (USD)                        | 12 930          | 12,61 | 12 930              | 12,48 | 11 926          | 12,90 |
| - Classe d'Actions C/D (USD)                        | —               | —     | —                   | —     | 395             | 7,09  |
| - Classe d'Actions H-I/A (SGD)                      | 149 501         | 7,06  | 152 582             | 6,93  | 150 464         | 6,87  |
| - Classe d'Actions H-N/D (EUR)                      | 390             | 8,45  | 388                 | 8,14  | 387             | 8,32  |
| - Classe d'Actions H-R/A (EUR)                      | 43 428          | 9,20  | 43 286              | 8,84  | 58 979          | 9,03  |
| - Classe d'Actions H-S/D (GBP)                      | —               | —     | 2 475 360           | 9,05  | 2 475 360       | 9,54  |
| - Classe d'Actions I/A (USD)                        | 2 395 517       | 12,99 | 2 228 246           | 12,77 | 2 417 126       | 13,12 |
| - Classe d'Actions I/D (USD)                        | 58 954          | 9,82  | 69 367              | 9,76  | 69 919          | 10,13 |
| - Classe d'Actions N/A (EUR)                        | 6               | 10,87 | 6                   | 10,79 | 6               | 11,16 |
| - Classe d'Actions N1/A (USD)                       | 15 008          | 9,08  | 14 888              | 8,92  | 13 111          | 9,16  |
| - Classe d'Actions R/A (EUR)                        | 185 621         | 17,62 | 193 934             | 17,38 | 198 489         | 17,91 |
| - Classe d'Actions R/A (USD)                        | 29 020          | 9,38  | 28 898              | 9,25  | 28 788          | 9,54  |
| - Classe d'Actions R/D (GBP)                        | 13 784          | 17,21 | 13 382              | 17,11 | 12 821          | 17,74 |
| - Classe d'Actions R/D (USD)                        | 137 928         | 9,77  | 163 571             | 9,72  | 162 916         | 10,08 |
| - Classe d'Actions RE/A (USD)                       | —               | —     | —                   | —     | 300             | 9,03  |

|                                                   | Au 30 juin 2023 |       | Au 31 décembre 2022 |       | Au 30 juin 2022 |       |
|---------------------------------------------------|-----------------|-------|---------------------|-------|-----------------|-------|
|                                                   | Actions         | USD   | Actions             | USD   | Actions         | USD   |
| <b>LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND</b> |                 |       |                     |       |                 |       |
| - Classe d'Actions H-I/A (EUR)                    | 41 398          | 10,88 | 49 122              | 10,30 | 198 101         | 9,98  |
| - Classe d'Actions H-Q/A (EUR)                    | 2 257 517       | 11,52 | 2 257 517           | 10,87 | 2 500 000       | 10,50 |
| - Classe d'Actions I/A (USD)                      | 287             | 10,76 | 287                 | 10,29 | 287             | 10,05 |
| - Classe d'Actions R/A (USD)                      | 287             | 10,63 | 287                 | 10,20 | 287             | 9,99  |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

### 9. TABLEAU DE COMPARAISON DES VALEURS D'INVENTAIRE NETTES (suite)

|                                           | Au 30 juin 2023 |      | Au 31 décembre 2022 |      | Au 30 juin 2022 |      |
|-------------------------------------------|-----------------|------|---------------------|------|-----------------|------|
|                                           | Actions         | EUR  | Actions             | EUR  | Actions         | EUR  |
| <b>LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND</b> |                 |      |                     |      |                 |      |
| - Classe d'Actions H-I/A (CHF)            | 300             | 9,76 | 300                 | 9,35 | 300             | 8,82 |
| - Classe d'Actions H-N/A (CHF)            | 300             | 9,75 | 300                 | 9,34 | 300             | 8,82 |
| - Classe d'Actions H-R/A (CHF)            | 300             | 9,68 | 300                 | 9,30 | 300             | 8,80 |
| - Classe d'Actions I/A (EUR)              | 10              | 9,69 | 10                  | 9,28 | 10              | 8,79 |
| - Classe d'Actions N/A (EUR)              | 10              | 9,56 | 10                  | 9,16 | 10              | 8,67 |
| - Classe d'Actions Q/A (EUR)              | 1 762 817       | 9,50 | 1 762 817           | 9,11 | 1 762 817       | 8,66 |
| - Classe d'Actions R/A (EUR)              | 205             | 9,61 | 205                 | 9,26 | 10              | 8,79 |
| - Classe d'Actions RE/A (EUR)             | 300             | 9,25 | 300                 | 8,92 | 300             | 8,54 |
| - Classe d'Actions S/A (EUR)              | 10              | 9,69 | 10                  | 9,28 | 10              | 8,79 |
| - Classe d'Actions S2/A (EUR)             | 1 427 437       | 9,36 | 1 266 362           | 8,98 | 1 302 720       | 8,54 |

|                                       | Au 30 juin 2023 |       | Au 31 décembre 2022 |      | Au 30 juin 2022 |      |
|---------------------------------------|-----------------|-------|---------------------|------|-----------------|------|
|                                       | Actions         | EUR   | Actions             | EUR  | Actions         | EUR  |
| <b>LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND</b> |                 |       |                     |      |                 |      |
| - Classe d'Actions H-I/A (USD)        | 70 000          | 9,19  | —                   | —    | —               | —    |
| - Classe d'Actions I/A (EUR)          | 38 890          | 8,81  | 33 488              | 8,59 | 58 361          | 8,75 |
| - Classe d'Actions I/D (EUR)          | 129 500         | 10,03 | —                   | —    | —               | —    |
| - Classe d'Actions N/A (EUR)          | 10              | 8,83  | 10                  | 8,62 | 10              | 8,81 |
| - Classe d'Actions Q/A (EUR)          | 2 207 934       | 8,87  | 4 058 366           | 8,63 | 7 000 000       | 8,78 |
| - Classe d'Actions R/A (EUR)          | 3 649           | 8,77  | 3 418               | 8,57 | 10              | 8,76 |
| - Classe d'Actions RE/A (EUR)         | 300             | 8,72  | 300                 | 8,52 | 300             | 8,71 |
| - Classe d'Actions S/A (EUR)          | 1 114 506       | 8,80  | 505 145             | 8,57 | 10              | 8,76 |
| - Classe d'Actions S1/A (EUR)         | 1 479 620       | 10,02 | —                   | —    | —               | —    |
| - Classe d'Actions S2/A (EUR)         | 7 212 964       | 8,84  | 7 200 534           | 8,61 | 4 374 968       | 8,76 |

|                                                   | Au 30 juin 2023 |      | Au 31 décembre 2022 |      | Au 30 juin 2022 |      |
|---------------------------------------------------|-----------------|------|---------------------|------|-----------------|------|
|                                                   | Actions         | EUR  | Actions             | EUR  | Actions         | EUR  |
| <b>LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND</b> |                 |      |                     |      |                 |      |
| - Classe d'Actions I/A (EUR)                      | 439 237         | 8,89 | 300                 | 8,68 | 300             | 8,85 |
| - Classe d'Actions N/A (EUR)                      | 14 900          | 8,87 | 14 900              | 8,67 | 14 900          | 8,84 |
| - Classe d'Actions Q/A (EUR)                      | 16 419 337      | 8,96 | 10 754 005          | 8,73 | 8 267 858       | 8,88 |
| - Classe d'Actions R/A (EUR)                      | 2 560           | 8,83 | 1 425               | 8,64 | 300             | 8,81 |
| - Classe d'Actions RE/A (EUR)                     | 299             | 8,84 | 299                 | 8,64 | 299             | 8,82 |
| - Classe d'Actions S/D (EUR)                      | 26 067 143      | 8,93 | 23 170 387          | 8,71 | 19 432 645      | 8,87 |
| - Classe d'Actions S2/A (EUR)                     | 1 416 819       | 8,91 | 625 458             | 8,70 | 300             | 8,86 |
| - Classe d'Actions S3/A (EUR)                     | 15 277 654      | 9,18 | 10 751 259          | 8,95 | 10 790 208      | 9,11 |
| - Classe d'Actions S3/D (EUR)                     | 300             | 9,36 | 300                 | 9,13 | 300             | 9,30 |

### 10. ÉVÉNEMENTS IMPORTANTS AYANT TOUCHÉ LA SOCIÉTÉ AU COURS DU SEMESTRE

Aucun événement important n'a touché la Société pendant le semestre.



## NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

### Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

#### 11. CHARGES FINANCIÈRES

Au cours du semestre clos le 30 juin 2023 et pour l'exercice clos le 31 décembre 2022, la Société a déclaré et payé les dividendes suivants :

##### Loomis Sayles Multisector Income Fund

| Date       | Montant des distributions sur le résultat<br>USD | Montant des distributions sur les capitaux propres<br>USD | Montant total<br>USD |
|------------|--------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|----------------------|
| 30/06/2023 | (1 123 469)                                      | (842 379)                                                 | (1 965 848)          |

| Date       | Montant des distributions sur le résultat<br>USD | Montant des distributions sur les capitaux propres<br>USD | Montant total<br>USD |
|------------|--------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|----------------------|
| 31/12/2022 | (4 095 783)                                      | –                                                         | (4 095 783)          |

##### Loomis Sayles High Income Fund

| Date       | Montant des distributions sur le résultat<br>USD | Montant des distributions sur les capitaux propres<br>USD | Montant total<br>USD |
|------------|--------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|----------------------|
| 30/06/2023 | (58 027)                                         | (40 884)                                                  | (98 911)             |

| Date       | Montant des distributions sur le résultat<br>USD | Montant des distributions sur les capitaux propres<br>USD | Montant total<br>USD |
|------------|--------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|----------------------|
| 31/12/2022 | (211 334)                                        | (698 627)                                                 | (909 961)            |

##### Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

| Date       | Montant des distributions sur le résultat<br>USD | Montant des distributions sur les capitaux propres<br>USD | Montant total<br>USD |
|------------|--------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|----------------------|
| 30/06/2023 | (10 687)                                         | (150 226)                                                 | (160 913)            |

| Date       | Montant des distributions sur le résultat<br>USD | Montant des distributions sur les capitaux propres<br>USD | Montant total<br>USD |
|------------|--------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|----------------------|
| 31/12/2022 | (550 988)                                        | (4 624 724)                                               | (5 175 712)          |

## NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

### Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2023 (suite)

#### 12. ÉVÉNEMENTS SURVENUS APRÈS LA FIN DU SEMESTRE

Les dividendes déclarés et versés par la Société après la clôture du semestre sont les suivants :

##### Loomis Sayles Multisector Income Fund

| Date       | Nombre d'actions<br>participantes remboursables | Montant des distributions<br>sur le résultat<br>USD | Montant des distributions<br>sur les capitaux propres<br>USD |
|------------|-------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
| 03/07/2023 | 11 235 144                                      | 854 999                                             | —                                                            |

##### Loomis Sayles High Income Fund

| Date       | Nombre d'actions<br>participantes remboursables | Montant des distributions<br>sur le résultat<br>USD | Montant des distributions<br>sur les capitaux propres<br>USD |
|------------|-------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
| 03/07/2023 | 687 744                                         | 36 606                                              | —                                                            |

##### Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

| Date       | Nombre d'actions<br>participantes remboursables | Montant des distributions<br>sur le résultat<br>USD | Montant des distributions<br>sur les capitaux propres<br>USD |
|------------|-------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
| 03/07/2023 | 211 057                                         | 11 268                                              | —                                                            |

Aucun autre événement important n'a touché la Société depuis la clôture du semestre.

#### 13. APPROBATION DES ÉTATS FINANCIERS CONDENSÉS

Les Administrateurs ont approuvé les états financiers condensés le 18 août 2023.

|                                                                                                                        |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME – 93,88 % DE L'ACTIF NET<br/>(31 décembre 2022 : 94,26 %)</b> |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 88,71 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 89,21 %)</b>                              |     |                    |                     |                     |
| <b>Aérospatiale/Défense - 0,17 % (31 décembre 2022 : 0,30 %)</b>                                                       |     |                    |                     |                     |
| TransDigm Inc, 6,250 %, 15/03/26 144A (i)                                                                              | USD | 620 000            | 616 970             | 0,11                |
| TransDigm Inc, 6,750 %, 15/08/28 144A (i)                                                                              | USD | 320 000            | 321 213             | 0,06                |
|                                                                                                                        |     |                    | 938 183             | 0,17                |
| <b>Compagnies aériennes - 1,80 % (31 décembre 2022 : 1,85 %)</b>                                                       |     |                    |                     |                     |
| American Airlines, 3,700 %, 15/10/25                                                                                   | USD | 778 789            | 731 680             | 0,13                |
| American Airlines, 3,750 %, 15/10/25                                                                                   | USD | 2 250 841          | 2 070 549           | 0,37                |
| American Airlines, 4,950 %, 15/02/25                                                                                   | USD | 982 823            | 938 591             | 0,17                |
| Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 6,500 %, 20/06/27 144A (i)                    | USD | 4 624 000          | 4 635 545           | 0,82                |
| United Airlines, 3,650 %, 07/10/25                                                                                     | USD | 677 037            | 629 005             | 0,11                |
| United Airlines, 4,000 %, 11/04/26                                                                                     | USD | 1 224 745          | 1 151 677           | 0,20                |
|                                                                                                                        |     |                    | 10 157 047          | 1,80                |
| <b>ABS automobiles - 0,12 % (31 décembre 2022 : 0,86 %)</b>                                                            |     |                    |                     |                     |
| Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, 4,000 %, 20/09/24 144A (i)                                                   | USD | 652 500            | 650 672             | 0,12                |
|                                                                                                                        |     |                    | 650 672             | 0,12                |
| <b>Automobile - 2,68 % (31 décembre 2022 : 2,59 %)</b>                                                                 |     |                    |                     |                     |
| General Motors Co, 6,250 %, 02/10/43                                                                                   | USD | 1 725 000          | 1 686 880           | 0,30                |
| General Motors Financial Co Inc, 3,100 %, 12/01/32                                                                     | USD | 390 000            | 315 433             | 0,06                |
| General Motors Financial Co Inc, 3,600 %, 21/06/30                                                                     | USD | 1 210 000          | 1 045 412           | 0,19                |
| General Motors Financial Co Inc, 5,700 % (ii) (iii)                                                                    | USD | 145 000            | 127 287             | 0,02                |
| General Motors Financial Co Inc, 5,750 % (ii) (iii)                                                                    | USD | 90 000             | 73 238              | 0,01                |
| General Motors Financial Co Inc, 6,000 %, 09/01/28                                                                     | USD | 1 755 000          | 1 769 065           | 0,31                |
| General Motors Financial Co Inc, 6,400 %, 09/01/33                                                                     | USD | 905 000            | 919 879             | 0,16                |
| Toyota Motor Credit Corp, 0,500 %, 18/06/24                                                                            | USD | 8 845 000          | 8 427 444           | 1,49                |
| ZF North America Capital Inc, 6,875 %, 14/04/28 144A (i)                                                               | USD | 380 000            | 385 464             | 0,07                |
| ZF North America Capital Inc, 7,125 %, 14/04/30 144A (i)                                                               | USD | 400 000            | 407 329             | 0,07                |
|                                                                                                                        |     |                    | 15 157 431          | 2,68                |
| <b>Activités bancaires - 9,65 % (31 décembre 2022 : 9,00 %)</b>                                                        |     |                    |                     |                     |
| Bank of America Corp, 2,482 %, 21/09/36 (ii)                                                                           | USD | 1 090 000          | 833 885             | 0,15                |
| Bank of America Corp, 4,183 %, 25/11/27                                                                                | USD | 500 000            | 474 987             | 0,08                |
| Bank of America Corp, 4,250 %, 22/10/26                                                                                | USD | 210 000            | 202 691             | 0,04                |
| Bank of America Corp, 4,376 %, 27/04/28 (ii)                                                                           | USD | 1 560 000          | 1 497 576           | 0,27                |
| Bank of America Corp, 5,288 %, 25/04/34 (ii)                                                                           | USD | 570 000            | 564 703             | 0,10                |
| Barclays PLC, 2,279 %, 24/11/27 (ii) (iv)                                                                              | USD | 3 150 000          | 2 770 937           | 0,49                |
| Barclays PLC, 3,564 %, 23/09/35 (ii) (iv)                                                                              | USD | 6 145 000          | 4 862 604           | 0,86                |
| Barclays PLC, 4,375 % (ii) (iii) (iv)                                                                                  | USD | 1 915 000          | 1 301 051           | 0,23                |
| BNP Paribas SA, 2,591 %, 20/01/28 144A (i) (ii) (iv)                                                                   | USD | 1 965 000          | 1 756 141           | 0,31                |
| Crédit Agricole SA, 3,250 %, 14/01/30 144A (i) (iv)                                                                    | USD | 805 000            | 687 218             | 0,12                |
| Crédit Agricole SA, 4,000 %, 10/01/33 EMTN (ii) (iv)                                                                   | USD | 940 000            | 836 827             | 0,15                |

|                                                                          |     | Valeur<br>Montant | Juste valeur<br>USD | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|-------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b> |     |                   |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                              |     |                   |                     |                     |
| <b>Activités bancaires – 9,65 % (31 décembre 2022 : 9,00 %) (suite)</b>  |     |                   |                     |                     |
| Deutsche Bank AG, 3,729 %, 14/01/32 (ii) (iv)                            | USD | 1 402 000         | 1 060 187           | 0,19                |
| Deutsche Bank AG, 3,742 %, 07/01/33 (ii) (iv)                            | USD | 595 000           | 436 355             | 0,08                |
| Deutsche Bank AG, 4,875 %, 01/12/32 (ii) (iv)                            | USD | 1 235 000         | 1 042 819           | 0,18                |
| Goldman Sachs Group Inc, 1,542 %, 10/09/27 (ii)                          | USD | 55 000            | 48 340              | 0,01                |
| Goldman Sachs Group Inc, 4,482 %, 23/08/28 (ii)                          | USD | 6 095 000         | 5 892 744           | 1,04                |
| Intesa Sanpaolo SpA, 6,625 %, 20/06/33 144A (i) (iv)                     | USD | 580 000           | 577 872             | 0,10                |
| JPMorgan Chase & Co, 1,953 %, 04/02/32 (ii)                              | USD | 7 775 000         | 6 195 039           | 1,09                |
| Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,850 %, 01/03/26 (iv)               | USD | 2 233 000         | 2 139 461           | 0,38                |
| Morgan Stanley, 2,188 %, 28/04/26 (ii)                                   | USD | 923 000           | 866 427             | 0,15                |
| Morgan Stanley, 4,350 %, 08/09/26                                        | USD | 1 490 000         | 1 438 955           | 0,25                |
| Morgan Stanley, 5,948 %, 19/01/38 (ii)                                   | USD | 1 285 000         | 1 268 349           | 0,22                |
| NatWest Group PLC, 1,642 %, 14/06/27 (ii) (iv)                           | USD | 2 220 000         | 1 953 688           | 0,35                |
| NatWest Group PLC, 5,516 %, 30/09/28 (ii) (iv)                           | USD | 285 000           | 279 368             | 0,05                |
| Standard Chartered PLC, 3,265 %, 18/02/36 144A (i) (ii) (iv)             | USD | 6 415 000         | 5 048 065           | 0,89                |
| Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 1,474 %, 08/07/25 (iv)              | USD | 1 027 000         | 943 161             | 0,17                |
| Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 5,464 %, 13/01/26 (iv)              | USD | 935 000           | 931 879             | 0,17                |
| Synchrony Bank, 5,400 %, 22/08/25                                        | USD | 470 000           | 449 360             | 0,08                |
| Synchrony Bank, 5,625 %, 23/08/27                                        | USD | 955 000           | 897 065             | 0,16                |
| UBS Group AG, 2,193 %, 05/06/26 144A (i) (ii) (iv)                       | USD | 1 000 000         | 916 969             | 0,16                |
| UBS Group AG, 6,373 %, 15/07/26 144A (i) (ii) (iv)                       | USD | 1 385 000         | 1 376 252           | 0,24                |
| UBS Group AG, 6,442 %, 11/08/28 144A (i) (ii) (iv)                       | USD | 1 360 000         | 1 365 009           | 0,24                |
| UBS Group AG, 6,537 %, 12/08/33 144A (i) (ii) (iv)                       | USD | 1 000 000         | 1 024 412           | 0,18                |
| UBS Group AG, 9,016 %, 15/11/33 144A (i) (ii) (iv)                       | USD | 850 000           | 1 018 842           | 0,18                |
| UniCredit SpA, 5,459 %, 30/06/35 144A (i) (ii) (iv)                      | USD | 1 925 000         | 1 633 650           | 0,29                |
|                                                                          |     |                   | <u>54 592 888</u>   | <u>9,65</u>         |
| <b>Boissons - 0,23 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                     |     |                   |                     |                     |
| Bacardi Ltd/Bacardi-Martini BV, 5,400 %, 15/06/33 144A (i) (iv)          | USD | 1 305 000         | 1 293 461           | 0,23                |
|                                                                          |     |                   | <u>1 293 461</u>    | <u>0,23</u>         |
| <b>Matériaux de construction - 1,72 % (31 décembre 2022 : 1,56 %)</b>    |     |                   |                     |                     |
| Cemex SAB de CV, 3,875 %, 11/07/31 144A (i) (iv)                         | USD | 8 335 000         | 7 017 273           | 1,24                |
| Cemex SAB de CV, 5,125 % 144A (i) (ii) (iii) (iv)                        | USD | 1 495 000         | 1 330 467           | 0,23                |
| JELD-WEN Inc, 4,875 %, 15/12/27 144A (i)                                 | USD | 890 000           | 788 228             | 0,14                |
| Masco Corp, 6,500 %, 15/08/32                                            | USD | 112 000           | 115 459             | 0,02                |
| Masco Corp, 7,750 %, 01/08/29                                            | USD | 464 000           | 507 097             | 0,09                |
|                                                                          |     |                   | <u>9 758 524</u>    | <u>1,72</u>         |
| <b>Chimie - 0,42 % (31 décembre 2022 : 0,59 %)</b>                       |     |                   |                     |                     |
| Braskem Netherlands Finance BV, 4,500 %, 31/01/30 144A (i) (iv)          | USD | 220 000           | 188 995             | 0,03                |
| Braskem Netherlands Finance BV, 5,875 %, 31/01/50 144A (i) (iv)          | USD | 1 260 000         | 1 018 161           | 0,18                |
| Celanese US Holdings LLC, 6,330 %, 15/07/29                              | USD | 450 000           | 446 903             | 0,08                |

|                                                                                       |     | <u>Valeur<br/>Montant</u> | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de l'actif<br/>net</u> |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-----|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>              |     |                           |                             |                             |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                           |     |                           |                             |                             |
| <b>Chimie – 0,42 % (31 décembre 2022 : 0,59 %) (suite)</b>                            |     |                           |                             |                             |
| Celanese US Holdings LLC, 6,379 %, 15/07/32                                           | USD | 330 000                   | 332 862                     | 0,06                        |
| INEOS Quattro Finance 2 PLC, 3,375 %, 15/01/26 144A (i) (iv)                          | USD | 205 000                   | 187 073                     | 0,03                        |
| Orbia Advance Corp SAB de CV, 2,875 %, 11/05/31 144A (i) (iv)                         | USD | 281 000                   | 222 093                     | 0,04                        |
|                                                                                       |     |                           | <u>2 396 087</u>            | <u>0,42</u>                 |
| <b>CMBS - 0,50 % (31 décembre 2022 : 0,51 %)</b>                                      |     |                           |                             |                             |
| GS Mortgage Securities Corp Trust, 3,668 %, 05/03/33 144A (i) (ii)                    | USD | 405 000                   | 341 111                     | 0,06                        |
| GS Mortgage Securities Trust, 4,885 %, 10/01/47 (ii)                                  | USD | 355 000                   | 291 656                     | 0,05                        |
| JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, 3,910 %, 15/12/47 144A (i) (ii) | USD | 840 162                   | 785 551                     | 0,14                        |
| MSBAM Commercial Mortgage Securities Trust, 3,277 %, 15/10/30 144A (i)                | USD | 153 841                   | 119 996                     | 0,02                        |
| RBS Commercial Funding Inc 2013-GSP Trust, 3,961 %, 15/01/32 144A (i) (ii)            | USD | 855 000                   | 825 524                     | 0,14                        |
| WFRBS Commercial Mortgage Trust, 4,378 %, 15/05/47                                    | USD | 665 000                   | 487 003                     | 0,09                        |
|                                                                                       |     |                           | <u>2 850 841</u>            | <u>0,50</u>                 |
| <b>Services commerciaux - 1,18 % (31 décembre 2022 : 0,69 %)</b>                      |     |                           |                             |                             |
| Ashtead Capital Inc, 5,500 %, 11/08/32 144A (i)                                       | USD | 240 000                   | 232 047                     | 0,04                        |
| Ashtead Capital Inc, 5,550 %, 30/05/33 144A (i)                                       | USD | 385 000                   | 375 292                     | 0,07                        |
| Block Inc, 3,500 %, 01/06/31                                                          | USD | 960 000                   | 795 093                     | 0,14                        |
| Equifax Inc, 7,000 %, 01/07/37                                                        | USD | 370 000                   | 393 346                     | 0,07                        |
| ERAC USA Finance LLC, 4,900 %, 01/05/33 144A (i)                                      | USD | 1 270 000                 | 1 240 983                   | 0,22                        |
| Gartner Inc, 3,625 %, 15/06/29 144A (i)                                               | USD | 95 000                    | 83 631                      | 0,01                        |
| Global Payments Inc, 2,900 %, 15/05/30                                                | USD | 545 000                   | 461 930                     | 0,08                        |
| Global Payments Inc 2,900 %, 15/11/31                                                 | USD | 690 000                   | 561 324                     | 0,10                        |
| Global Payments Inc 5,300 %, 15/08/29                                                 | USD | 360 000                   | 350 731                     | 0,06                        |
| Global Payments Inc 5,400 %, 15/08/32                                                 | USD | 785 000                   | 764 933                     | 0,14                        |
| TriNet Group Inc, 3,500 %, 01/03/29 144A (i)                                          | USD | 1 625 000                 | 1 412 923                   | 0,25                        |
|                                                                                       |     |                           | <u>6 672 233</u>            | <u>1,18</u>                 |
| <b>Ordinateurs - 1,32 % (31 décembre 2022 : 1,04 %)</b>                               |     |                           |                             |                             |
| Dell International LLC/EMC Corp, 6,020 %, 15/06/26                                    | USD | 2 145 000                 | 2 180 198                   | 0,39                        |
| Dell International LLC/EMC Corp, 8,100 %, 15/07/36                                    | USD | 1 460 000                 | 1 708 140                   | 0,30                        |
| Dell International LLC/EMC Corp, 8,350 %, 15/07/46                                    | USD | 485 000                   | 594 760                     | 0,10                        |
| Leidos Inc, 5,750 %, 15/03/33                                                         | USD | 1 160 000                 | 1 152 395                   | 0,20                        |
| Seagate HDD Cayman, 4,091 %, 01/06/29 (iv)                                            | USD | 85 000                    | 74 776                      | 0,01                        |
| Seagate HDD Cayman, 9,625 %, 01/12/32 (iv)                                            | USD | 61 200                    | 67 530                      | 0,01                        |
| Western Digital Corp, 2,850 %, 01/02/29                                               | USD | 745 000                   | 595 232                     | 0,11                        |
| Western Digital Corp, 4,750 %, 15/02/26                                               | USD | 1 160 000                 | 1 104 920                   | 0,20                        |
|                                                                                       |     |                           | <u>7 477 951</u>            | <u>1,32</u>                 |
| <b>Cosmétiques/soins personnels - 0,15 % (31 décembre 2022 : 0,14 %)</b>              |     |                           |                             |                             |
| Natura Cosmeticos SA, 4,125 %, 03/05/28 144A (i) (iv)                                 | USD | 995 000                   | 860 747                     | 0,15                        |
|                                                                                       |     |                           | <u>860 747</u>              | <u>0,15</u>                 |

|                                                                                 |     | <u>Valeur<br/>Montant</u> | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de l'actif<br/>net</u> |
|---------------------------------------------------------------------------------|-----|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>        |     |                           |                             |                             |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                     |     |                           |                             |                             |
| <b>Électricité - 0,30 % (31 décembre 2022 : 0,32 %)</b>                         |     |                           |                             |                             |
| Enel Finance International NV, 6,000 %, 07/10/39 (iv)                           | USD | 1 300 000                 | 1 276 838                   | 0,23                        |
| Pacific Gas & Electric Co, 5,450 %, 15/06/27                                    | USD | 405 000                   | 393 865                     | 0,07                        |
|                                                                                 |     |                           | <u>1 670 703</u>            | <u>0,30</u>                 |
| <b>Électronique - 1,29 % (31 décembre 2022 : 0,82 %)</b>                        |     |                           |                             |                             |
| Arrow Electronics Inc, 6,125 %, 01/03/26                                        | USD | 960 000                   | 957 727                     | 0,17                        |
| Avnet Inc, 5,500 %, 06/01/32                                                    | USD | 1 600 000                 | 1 519 193                   | 0,27                        |
| Flex Ltd, 6,000 %, 15/01/28 (iv)                                                | USD | 1 025 000                 | 1 040 965                   | 0,18                        |
| Sensata Technologies BV, 4,000 %, 15/04/29 144A (i) (iv)                        | USD | 855 000                   | 761 193                     | 0,14                        |
| TD SYNEX Corp, 1,750 %, 09/08/26                                                | USD | 1 910 000                 | 1 664 684                   | 0,29                        |
| Trimble Inc, 6,100 %, 15/03/33                                                  | USD | 1 330 000                 | 1 347 596                   | 0,24                        |
|                                                                                 |     |                           | <u>7 291 358</u>            | <u>1,29</u>                 |
| <b>Ingénierie et construction - 0,28 % (31 décembre 2022 : 0,28 %)</b>          |     |                           |                             |                             |
| IHS Holding Ltd, 5,625 %, 29/11/26 144A (i) (iv)                                | USD | 1 155 000                 | 1 005 312                   | 0,18                        |
| TopBuild Corp, 4,125 %, 15/02/32 144A (i)                                       | USD | 655 000                   | 558 003                     | 0,10                        |
|                                                                                 |     |                           | <u>1 563 315</u>            | <u>0,28</u>                 |
| <b>Divertissements - 0,68 % (31 décembre 2022 : 0,60 %)</b>                     |     |                           |                             |                             |
| Genm Capital Labuan Ltd, 3,882 %, 19/04/31 144A (i) (iv)                        | USD | 2 160 000                 | 1 746 597                   | 0,31                        |
| Scientific Games International Inc, 7,250 %, 15/11/29 144A (i)                  | USD | 45 000                    | 45 056                      | 0,01                        |
| Warnermedia Holdings Inc, 4,054 %, 15/03/29                                     | USD | 480 000                   | 438 778                     | 0,08                        |
| Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, 15/03/32                                     | USD | 1 790 000                 | 1 587 507                   | 0,28                        |
|                                                                                 |     |                           | <u>3 817 938</u>            | <u>0,68</u>                 |
| <b>Finance - 4,95 % (31 décembre 2022 : 4,27 %)</b>                             |     |                           |                             |                             |
| AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, 29/10/28 (iv) | USD | 1 606 000                 | 1 388 632                   | 0,25                        |
| AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, 30/01/32 (iv) | USD | 1 305 000                 | 1 067 619                   | 0,19                        |
| AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,650 %, 21/07/27 (iv) | USD | 150 000                   | 137 376                     | 0,02                        |
| AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 5,750 %, 06/06/28 (iv) | USD | 202 000                   | 200 329                     | 0,04                        |
| AGFC Capital Trust I, 7,010 %, 15/01/67 (ii)                                    | USD | 400 000                   | 204 775                     | 0,04                        |
| Air Lease Corp, 4,625 %, 01/10/28                                               | USD | 847 000                   | 796 083                     | 0,14                        |
| Air Lease Corp, 4,650 % (ii) (iii)                                              | USD | 1 890 000                 | 1 577 318                   | 0,28                        |
| Ally Financial Inc, 2,200 %, 02/11/28                                           | USD | 675 000                   | 538 727                     | 0,10                        |
| Ally Financial Inc, 4,700 % (ii) (iii)                                          | USD | 2 200 000                 | 1 551 000                   | 0,27                        |
| Ally Financial Inc, 4,700 % (ii) (iii)                                          | USD | 1 865 000                 | 1 202 925                   | 0,21                        |
| Antares Holdings LP, 3,750 %, 15/07/27 144A (i)                                 | USD | 2 070 000                 | 1 731 828                   | 0,31                        |
| Aviation Capital Group LLC, 1,950 %, 30/01/26 144A (i)                          | USD | 345 000                   | 307 281                     | 0,05                        |
| Aviation Capital Group LLC, 6,250 %, 15/04/28 144A (i)                          | USD | 780 000                   | 777 688                     | 0,14                        |
| Aviation Capital Group LLC, 6,375 %, 15/07/30 144A (i)                          | USD | 1 225 000                 | 1 214 730                   | 0,21                        |
| Jefferies Group Inc, 6,250 %, 15/01/36                                          | USD | 1 970 000                 | 2 009 229                   | 0,36                        |

|                                                                               |     | Valeur<br>Montant | Juste valeur<br>USD | % de l'actif<br>net |
|-------------------------------------------------------------------------------|-----|-------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>      |     |                   |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                   |     |                   |                     |                     |
| <b>Finance - 4,95 % (31 décembre 2022 : 4,27 %) (suite)</b>                   |     |                   |                     |                     |
| Navient Corp, 5,000 %, 15/03/27                                               | USD | 725 000           | 648 601             | 0,11                |
| Navient Corp, 5,625 %, 01/08/33                                               | USD | 730 000           | 548 960             | 0,10                |
| Navient Corp, 6,750 %, 15/06/26                                               | USD | 320 000           | 308 545             | 0,05                |
| OneMain Finance Corp, 3,500 %, 15/01/27                                       | USD | 90 000            | 77 214              | 0,01                |
| OneMain Finance Corp, 4,000 %, 15/09/30                                       | USD | 105 000           | 80 850              | 0,01                |
| OneMain Finance Corp, 5,375 %, 15/11/29                                       | USD | 230 000           | 195 534             | 0,03                |
| OneMain Finance Corp, 6,875 %, 15/03/25                                       | USD | 940 000           | 930 724             | 0,16                |
| Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 2,875 %, 15/10/26 144A (i) | USD | 4 460 000         | 3 947 100           | 0,70                |
| Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 3,625 %, 01/03/29 144A (i) | USD | 1 585 000         | 1 332 142           | 0,24                |
| Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 3,875 %, 01/03/31 144A (i) | USD | 4 030 000         | 3 267 756           | 0,58                |
| Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 4,000 %, 15/10/33 144A (i) | USD | 2 535 000         | 1 982 978           | 0,35                |
|                                                                               |     |                   | 28 025 944          | 4,95                |
| <b>Santé - 1,45 % (31 décembre 2022 : 1,16 %)</b>                             |     |                   |                     |                     |
| Alcon Finance Corp, 5,375 %, 06/12/32 144A (i)                                | USD | 575 000           | 582 659             | 0,10                |
| Centene Corp, 2,450 %, 15/07/28                                               | USD | 35 000            | 29 917              | 0,00                |
| Centene Corp, 2,500 %, 01/03/31                                               | USD | 2 315 000         | 1 846 143           | 0,33                |
| Centene Corp, 2,625 %, 01/08/31                                               | USD | 1 055 000         | 840 708             | 0,15                |
| Centene Corp, 3,000 %, 15/10/30                                               | USD | 730 000           | 608 307             | 0,11                |
| HCA Inc, 2,375 %, 15/07/31                                                    | USD | 2 150 000         | 1 719 434           | 0,30                |
| HCA Inc, 5,375 %, 01/09/26                                                    | USD | 1 390 000         | 1 378 632           | 0,24                |
| HCA Inc, 5,500 %, 01/06/33                                                    | USD | 1 225 000         | 1 222 919           | 0,22                |
|                                                                               |     |                   | 8 228 719           | 1,45                |
| <b>Constructeurs de logements - 1,05 % (31 décembre 2022 : 1,61 %)</b>        |     |                   |                     |                     |
| Beazer Homes USA Inc, 7,250 %, 15/10/29                                       | USD | 1 555 000         | 1 511 018           | 0,27                |
| MDC Holdings Inc, 6,000 %, 15/01/43                                           | USD | 3 335 000         | 3 007 973           | 0,53                |
| PulteGroup Inc, 6,375 %, 15/05/33                                             | USD | 1 385 000         | 1 433 408           | 0,25                |
|                                                                               |     |                   | 5 952 399           | 1,05                |
| <b>Assurance - 2,05 % (31 décembre 2022 : 1,78 %)</b>                         |     |                   |                     |                     |
| Athene Global Funding, 1,608 %, 29/06/26 144A (i)                             | USD | 1 625 000         | 1 389 736           | 0,24                |
| Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, 22/06/47                                  | USD | 577 000           | 441 575             | 0,08                |
| Brighthouse Financial Inc, 5,625 %, 15/05/30                                  | USD | 2 880 000         | 2 776 067           | 0,49                |
| HUB International Ltd, 7,250 %, 15/06/30 144A (i)                             | USD | 990 000           | 1 022 274           | 0,18                |
| MBIA Insurance Corp, 16,805 %, 15/01/33                                       | USD | 150 000           | 4 500               | 0,00                |
| Penn Mutual Life Insurance Co, 7,625 %, 15/06/40*                             | USD | 4 225 000         | 4 570 739           | 0,81                |
| Stewart Information Services Corp, 3,600 %, 15/11/31                          | USD | 1 845 000         | 1 416 559           | 0,25                |
|                                                                               |     |                   | 11 621 450          | 2,05                |

|                                                                                                              |     | Valeur<br>Montant | Juste valeur<br>USD | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|-------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                                     |     |                   |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                                  |     |                   |                     |                     |
| <b>Internet - 3,23 % (31 décembre 2022 : 3,06 %)</b>                                                         |     |                   |                     |                     |
| Expedia Group Inc, 2,950 %, 15/03/31                                                                         | USD | 290 000           | 244 370             | 0,04                |
| Expedia Group Inc, 3,250 %, 15/02/30                                                                         | USD | 1 125 000         | 979 144             | 0,17                |
| Netflix Inc, 4,875 %, 15/06/30 144A (i)                                                                      | USD | 2 395 000         | 2 356 904           | 0,42                |
| Netflix Inc, 5,375 %, 15/11/29 144A (i)                                                                      | USD | 295 000           | 296 093             | 0,05                |
| Netflix Inc, 5,875 %, 15/11/28                                                                               | USD | 1 460 000         | 1 507 891           | 0,27                |
| Netflix Inc, 6,375 %, 15/05/29                                                                               | USD | 1 965 000         | 2 078 970           | 0,37                |
| Uber Technologies Inc, 4,500 %, 15/08/29 144A (i)                                                            | USD | 5 945 000         | 5 471 767           | 0,97                |
| Uber Technologies Inc, 7,500 %, 15/09/27 144A (i)                                                            | USD | 5 025 000         | 5 139 836           | 0,91                |
| Uber Technologies Inc, 8,000 %, 01/11/26 144A (i)                                                            | USD | 175 000           | 178 345             | 0,03                |
|                                                                                                              |     |                   | 18 253 320          | 3,23                |
| <b>Sociétés d'investissement - 2,35 % (31 décembre 2022 : 2,98 %)</b>                                        |     |                   |                     |                     |
| Ares Capital Corp, 3,200 %, 15/11/31                                                                         | USD | 3 765 000         | 2 886 113           | 0,51                |
| Barings BDC Inc, 3,300 %, 23/11/26                                                                           | USD | 1 060 000         | 923 408             | 0,16                |
| Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 4,375 %, 01/02/29                                       | USD | 3 660 000         | 2 875 662           | 0,51                |
| Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 5,250 %, 15/05/27                                       | USD | 5 000             | 4 312               | 0,00                |
| Owl Rock Capital Corp, 4,250 %, 15/01/26                                                                     | USD | 3 140 000         | 2 904 829           | 0,52                |
| Owl Rock Technology Finance Corp, 4,750 %, 15/12/25 144A (i)                                                 | USD | 4 075 000         | 3 690 233           | 0,65                |
|                                                                                                              |     |                   | 13 284 557          | 2,35                |
| <b>Fer/Acier - 0,35 % (31 décembre 2022 : 0,10 %)</b>                                                        |     |                   |                     |                     |
| ArcelorMittal SA, 6,750 %, 01/03/41 (iv)                                                                     | USD | 590 000           | 600 439             | 0,11                |
| ArcelorMittal SA, 6,800 %, 29/11/32 (iv)                                                                     | USD | 1 355 000         | 1 391 121           | 0,24                |
|                                                                                                              |     |                   | 1 991 560           | 0,35                |
| <b>Loisirs - 1,13 % (31 décembre 2022 : 0,82 %)</b>                                                          |     |                   |                     |                     |
| Carnival Corp, 5,750 %, 01/03/27 144A (i) (iv)                                                               | USD | 1 480 000         | 1 362 473           | 0,24                |
| Carnival Corp, 6,000 %, 01/05/29 144A (i) (iv)                                                               | USD | 350 000           | 312 492             | 0,06                |
| Carnival Corp, 9,875 %, 01/08/27 144A (i) (iv)                                                               | USD | 540 000           | 562 482             | 0,10                |
| NCL Corp Ltd, 5,875 %, 15/03/26 144A (i) (iv)                                                                | USD | 1 115 000         | 1 043 153           | 0,18                |
| NCL Corp Ltd, 5,875 %, 15/02/27 144A (i) (iv)                                                                | USD | 835 000           | 811 892             | 0,14                |
| NCL Finance Ltd, 6,125 %, 15/03/28 144A (i) (iv)                                                             | USD | 410 000           | 369 008             | 0,07                |
| Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, 01/07/26 144A (i) (iv)                                                 | USD | 65 000            | 59 667              | 0,01                |
| Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,500 %, 01/04/28 144A (i) (iv)                                                 | USD | 2 010 000         | 1 874 405           | 0,33                |
|                                                                                                              |     |                   | 6 395 572           | 1,13                |
| <b>Hébergement - 0,82 % (31 décembre 2022 : 0,77 %)</b>                                                      |     |                   |                     |                     |
| Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 4,875 %, 01/07/31 144A (i)   | USD | 270 000           | 226 513             | 0,04                |
| Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 5,000 %, 01/06/2029 144A (i) | USD | 900 000           | 798 705             | 0,14                |
| Marriott International Inc, 2,850 %, 15/04/31                                                                | USD | 1 255 000         | 1 055 202           | 0,19                |
| Marriott Ownership Resorts Inc, 4,500 %, 15/06/29 144A (i)                                                   | USD | 695 000           | 599 830             | 0,10                |



|                                                                                                  |     | <u>Valeur<br/>Montant</u> | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de l'actif<br/>net</u> |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                         |     |                           |                             |                             |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                      |     |                           |                             |                             |
| <b>Hébergement - 0,82 % (31 décembre 2022 : 0,77 %) (suite)</b>                                  |     |                           |                             |                             |
| Travel + Leisure Co, 4,500 %, 01/12/29 144A (i)                                                  | USD | 1 140 000                 | 969 942                     | 0,17                        |
| Travel + Leisure Co, 4,625 %, 01/03/30 144A (i)                                                  | USD | 1 185 000                 | 1 002 806                   | 0,18                        |
|                                                                                                  |     |                           | <u>4 652 998</u>            | <u>0,82</u>                 |
| <b>Matériels divers - 0,54 % (31 décembre 2022 : 0,51 %)</b>                                     |     |                           |                             |                             |
| John Deere Capital Corp, 0,450 %, 07/06/24                                                       | USD | 2 185 000                 | 2 085 607                   | 0,37                        |
| Toro Co, 6,625 %, 01/05/37                                                                       | USD | 930 000                   | 940 443                     | 0,17                        |
|                                                                                                  |     |                           | <u>3 026 050</u>            | <u>0,54</u>                 |
| <b>Médias - 4,61 % (31 décembre 2022 : 4,33 %)</b>                                               |     |                           |                             |                             |
| CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,250 %, 15/01/34 144A (i)                           | USD | 4 150 000                 | 3 136 436                   | 0,55                        |
| Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 2,300 %, 01/02/32 | USD | 3 270 000                 | 2 475 392                   | 0,44                        |
| Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 2,800 %, 01/04/31 | USD | 3 950 000                 | 3 178 408                   | 0,56                        |
| Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 3,700 %, 01/04/51 | USD | 765 000                   | 483 387                     | 0,09                        |
| Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 3,850 %, 01/04/61 | USD | 450 000                   | 272 173                     | 0,05                        |
| Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 3,950 %, 30/06/62 | USD | 2 805 000                 | 1 725 732                   | 0,31                        |
| Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, 01/04/33 | USD | 775 000                   | 680 261                     | 0,12                        |
| Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, 01/12/61 | USD | 4 335 000                 | 2 926 345                   | 0,52                        |
| CSC Holdings LLC, 3,375 %, 15/02/31 144A (i)                                                     | USD | 740 000                   | 500 899                     | 0,09                        |
| CSC Holdings LLC, 4,125 %, 01/12/30 144A (i)                                                     | USD | 400 000                   | 279 810                     | 0,05                        |
| CSC Holdings LLC, 4,625 %, 01/12/30 144A (i)                                                     | USD | 4 935 000                 | 2 195 765                   | 0,39                        |
| CSC Holdings LLC, 5,000 %, 15/11/31 144A (i)                                                     | USD | 400 000                   | 186 283                     | 0,03                        |
| CSC Holdings LLC, 5,375 %, 01/02/28 144A (i)                                                     | USD | 2 030 000                 | 1 631 188                   | 0,29                        |
| CSC Holdings LLC, 5,750 %, 15/01/30 144A (i)                                                     | USD | 400 000                   | 188 868                     | 0,03                        |
| DISH DBS Corp, 5,125 %, 01/06/29                                                                 | USD | 1 350 000                 | 626 867                     | 0,11                        |
| DISH DBS Corp, 5,250 %, 01/12/26 144A (i)                                                        | USD | 3 630 000                 | 2 911 886                   | 0,51                        |
| DISH DBS Corp, 5,750 %, 01/12/28 144A (i)                                                        | USD | 1 205 000                 | 896 259                     | 0,16                        |
| DISH DBS Corp, 7,750 %, 01/07/26                                                                 | USD | 1 515 000                 | 928 642                     | 0,16                        |
| iHeartCommunications Inc, 5,250 %, 15/08/27 144A (i)                                             | USD | 545 000                   | 416 761                     | 0,07                        |
| Time Warner Cable LLC, 4,500 %, 15/09/42                                                         | USD | 535 000                   | 400 176                     | 0,07                        |
| Time Warner Cable LLC, 5,875 %, 15/11/40                                                         | USD | 85 000                    | 74 983                      | 0,01                        |
|                                                                                                  |     |                           | <u>26 116 521</u>           | <u>4,61</u>                 |
| <b>Exploitation minière - 1,87 % (31 décembre 2022 : 1,68 %)</b>                                 |     |                           |                             |                             |
| Anglo American Capital PLC, 2,875 %, 17/03/31 144A (i) (iv)                                      | USD | 5 650 000                 | 4 664 969                   | 0,83                        |
| Anglo American Capital PLC, 5,500 %, 02/05/33 144A (i) (iv)                                      | USD | 370 000                   | 361 488                     | 0,06                        |

|                                                                             |     | <u>Valeur<br/>Montant</u> | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de l'actif<br/>net</u> |
|-----------------------------------------------------------------------------|-----|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>    |     |                           |                             |                             |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                 |     |                           |                             |                             |
| <b>Exploitation minière - 1,87 % (31 décembre 2022 : 1,68 %) (suite)</b>    |     |                           |                             |                             |
| First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, 15/10/27 144A (i)                      | USD | 4 310 000                 | 4 204 405                   | 0,74                        |
| FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 4,375 %, 01/04/31 144A (i)               | USD | 1 575 000                 | 1 344 754                   | 0,24                        |
| (iv)                                                                        |     |                           | <u>10 575 616</u>           | <u>1,87</u>                 |
| <b>Titres municipaux - 0,18 % (31 décembre 2022 : 0,17 %)</b>               |     |                           |                             |                             |
| Tobacco Settlement Financing Corp/VA, 6,706 %, 01/06/46*                    | USD | 1 080 000                 | 1 022 156                   | 0,18                        |
|                                                                             |     |                           | <u>1 022 156</u>            | <u>0,18</u>                 |
| <b>Matériel de bureau/d'entreprise - 0,53 % (31 décembre 2022 : 0,49 %)</b> |     |                           |                             |                             |
| CDW LLC/CDW Finance Corp, 2,670 %, 01/12/26                                 | USD | 205 000                   | 184 065                     | 0,03                        |
| CDW LLC/CDW Finance Corp, 3,250 %, 15/02/29                                 | USD | 250 000                   | 214 209                     | 0,04                        |
| CDW LLC/CDW Finance Corp, 3,569 %, 01/12/31                                 | USD | 2 960 000                 | 2 497 707                   | 0,44                        |
| CDW LLC/CDW Finance Corp, 4,250 %, 01/04/28                                 | USD | 120 000                   | 110 056                     | 0,02                        |
|                                                                             |     |                           | <u>3 006 037</u>            | <u>0,53</u>                 |
| <b>Pétrole et gaz - 6,27 % (31 décembre 2022 : 5,97 %)</b>                  |     |                           |                             |                             |
| Aker BP ASA, 2,000 %, 15/07/26 144A (i) (iv)                                | USD | 949 000                   | 852 286                     | 0,15                        |
| Aker BP ASA, 3,100 %, 15/07/31 144A (i) (iv)                                | USD | 1 020 000                 | 844 074                     | 0,15                        |
| Aker BP ASA, 3,750 %, 15/01/30 144A (i) (iv)                                | USD | 2 090 000                 | 1 857 554                   | 0,33                        |
| Aker BP ASA, 4,000 %, 15/01/31 144A (i) (iv)                                | USD | 6 210 000                 | 5 522 600                   | 0,98                        |
| Bellatrix Exploration Ltd, 12,500 %, 15/12/23                               | USD | 110 000                   | 0                           | 0,00                        |
| Continental Resources Inc, 2,875 %, 01/04/32 144A (i)                       | USD | 1 595 000                 | 1 225 445                   | 0,22                        |
| Continental Resources Inc, 5,750 %, 15/01/31 144A (i)                       | USD | 5 825 000                 | 5 537 580                   | 0,98                        |
| Devon Energy Corp, 4,500 %, 15/01/30                                        | USD | 416 000                   | 391 590                     | 0,07                        |
| Enegean Israel Finance Ltd, 5,375 %, 30/03/28 144A (i) (iv)                 | USD | 1 045 000                 | 943 113                     | 0,17                        |
| Enegean Israel Finance Ltd, 5,875 %, 30/03/31 144A (i) (iv)                 | USD | 1 375 000                 | 1 201 406                   | 0,21                        |
| EQT Corp, 3,125 %, 15/05/26 144A (i)                                        | USD | 275 000                   | 252 838                     | 0,05                        |
| EQT Corp, 3,625 %, 15/05/31 144A (i)                                        | USD | 1 275 000                 | 1 096 618                   | 0,19                        |
| EQT Corp, 3,900 %, 01/10/27                                                 | USD | 1 175 000                 | 1 086 311                   | 0,19                        |
| EQT Corp, 5,000 %, 15/01/29                                                 | USD | 245 000                   | 230 665                     | 0,04                        |
| EQT Corp, 5,700 %, 01/04/28                                                 | USD | 235 000                   | 231 937                     | 0,04                        |
| EQT Corp, 6,125 %, 01/02/25                                                 | USD | 139 000                   | 138 219                     | 0,02                        |
| EQT Corp, 7,000 %, 01/02/30                                                 | USD | 760 000                   | 795 743                     | 0,14                        |
| Matador Resources Co, 6,875 %, 15/04/28 144A (i)                            | USD | 235 000                   | 232 601                     | 0,04                        |
| Mesquite Energy Inc, 6,125 %, 15/01/24 (vi)                                 | USD | 3 105 000                 | 46 575                      | 0,01                        |
| Mesquite Energy Inc, 7,750 %, 15/06/24 (vi) *                               | USD | 1 365 000                 | 20 475                      | 0,00                        |
| Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, 01/01/31                                | USD | 10 000                    | 10 154                      | 0,00                        |
| Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, 01/09/30                                | USD | 2 020 000                 | 2 098 982                   | 0,37                        |
| Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, 15/09/31                                | USD | 20 000                    | 22 296                      | 0,00                        |
| Occidental Petroleum Corp, 8,875 %, 15/07/30                                | USD | 3 415 000                 | 3 925 133                   | 0,69                        |
| Ovintiv Inc, 6,500 %, 15/08/34                                              | USD | 1 645 000                 | 1 648 542                   | 0,29                        |
| Ovintiv Inc, 6,500 %, 01/02/38                                              | USD | 90 000                    | 88 235                      | 0,02                        |

|                                                                          |     | Valeur<br>Montant | Juste valeur<br>USD | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|-------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b> |     |                   |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                              |     |                   |                     |                     |
| <b>Pétrole et gaz - 6,27 % (31 décembre 2022 : 5,97 %) (suite)</b>       |     |                   |                     |                     |
| Ovintiv Inc, 6,625 %, 15/08/37                                           | USD | 440 000           | 434 299             | 0,08                |
| Ovintiv Inc, 7,200 %, 01/11/31                                           | USD | 60 000            | 62 960              | 0,01                |
| Ovintiv Inc, 7,375 %, 01/11/31                                           | USD | 190 000           | 203 757             | 0,04                |
| Ovintiv Inc, 8,125 %, 15/09/30                                           | USD | 240 000           | 263 391             | 0,05                |
| Pertamina Persero PT, 6,450 %, 30/05/44 144A (i) (iv)                    | USD | 2 150 000         | 2 219 518           | 0,39                |
| Southwestern Energy Co, 4,750 %, 01/02/32                                | USD | 215 000           | 189 487             | 0,03                |
| Variable Energi ASA, 7,500 %, 15/01/28 144A (i) (iv)                     | USD | 515 000           | 529 281             | 0,09                |
| Variable Energi ASA, 8,000 %, 15/11/32 144A (i) (iv)                     | USD | 1 225 000         | 1 296 062           | 0,23                |
|                                                                          |     |                   | 35 499 727          | 6,27                |
| <b>Autres ABS - 0,19 % (31 décembre 2022 : 0,40 %)</b>                   |     |                   |                     |                     |
| Domino's Pizza Master Issuer LLC, 4,118 %, 25/07/47 144A (i)             | USD | 75 800            | 69 764              | 0,01                |
| MAPS Trust, 2,521 %, 15/06/46 144A (i)                                   | USD | 200 567           | 172 411             | 0,03                |
| Merlin Aviation Holdings DAC, 4,500 %, 15/12/32 144A (i) (v)             | USD | 158 271           | 141 712             | 0,02                |
| OneMain Financial Issuance Trust, 3,570 %, 14/03/33 144A (i)             | USD | 374 489           | 368 955             | 0,07                |
| Wendy's Funding LLC, 3,884 %, 15/03/48 144A (i)                          | USD | 373 275           | 337 792             | 0,06                |
|                                                                          |     |                   | 1 090 634           | 0,19                |
| <b>Emballages - 0,01 % (31 décembre 2022 : 0,01 %)</b>                   |     |                   |                     |                     |
| Sealed Air Corp, 6,875 %, 15/07/33 144A (i)                              | USD | 65 000            | 67 437              | 0,01                |
|                                                                          |     |                   | 67 437              | 0,01                |
| <b>Papier - 0,49 % (31 décembre 2022 : 0,47 %)</b>                       |     |                   |                     |                     |
| Georgia-Pacific LLC, 7,750 %, 15/11/29                                   | USD | 2 470 000         | 2 787 421           | 0,49                |
|                                                                          |     |                   | 2 787 421           | 0,49                |
| <b>Produits pharmaceutiques - 2,22 % (31 décembre 2022 : 1,49 %)</b>     |     |                   |                     |                     |
| Astrazeneca Finance LLC, 4,875 %, 03/03/28                               | USD | 1 200 000         | 1 199 309           | 0,21                |
| Bausch Health Cos Inc, 4,875 %, 01/06/28 144A (i)                        | USD | 1 195 000         | 711 264             | 0,13                |
| Bausch Health Cos Inc, 5,000 %, 30/01/28 144A (i)                        | USD | 600 000           | 255 000             | 0,04                |
| Bausch Health Cos Inc, 5,000 %, 15/02/29 144A (i)                        | USD | 60 000            | 24 740              | 0,00                |
| Bausch Health Cos Inc, 5,250 %, 30/01/30 144A (i)                        | USD | 480 000           | 199 200             | 0,04                |
| Bausch Health Cos Inc, 5,250 %, 15/02/31 144A (i)                        | USD | 415 000           | 173 420             | 0,03                |
| Bausch Health Cos Inc, 6,250 %, 15/02/29 144A (i)                        | USD | 70 000            | 29 750              | 0,01                |
| Bausch Health Cos Inc, 7,000 %, 15/01/28 144A (i)                        | USD | 110 000           | 47 562              | 0,01                |
| Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, 19/05/33 (iv)            | USD | 1 225 000         | 1 220 385           | 0,22                |
| Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, 01/02/36                    | USD | 1 020 000         | 906 442             | 0,16                |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, 15/09/29 (iv)    | EUR | 820 000           | 910 258             | 0,16                |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,875 %, 15/09/31 (iv)    | EUR | 700 000           | 788 881             | 0,14                |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, 01/10/26 (iv)   | USD | 510 000           | 456 983             | 0,08                |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, 01/10/46 (iv)   | USD | 2 820 000         | 1 853 666           | 0,33                |

|                                                                                      |     | <u>Valeur<br/>Montant</u> | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de l'actif<br/>net</u> |
|--------------------------------------------------------------------------------------|-----|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>             |     |                           |                             |                             |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                          |     |                           |                             |                             |
| <b>Pharmaceutique - 2,22 % (31 décembre 2022 : 1,49 %) (suite)</b>                   |     |                           |                             |                             |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, 09/05/27 (iv)               | USD | 1 780 000                 | 1 646 629                   | 0,29                        |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, 09/05/29 (iv)               | USD | 1 145 000                 | 1 038 630                   | 0,18                        |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,875 %, 15/09/29 (iv)               | USD | 625 000                   | 644 083                     | 0,11                        |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, 15/09/31 (iv)               | USD | 450 000                   | 471 636                     | 0,08                        |
|                                                                                      |     |                           | <u>12 577 838</u>           | <u>2,22</u>                 |
| <b>Conduites d'hydrocarbures - 1,65 % (31 décembre 2022 : 0,91 %)</b>                |     |                           |                             |                             |
| Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, 31/01/32                                       | USD | 400 000                   | 329 060                     | 0,06                        |
| Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, 01/03/31                                       | USD | 1 950 000                 | 1 716 954                   | 0,30                        |
| Cheniere Energy Partners LP, 4,500 %, 01/10/29                                       | USD | 215 000                   | 197 318                     | 0,04                        |
| Cheniere Energy Partners LP, 5,950 %, 30/06/33 144A (i)                              | USD | 655 000                   | 656 906                     | 0,12                        |
| DCP Midstream Operating LP, 3,250 %, 15/02/32                                        | USD | 1 730 000                 | 1 464 252                   | 0,26                        |
| DCP Midstream Operating LP, 5,125 %, 15/05/29                                        | USD | 205 000                   | 200 540                     | 0,04                        |
| DCP Midstream Operating LP, 6,450 %, 03/11/36 144A (i)                               | USD | 125 000                   | 128 356                     | 0,02                        |
| Energy Transfer LP, 5,750 %, 15/02/33                                                | USD | 1 475 000                 | 1 484 655                   | 0,26                        |
| EnLink Midstream LLC, 6,500 %, 01/09/30 144A (i)                                     | USD | 125 000                   | 124 862                     | 0,02                        |
| ONEOK Partners LP, 6,200 %, 15/09/43                                                 | USD | 145 000                   | 140 148                     | 0,02                        |
| Targa Resources Corp, 5,200 %, 01/07/27                                              | USD | 50 000                    | 49 089                      | 0,01                        |
| Targa Resources Corp, 6,125 %, 15/03/33                                              | USD | 670 000                   | 684 599                     | 0,12                        |
| Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, 15/01/32 | USD | 590 000                   | 511 686                     | 0,09                        |
| Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, 01/02/31 | USD | 135 000                   | 124 759                     | 0,02                        |
| Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, 01/03/30 | USD | 135 000                   | 129 920                     | 0,02                        |
| Western Midstream Operating LP, 4,300 %, 01/02/30                                    | USD | 285 000                   | 255 887                     | 0,05                        |
| Western Midstream Operating LP, 5,300 %, 01/03/48                                    | USD | 665 000                   | 555 092                     | 0,10                        |
| Western Midstream Operating LP, 5,450 %, 01/04/44                                    | USD | 120 000                   | 101 373                     | 0,02                        |
| Western Midstream Operating LP, 5,500 %, 15/08/48                                    | USD | 90 000                    | 75 264                      | 0,01                        |
| Western Midstream Operating LP, 5,500 %, 01/02/50                                    | USD | 375 000                   | 307 151                     | 0,05                        |
| Western Midstream Operating LP, 6,150 %, 01/04/33                                    | USD | 125 000                   | 125 986                     | 0,02                        |
|                                                                                      |     |                           | <u>9 363 857</u>            | <u>1,65</u>                 |
| <b>Immobilier - 0,35 % (31 décembre 2022 : 0,70 %)</b>                               |     |                           |                             |                             |
| Agile Group Holdings Ltd, 6,050 %, 13/10/25 (iv)                                     | USD | 1 030 000                 | 244 304                     | 0,04                        |
| Central China Real Estate Ltd, 7,250 %, 16/07/24 (iv)                                | USD | 820 000                   | 74 015                      | 0,01                        |
| Central China Real Estate Ltd, 7,250 %, 13/08/24 (iv)                                | USD | 200 000                   | 16 940                      | 0,00                        |
| Central China Real Estate Ltd, 7,250 %, 28/04/25 (iv)                                | USD | 200 000                   | 15 906                      | 0,00                        |
| Central China Real Estate Ltd, 7,500 %, 14/07/25 (iv)                                | USD | 200 000                   | 15 587                      | 0,00                        |
| CIFI Holdings Group Co Ltd., 6,000 %, 16/07/25 (iv)                                  | USD | 400 000                   | 44 186                      | 0,01                        |

|  |  | <b>Valeur<br/>Montant</b> | <b>Juste valeur<br/>USD</b> | <b>% de l'actif<br/>net</b> |
|--|--|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|--|--|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|

### OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)

#### OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)

##### Immobilier - 0,35 % (31 décembre 2022 : 0,70 %) (suite)

|                                                            |     |           |                  |             |
|------------------------------------------------------------|-----|-----------|------------------|-------------|
| Country Garden Holdings Co Ltd., 3,300 %, 12/01/31 (iv)    | USD | 800 000   | 219 013          | 0,04        |
| Kaisa Group Holdings Ltd, 9,375 %, 30/06/24 (iv) (vi)      | USD | 1 915 000 | 130 326          | 0,02        |
| Kaisa Group Holdings Ltd, 9,950 %, 23/07/25 (iv)           | USD | 200 000   | 13 490           | 0,00        |
| Kaisa Group Holdings Ltd, 10,500 %, 15/01/25 (iv)          | USD | 400 000   | 25 970           | 0,01        |
| Kaisa Group Holdings Ltd, 11,250 %, 16/04/25 (iv)          | USD | 2 940 000 | 191 357          | 0,04        |
| Kaisa Group Holdings Ltd, 11,700 %, 11/11/25 (iv) (vi)     | USD | 205 000   | 13 951           | 0,00        |
| Logan Group Co Ltd, 4,250 %, 12/07/25 (iv)                 | USD | 605 000   | 57 249           | 0,01        |
| Logan Group Co Ltd, 4,850 %, 14/12/26 (iv)                 | USD | 800 000   | 75 701           | 0,02        |
| Shimao Group Holdings Ltd, 3,450 %, 11/01/31 (iv)          | USD | 1 015 000 | 99 862           | 0,02        |
| Shimao Group Holdings Ltd, 5,200 %, 16/01/27 (iv)          | USD | 200 000   | 15 148           | 0,00        |
| Shimao Group Holdings Ltd, 5,600 %, 15/07/26 (iv) (vi)     | USD | 345 000   | 34 441           | 0,01        |
| Shimao Group Holdings Ltd, 6,125 %, 21/02/24 (iv)          | USD | 200 000   | 14 524           | 0,00        |
| Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 4,750 %, 05/08/29 (iv)    | USD | 405 000   | 82 960           | 0,02        |
| Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 4,750 %, 14/01/30 (iv)    | USD | 605 000   | 123 413          | 0,02        |
| Sunac China Holdings Ltd, 6,500 %, 10/01/25 (iv)           | USD | 615 000   | 99 243           | 0,02        |
| Sunac China Holdings Ltd, 6,500 %, 26/01/26 (iv)           | USD | 430 000   | 62 873           | 0,01        |
| Sunac China Holdings Ltd, 6,650 %, 03/08/24 (iv)           | USD | 205 000   | 33 374           | 0,01        |
| Sunac China Holdings Ltd, 7,000 %, 09/07/25 (iv)           | USD | 805 000   | 130 941          | 0,02        |
| Times China Holdings Ltd, 5,750 %, 14/01/27 (iv)           | USD | 200 000   | 13 264           | 0,00        |
| Times China Holdings Ltd, 6,200 %, 22/03/26 (iv)           | USD | 820 000   | 54 380           | 0,01        |
| Yuzhou Group Holdings Co Ltd., 6,350 %, 13/01/27 (iv) (vi) | USD | 410 000   | 17 090           | 0,00        |
| Yuzhou Group Holdings Co Ltd., 7,700 %, 20/02/25 (iv) (vi) | USD | 660 000   | 27 511           | 0,01        |
| Yuzhou Group Holdings Co Ltd., 7,850 %, 12/08/26 (iv) (vi) | USD | 210 000   | 8 754            | 0,00        |
| Yuzhou Group Holdings Co Ltd., 8,300 %, 27/05/25 (iv) (vi) | USD | 340 000   | 14 173           | 0,00        |
|                                                            |     |           | <b>1 969 946</b> | <b>0,35</b> |

##### REIT - 3,25 % (31 décembre 2022 : 2,89 %)

|                                                                 |     |           |           |      |
|-----------------------------------------------------------------|-----|-----------|-----------|------|
| American Homes 4 Rent LP, 2,375 %, 15/07/31                     | USD | 305 000   | 242 178   | 0,04 |
| American Tower Corp, 5,500 %, 15/03/28                          | USD | 870 000   | 863 947   | 0,15 |
| Brixmor Operating Partnership LP, 2,250 %, 01/04/28             | USD | 270 000   | 226 805   | 0,04 |
| Corporate Office Properties LP, 2,750 %, 15/04/31               | USD | 320 000   | 243 152   | 0,04 |
| Crown Castle Inc, 2,500 %, 15/07/31                             | USD | 4 870 000 | 4 000 778 | 0,71 |
| Crown Castle Inc, 5,100 %, 01/05/33                             | USD | 135 000   | 132 662   | 0,03 |
| EPR Properties, 3,600 %, 15/11/31                               | USD | 450 000   | 350 937   | 0,06 |
| Equinix Inc, 2,500 %, 15/05/31                                  | USD | 6 280 000 | 5 113 146 | 0,90 |
| GLP Capital LP/GLP Financing II Inc, 3,250 %, 15/01/32          | USD | 625 000   | 504 634   | 0,09 |
| VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,250 %, 01/12/26 144A (i) | USD | 1 085 000 | 1 014 997 | 0,18 |
| VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,500 %, 01/09/26 144A (i) | USD | 895 000   | 845 524   | 0,15 |
| VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,625 %, 15/06/25 144A (i) | USD | 770 000   | 744 009   | 0,13 |
| VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 5,625 %, 01/05/24 144A (i) | USD | 630 000   | 626 116   | 0,11 |
| Weyerhaeuser Co, 6,875 %, 15/12/33                              | USD | 340 000   | 369 395   | 0,07 |

|                                                                          |     | <u>Valeur<br/>Montant</u> | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de l'actif<br/>net</u> |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b> |     |                           |                             |                             |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                              |     |                           |                             |                             |
| <b>REIT - 3,25 % (31 décembre 2022 : 2,89 %) (suite)</b>                 |     |                           |                             |                             |
| Weyerhaeuser Co, 6,950 %, 01/10/27                                       | USD | 825 000                   | 874 637                     | 0,16                        |
| Weyerhaeuser Co, 7,375 %, 15/03/32                                       | USD | 1 989 000                 | 2 219 584                   | 0,39                        |
|                                                                          |     |                           | <u>18 372 501</u>           | <u>3,25</u>                 |
| <b>Distributeurs - 0,37 % (31 décembre 2022 : 0,10 %)</b>                |     |                           |                             |                             |
| Dillard's Inc, 7,000 %, 01/12/28                                         | USD | 200 000                   | 200 443                     | 0,04                        |
| Dillard's Inc, 7,750 %, 15/07/26                                         | USD | 130 000                   | 132 360                     | 0,02                        |
| Lithia Motors Inc, 3,875 %, 01/06/29 144A (i)                            | USD | 1 665 000                 | 1 451 098                   | 0,26                        |
| Marks & Spencer PLC, 7,125 %, 01/12/37 144A (i) (iv)                     | USD | 325 000                   | 307 517                     | 0,05                        |
|                                                                          |     |                           | <u>2 091 418</u>            | <u>0,37</u>                 |
| <b>Semi-conducteurs - 2,70 % (31 décembre 2022 : 1,91 %)</b>             |     |                           |                             |                             |
| Broadcom Inc, 2,600 %, 15/02/33 144A (i)                                 | USD | 1 665 000                 | 1 301 187                   | 0,23                        |
| Broadcom Inc, 3,137 %, 15/11/35 144A (i)                                 | USD | 615 000                   | 471 733                     | 0,08                        |
| Broadcom Inc, 4,150 %, 15/11/30                                          | USD | 885 000                   | 814 244                     | 0,14                        |
| Entegris Escrow Corp, 4,750 %, 15/04/29 144A (i)                         | USD | 2 060 000                 | 1 912 352                   | 0,34                        |
| Marvell Technology Inc, 2,450 %, 15/04/28                                | USD | 1 080 000                 | 942 928                     | 0,17                        |
| Marvell Technology Inc, 2,950 %, 15/04/31                                | USD | 920 000                   | 771 207                     | 0,14                        |
| Micron Technology Inc, 5,875 %, 09/02/33                                 | USD | 1 735 000                 | 1 726 330                   | 0,30                        |
| Micron Technology Inc, 5,875 %, 15/09/33                                 | USD | 4 690 000                 | 4 647 476                   | 0,82                        |
| Micron Technology Inc, 6,750 %, 01/11/29                                 | USD | 2 105 000                 | 2 188 129                   | 0,39                        |
| NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc, 4,400 %, 01/06/27 (iv)               | USD | 215 000                   | 207 838                     | 0,04                        |
| SK Hynix Inc, 6,375 %, 17/01/28 144A (i) (iv)                            | USD | 295 000                   | 296 235                     | 0,05                        |
|                                                                          |     |                           | <u>15 279 659</u>           | <u>2,70</u>                 |
| <b>Logiciels - 0,60 % (31 décembre 2022 : 0,63 %)</b>                    |     |                           |                             |                             |
| Open Text Corp, 6,900 %, 01/12/27 144A (i)                               | USD | 460 000                   | 468 293                     | 0,08                        |
| Oracle Corp, 3,950 %, 25/03/51                                           | USD | 2 045 000                 | 1 546 270                   | 0,27                        |
| Oracle Corp, 6,150 %, 09/11/29                                           | USD | 680 000                   | 708 266                     | 0,13                        |
| VMware Inc, 2,200 %, 15/08/31                                            | USD | 885 000                   | 695 433                     | 0,12                        |
|                                                                          |     |                           | <u>3 418 262</u>            | <u>0,60</u>                 |
| <b>Titres souverains - 20,19 % (31 décembre 2022 : 26,81 %)</b>          |     |                           |                             |                             |
| Indonesia Treasury Bond, 6,375 %, 15/08/28 (iv)*                         | IDR | 21 774 000 000            | 1 480 153                   | 0,26                        |
| Republic of South Africa Government Bond, 8,875 %, 28/02/35 (iv)         | ZAR | 30 830 000                | 1 334 953                   | 0,24                        |
| United States Treasury Bill, 5,228 %, 17/10/23                           | USD | 1 460 000                 | 1 437 487                   | 0,25                        |
| United States Treasury Bill, 5,246 %, 14/12/23                           | USD | 1 465 000                 | 1 430 447                   | 0,25                        |
| United States Treasury Bill, 5,298 %, 24/10/23                           | USD | 4 340 000                 | 4 267 783                   | 0,75                        |
| United States Treasury Bill, 5,308 %, 21/12/23                           | USD | 2 930 000                 | 2 857 205                   | 0,50                        |
| United States Treasury Bill, 5,322 %, 07/12/23                           | USD | 5 850 000                 | 5 716 084                   | 1,01                        |
| United States Treasury Bill, 5,406 %, 28/12/23                           | USD | 4 385 000                 | 4 269 609                   | 0,75                        |
| United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, 15/05/20                      | USD | 8 830 000                 | 4 965 150                   | 0,88                        |

|                                                                                     |     | <u>Valeur<br/>Montant</u> | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de l'actif<br/>net</u> |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-----|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>            |     |                           |                             |                             |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                         |     |                           |                             |                             |
| <b>Titres souverains - 20,19 % (31 décembre 2022 : 26,81 %) (suite)</b>             |     |                           |                             |                             |
| United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, 15/05/42                                 | USD | 20 625 000                | 18 404 590                  | 3,26                        |
| United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, 30/06/25                                 | USD | 68 420 000                | 68 107 299                  | 12,04                       |
|                                                                                     |     |                           | <u>114 270 760</u>          | <u>20,19</u>                |
| <b>Télécommunications - 2,40 % (31 décembre 2022 : 1,96 %)</b>                      |     |                           |                             |                             |
| Cincinnati Bell Telephone Co LLC, 6,300 %, 01/12/28                                 | USD | 40 000                    | 32 770                      | 0,01                        |
| CommScope Inc, 4,750 %, 01/09/29 144A (i)                                           | USD | 4 165 000                 | 3 283 689                   | 0,58                        |
| SoftBank Group Corp, 4,625 %, 06/07/28 (iv)                                         | USD | 810 000                   | 700 000                     | 0,12                        |
| SoftBank Group Corp, 5,250 %, 06/07/31 (iv)                                         | USD | 400 000                   | 343 143                     | 0,06                        |
| Sprint Capital Corp, 8,750 %, 15/03/32                                              | USD | 1 750 000                 | 2 115 062                   | 0,38                        |
| T-Mobile USA Inc, 2,400 %, 15/03/29                                                 | USD | 125 000                   | 107 438                     | 0,02                        |
| T-Mobile USA Inc, 2,700 %, 15/03/32                                                 | USD | 230 000                   | 189 987                     | 0,03                        |
| T-Mobile USA Inc, 3,875 %, 15/04/30                                                 | USD | 6 040 000                 | 5 564 463                   | 0,98                        |
| Telecom Italia Capital SA, 6,375 %, 15/11/33 (iv)                                   | USD | 1 487 000                 | 1 261 437                   | 0,22                        |
|                                                                                     |     |                           | <u>13 597 989</u>           | <u>2,40</u>                 |
| <b>Services de transport - 0,01 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                   |     |                           |                             |                             |
| Rand Parent LLC, 8,500 %, 15/02/30 144A (i)                                         | USD | 90 000                    | 81 489                      | 0,01                        |
|                                                                                     |     |                           | <u>81 489</u>               | <u>0,01</u>                 |
| <b>Camionnage &amp; leasing - 0,41 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                |     |                           |                             |                             |
| GATX Corp, 5,450 %, 15/09/33                                                        | USD | 1 470 000                 | 1 446 327                   | 0,26                        |
| SMBC Aviation Capital Finance DAC, 5,450 %, 03/05/28 144A (i) (iv)                  | USD | 885 000                   | 872 962                     | 0,15                        |
|                                                                                     |     |                           | <u>2 319 289</u>            | <u>0,41</u>                 |
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES</b>                                       |     |                           | <b>502 090 505</b>          | <b>88,71</b>                |
| <b>OBLIGATIONS CONVERTIBLES - 5,17 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 5,05 %)</b> |     |                           |                             |                             |
| <b>Compagnies aériennes - 0,46 % (31 décembre 2022 : 0,45 %)</b>                    |     |                           |                             |                             |
| JetBlue Airways Corp, 0,500 %, 01/04/26                                             | USD | 605 000                   | 496 859                     | 0,09                        |
| Southwest Airlines Co, 1,250 %, 01/05/25                                            | USD | 1 855 000                 | 2 126 757                   | 0,37                        |
|                                                                                     |     |                           | <u>2 623 616</u>            | <u>0,46</u>                 |
| <b>Biotechnologie - 0,59 % (31 décembre 2022 : 0,59 %)</b>                          |     |                           |                             |                             |
| BioMarin Pharmaceutical Inc, 0,599 %, 01/08/24                                      | USD | 1 190 000                 | 1 168 899                   | 0,21                        |
| BioMarin Pharmaceutical Inc, 1,250 %, 15/05/27                                      | USD | 1 520 000                 | 1 528 063                   | 0,27                        |
| Livongo Health Inc, 0,875 %, 01/06/25                                               | USD | 690 000                   | 623 346                     | 0,11                        |
|                                                                                     |     |                           | <u>3 320 308</u>            | <u>0,59</u>                 |
| <b>Électricité - 0,23 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                             |     |                           |                             |                             |
| PPL Capital Funding Inc, 2,875 %, 15/03/28 144A (i)                                 | USD | 1 365 000                 | 1 303 575                   | 0,23                        |
|                                                                                     |     |                           | <u>1 303 575</u>            | <u>0,23</u>                 |
| <b>Loisirs - 0,07 % (31 décembre 2022 : 0,08 %)</b>                                 |     |                           |                             |                             |
| Penn Entertainment Inc, 2,750 %, 15/05/26                                           | USD | 345 000                   | 427 455                     | 0,07                        |
|                                                                                     |     |                           | <u>427 455</u>              | <u>0,07</u>                 |

|                                                                                |     | <u>Valeur<br/>Montant</u> | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de l'actif<br/>net</u> |
|--------------------------------------------------------------------------------|-----|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>       |     |                           |                             |                             |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                    |     |                           |                             |                             |
| <b>Santé - 0,55 % (31 décembre 2022 : 0,51 %)</b>                              |     |                           |                             |                             |
| Teladoc Health Inc, 1,250 %, 01/06/27                                          | USD | 3 910 000                 | 3 108 450                   | 0,55                        |
|                                                                                |     |                           | <u>3 108 450</u>            | <u>0,55</u>                 |
| <b>Internet - 0,55 % (31 décembre 2022 : 0,49 %)</b>                           |     |                           |                             |                             |
| Snap Inc, Zero Coupon Bond, 01/05/27                                           | USD | 900 000                   | 666 000                     | 0,12                        |
| Spotify USA Inc, Zero Coupon Bond, 15/03/26                                    | USD | 800 000                   | 679 600                     | 0,12                        |
| Uber Technologies Inc, Zero Coupon Bond, 15/12/25                              | USD | 1 945 000                 | 1 783 010                   | 0,31                        |
|                                                                                |     |                           | <u>3 128 610</u>            | <u>0,55</u>                 |
| <b>Loisirs - 0,20 % (31 décembre 2022 : 0,23 %)</b>                            |     |                           |                             |                             |
| NCL Corp Ltd., 1,125 %, 15/02/27 (iv)                                          | USD | 1 085 000                 | 997 853                     | 0,18                        |
| Peloton Interactive Inc, Zero Coupon Bond, 15/02/26                            | USD | 165 000                   | 125 132                     | 0,02                        |
|                                                                                |     |                           | <u>1 122 985</u>            | <u>0,20</u>                 |
| <b>Médias - 2,22 % (31 décembre 2022 : 2,39 %)</b>                             |     |                           |                             |                             |
| DISH Network Corp, 2,375 %, 15/03/24                                           | USD | 6 970 000                 | 6 177 163                   | 1,09                        |
| DISH Network Corp, 3,375 %, 15/08/26                                           | USD | 12 556 000                | 6 372 170                   | 1,13                        |
|                                                                                |     |                           | <u>12 549 333</u>           | <u>2,22</u>                 |
| <b>Logiciels - 0,30 % (31 décembre 2022 : 0,31 %)</b>                          |     |                           |                             |                             |
| Splunk Inc, 1,125 %, 15/06/27                                                  | USD | 745 000                   | 642 562                     | 0,11                        |
| Unity Software Inc, Zero Coupon Bond, 15/11/26                                 | USD | 1 325 000                 | 1 058 013                   | 0,19                        |
|                                                                                |     |                           | <u>1 700 575</u>            | <u>0,30</u>                 |
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS CONVERTIBLES</b>                                      |     |                           | <b>29 284 907</b>           | <b>5,17</b>                 |
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES<br/>OBLIGATIONS À MOYEN TERME</b> |     |                           | <b>531 375 412</b>          | <b>93,88</b>                |

|                                                                                                  |     | <u>Actions</u> | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de l'actif<br/>net</u> |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>ACTIONS PRIVILÉGIÉES NON CONVERTIBLES - 0,07 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 0,07 %)</b> |     |                |                             |                             |
| <b>Constructeurs de logements - 0,00 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                           |     |                |                             |                             |
| Hovnanian Enterprises Inc, 7,625 % (iii)                                                         | USD | 598            | 10 695                      | 0,00                        |
|                                                                                                  |     |                | <u>10 695</u>               | <u>0,00</u>                 |
| <b>REIT - 0,07 % (31 décembre 2022 : 0,07 %)</b>                                                 |     |                |                             |                             |
| Highwoods Properties Inc, 8,625 % (iii)                                                          | USD | 74             | 70 832                      | 0,01                        |
| Prologis Inc, 8,540 % (iii)*                                                                     | USD | 5 429          | 307 390                     | 0,06                        |
|                                                                                                  |     |                | <u>378 222</u>              | <u>0,07</u>                 |
| <b>TOTAL DES ACTIONS PRIVILÉGIÉES NON CONVERTIBLES</b>                                           |     |                | <b>388 917</b>              | <b>0,07</b>                 |



NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                                                                                                                 |     | Actions | Juste valeur<br>USD       | % de l'actif<br>net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|---------|---------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES - 0,99 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 1,76 %)</b>                                                                    |     |         |                           |                     |
| <b>Activités bancaires - 0,73 % (31 décembre 2022 : 0,70 %)</b>                                                                                                 |     |         |                           |                     |
| Bank of America Corp, 7,250 % (iii)                                                                                                                             | USD | 2 286   | 2 678 780                 | 0,47                |
| Wells Fargo & Co, 7,500 % (iii)                                                                                                                                 | USD | 1 255   | 1 445 760                 | 0,26                |
|                                                                                                                                                                 |     |         | <u>4 124 540</u>          | <u>0,73</u>         |
| <b>Conduites d'hydrocarbures - 0,12 % (31 décembre 2022 : 0,57 %)</b>                                                                                           |     |         |                           |                     |
| El Paso Energy Capital Trust I, 4,750 % 31/03/28                                                                                                                | USD | 14 377  | 667 812                   | 0,12                |
|                                                                                                                                                                 |     |         | <u>667 812</u>            | <u>0,12</u>         |
| <b>Logiciels - 0,14 % (31 décembre 2022 : 0,12 %)</b>                                                                                                           |     |         |                           |                     |
| Clarivate PLC, 5,250 % 01/06/24                                                                                                                                 | USD | 19 335  | 795 829                   | 0,14                |
|                                                                                                                                                                 |     |         | <u>795 829</u>            | <u>0,14</u>         |
| <b>TOTAL DES ACTIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES</b>                                                                                                              |     |         | <b>5 588 181</b>          | <b>0,99</b>         |
| <b>ACTIONS ORDINAIRES – 0,49 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 0,28 %)</b>                                                                                   |     |         |                           |                     |
| <b>Services commerciaux - 0,00 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                                                                                                |     |         |                           |                     |
| Clarivate PLC                                                                                                                                                   | USD | 894     | 8 520                     | 0,00                |
|                                                                                                                                                                 |     |         | <u>8 520</u>              | <u>0,00</u>         |
| <b>Médias - 0,11 % (31 décembre 2022 : 0,16 %)</b>                                                                                                              |     |         |                           |                     |
| Altice USA Inc                                                                                                                                                  | USD | 207 260 | 625 925                   | 0,11                |
|                                                                                                                                                                 |     |         | <u>625 925</u>            | <u>0,11</u>         |
| <b>Pétrole et gaz - 0,38 % (31 décembre 2022 : 0,01 %)</b>                                                                                                      |     |         |                           |                     |
| Battalion Oil Corp                                                                                                                                              | USD | 8 641   | 49 340                    | 0,01                |
| Diamondback Energy Inc                                                                                                                                          | USD | 9 633   | 1 265 391                 | 0,22                |
| EOG Resources Inc                                                                                                                                               | USD | 4 710   | 539 013                   | 0,10                |
| Pioneer Natural Resources Co                                                                                                                                    | USD | 1 335   | 276 585                   | 0,05                |
|                                                                                                                                                                 |     |         | <u>2 130 329</u>          | <u>0,38</u>         |
| <b>TOTAL DES ACTIONS ORDINAIRES</b>                                                                                                                             |     |         | <b>2 764 774</b>          | <b>0,49</b>         |
| <b>FONDS D'INVESTISSEMENT : 2,06 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 2,08 %)</b>                                                                               |     |         |                           |                     |
| <b>Services commerciaux - 2,06 % (31 décembre 2022 : 2,08 %)</b>                                                                                                |     |         |                           |                     |
| Loomis Sayles Asia Bond Plus Fund (iv)                                                                                                                          | USD | 1 640   | 11 658 727                | 2,06                |
|                                                                                                                                                                 |     |         | <u>11 658 727</u>         | <u>2,06</u>         |
| <b>TOTAL DES FONDS D'INVESTISSEMENT</b>                                                                                                                         |     |         | <b>11 658 727</b>         | <b>2,06</b>         |
| <b>TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR<br/>PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS<br/>INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS<br/>(Coût : 636 589 181 USD)</b> |     |         |                           |                     |
|                                                                                                                                                                 |     |         | <u><b>551 776 011</b></u> | <u><b>97,49</b></u> |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS – 0,02 % (31 décembre 2022 : (0,08 %))

## Contrats de change à terme en cours - (0,03 %) (31 décembre 2022 : 0,00 %)

| Échéance                                                                                  | Montant acheté | Montant vendu  | Contrepartie            | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente<br>USD | % de<br>l'actif net |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|----------------|-------------------------|------------------------------------------------|---------------------|
| 20/09/23                                                                                  | 1 543 375 USD  | 1 425 000 EUR  | Bank of America         | (17 424)                                       | (0,00 %)            |
| 31/07/23                                                                                  | 21 880 962 EUR | 23 995 933 USD | Brown Brothers Harriman | (90 542)                                       | (0,02 %)            |
| 31/07/23                                                                                  | 28 174 470 SGD | 20 866 129 USD | Brown Brothers Harriman | (26 762)                                       | (0,01 %)            |
| 31/07/23                                                                                  | 4 021 825 EUR  | 4 410 567 USD  | Brown Brothers Harriman | (16 642)                                       | (0,00 %)            |
| 31/07/23                                                                                  | 2 892 432 EUR  | 3 172 008 USD  | Brown Brothers Harriman | (11 969)                                       | (0,00 %)            |
| 31/07/23                                                                                  | 1 947 464 EUR  | 2 135 702 USD  | Brown Brothers Harriman | (8 058)                                        | (0,00 %)            |
| 31/07/23                                                                                  | 4 189 589 SGD  | 3 102 827 USD  | Brown Brothers Harriman | (3 980)                                        | (0,00 %)            |
| 31/07/23                                                                                  | 760 167 EUR    | 833 643 USD    | Brown Brothers Harriman | (3 145)                                        | (0,00 %)            |
| 31/07/23                                                                                  | 516 374 EUR    | 566 286 USD    | Brown Brothers Harriman | (2 137)                                        | (0,00 %)            |
| 31/07/23                                                                                  | 13 654 USD     | 20 624 AUD     | Brown Brothers Harriman | (86)                                           | (0,00 %)            |
| 31/07/23                                                                                  | 6 752 CHF      | 7 560 USD      | Brown Brothers Harriman | 8                                              | 0,00 %              |
| 31/07/23                                                                                  | 413 587 USD    | 558 859 SGD    | Brown Brothers Harriman | 224                                            | 0,00 %              |
| 31/07/23                                                                                  | 851 937 AUD    | 565 771 USD    | Brown Brothers Harriman | 1 794                                          | 0,00 %              |
| 31/07/23                                                                                  | 1 450 834 GBP  | 1 842 472 USD  | Brown Brothers Harriman | 2 420                                          | 0,00 %              |
| <b>Contrats de change à terme en cours - (0,03 %) (31 décembre 2022 : 0,00 %) (suite)</b> |                |                |                         |                                                |                     |
| Plus-value latente sur les contrats de change à terme en cours                            |                |                |                         | 4 446                                          | 0,00 %              |
| Moins-value latente sur les contrats de change à terme en cours                           |                |                |                         | (180 745)                                      | (0,03 %)            |
| <b>Perte latente nette sur les contrats de change à terme en cours</b>                    |                |                |                         | <b>(176 299)</b>                               | <b>(0,03 %)</b>     |

## Contrats à terme normalisés - 0,05 % (31 décembre 2022 : (0,08 %))

| Nombre de<br>contrats | Libellé                                    | Contrepartie | Engagement | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | % de l'actif<br>net |
|-----------------------|--------------------------------------------|--------------|------------|-----------------------------------------|---------------------|
| (143)                 | US 10 Year Ultra September<br>2023 Futures | JP Morgan    | 17 027 540 | 90 977                                  | 0,02 %              |
| 111                   | US 2 Year Note September 2023<br>Futures   | JP Morgan    | 22 830 869 | (259 712)                               | (0,05 %)            |
| 108                   | US 5 Year Note September 2023<br>Futures   | JP Morgan    | 11 732 559 | (166 434)                               | (0,03 %)            |
| 70                    | US 10 Year Note September 2023<br>Futures  | JP Morgan    | 7 950 472  | (91 879)                                | (0,02 %)            |

|                                       |                        |
|---------------------------------------|------------------------|
| <b>Calendrier des investissements</b> | <b>Au 30 juin 2023</b> |
|---------------------------------------|------------------------|

| Nombre de<br>contrats                                                                                                                | Libellé                                | Contrepartie | Engagement | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | % de l'actif<br>net         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|--------------|------------|-----------------------------------------|-----------------------------|
| 184                                                                                                                                  | US Long Bond September 2023<br>Futures | JP Morgan    | 23 214 264 | 136 486                                 | 0,02 %                      |
| 275                                                                                                                                  | US Ultra Bond March 2023<br>Futures    | JP Morgan    | 36 837 479 | 622 678                                 | 0,11 %                      |
| Plus-value latente sur les contrats à terme normalisés                                                                               |                                        |              |            | 850 141                                 | 0,15 %                      |
| Moins-value latente sur les contrats à terme normalisés                                                                              |                                        |              |            | (518 025)                               | (0,10 %)                    |
| <b>Plus-value nette latente sur contrats à terme normalisés</b>                                                                      |                                        |              |            | <b>332 116</b>                          | <b>0,05 %</b>               |
|                                                                                                                                      |                                        |              |            | <b>Juste valeur<br/>USD</b>             | <b>% de l'actif<br/>net</b> |
| <b>Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat</b>                                       |                                        |              |            | <b>552 630 598</b>                      | <b>97,63</b>                |
| <b>Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat</b>                                        |                                        |              |            | <b>(698 770)</b>                        | <b>(0,12)</b>               |
| <b>TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE<br/>VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT<br/>ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS</b> |                                        |              |            | <b>551 931 828</b>                      | <b>97,51</b>                |
| Avoirs nets en banque                                                                                                                |                                        |              |            | (13 175 122)                            | (2,33)                      |
| Autres actifs                                                                                                                        |                                        |              |            | 30 031 524                              | 5,31                        |
| Moins autres passifs                                                                                                                 |                                        |              |            | (2 791 322)                             | (0,49)                      |
| <b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D' ACTIONS<br/>PARTICIPANTES REMBOURSABLES</b>                                               |                                        |              |            | <b>565 996 908</b>                      | <b>100,00</b>               |

- (i) Titres exempts d'enregistrement en vertu de la Rule 144A (i) de la Loi américaine sur les valeurs mobilières Securities Act de 1933. Ces titres peuvent être revendus dans le cadre d'opérations exemptes d'enregistrement, normalement à des acheteurs institutionnels qualifiés.
- (ii) Indique un titre à taux variable. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2023.
- (iii) Obligations perpétuelles.
- (iv) Titres émis par des émetteurs non américains ou non canadiens.
- (v) Indique un titre à coupon progressif. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2023.
- (vi) Titre en défaut.
- \* Titres non cotés.

Autres informations :

Sauf indication contraire, tous les titres à long terme mentionnés ci-dessus sont négociés sur des marchés réglementés.

#### Abréviations

|       |                     |
|-------|---------------------|
| AUD : | Dollar australien   |
| CHF : | Franc suisse        |
| EUR : | Euro                |
| GBP : | Livre sterling      |
| IDR : | Roupie indonésienne |
| SGD : | Dollar de Singapour |
| USD : | Dollar américain    |
| ZAR : | Rand sud-africain   |

| Calendrier des investissements                                                                                                         | Au 30 juin 2023    |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|
| Analyse de l'actif total                                                                                                               | % de l'actif total |
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle                                                      | 44,10              |
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé                                                | 47,26              |
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire autres que ceux admis à une cote officielle ou négociés sur un marché réglementé | 3,42               |
| Instruments financiers dérivés                                                                                                         | 0,03               |
| Actif circulant                                                                                                                        | 5,19               |
|                                                                                                                                        | <u>100,00</u>      |

|                                                                                                                        |     | <u>Valeur<br/>nominale</u> | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de<br/>l'actif net</u> |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME –<br/>97,54 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 94,57 %)</b> |     |                            |                             |                             |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 92,50 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 88,95 %)</b>                              |     |                            |                             |                             |
| <b>Publicité - 0,18 % (31 décembre 2022 : 0,18 %)</b>                                                                  |     |                            |                             |                             |
| Stagwell Global LLC, 5,625 %, 15/08/29 144A (i)                                                                        | USD | 15 000                     | 12 911                      | 0,18                        |
|                                                                                                                        |     |                            | <u>12 911</u>               | <u>0,18</u>                 |
| <b>Aérospatiale/Défense - 2,01 % (31 décembre 2022 : 2,12 %)</b>                                                       |     |                            |                             |                             |
| Bombardier Inc, 6,000 %, 15/02/28 144A (i)                                                                             | USD | 10 000                     | 9 451                       | 0,14                        |
| Bombardier Inc, 7,125 %, 15/06/26 144A (i)                                                                             | USD | 35 000                     | 34 764                      | 0,49                        |
| TransDigm Inc, 4,875 %, 01/05/29                                                                                       | USD | 20 000                     | 17 865                      | 0,25                        |
| TransDigm Inc, 5,500 %, 15/11/27                                                                                       | USD | 5 000                      | 4 716                       | 0,07                        |
| TransDigm Inc, 6,250 %, 15/03/26                                                                                       | USD | 15 000                     | 14 927                      | 0,21                        |
| TransDigm Inc, 6,250 %, 15/03/26 144A (i)                                                                              | USD | 20 000                     | 19 902                      | 0,28                        |
| TransDigm Inc, 6,750 %, 15/08/28 144A (i)                                                                              | USD | 40 000                     | 40 152                      | 0,57                        |
|                                                                                                                        |     |                            | <u>141 777</u>              | <u>2,01</u>                 |
| <b>Compagnies aériennes - 1,45 % (31 décembre 2022 : 1,28 %)</b>                                                       |     |                            |                             |                             |
| Allegiant Travel Co, 7,250 %, 15/08/27 144A (i)                                                                        | USD | 10 000                     | 9 963                       | 0,14                        |
| American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5,750 %, 20/04/29 144A (i) (ii)                                      | USD | 95 000                     | 92 243                      | 1,31                        |
|                                                                                                                        |     |                            | <u>102 206</u>              | <u>1,45</u>                 |
| <b>Habillement - 0,06 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                                                                |     |                            |                             |                             |
| Crocs Inc, 4,125 %, 15/08/31 144A (i)                                                                                  | USD | 5 000                      | 4 037                       | 0,06                        |
|                                                                                                                        |     |                            | <u>4 037</u>                | <u>0,06</u>                 |
| <b>Automobile - 2,30 % (31 décembre 2022 : 1,96 %)</b>                                                                 |     |                            |                             |                             |
| Allison Transmission Inc, 4,750 %, 01/10/27 144A (i)                                                                   | USD | 25 000                     | 23 558                      | 0,33                        |
| Dana Inc, 4,250 %, 01/09/30                                                                                            | USD | 5 000                      | 4 163                       | 0,06                        |
| Ford Motor Co, 4,346 %, 08/12/26                                                                                       | USD | 55 000                     | 53 156                      | 0,76                        |
| General Motors Financial Co Inc, 5,700 % (iii) (iv)                                                                    | USD | 25 000                     | 21 946                      | 0,31                        |
| General Motors Financial Co Inc, 5,750 % (iii) (iv)                                                                    | USD | 45 000                     | 36 619                      | 0,52                        |
| General Motors Financial Co Inc, 6,500 % (iii) (iv)                                                                    | USD | 20 000                     | 17 092                      | 0,24                        |
| Real Hero Merger Sub 2 Inc, 6,250 %, 01/02/29 144A (i)                                                                 | USD | 5 000                      | 4 100                       | 0,06                        |
| Wheel Pros Inc, 6,500 %, 15/05/29 144A (i)                                                                             | USD | 5 000                      | 1 507                       | 0,02                        |
|                                                                                                                        |     |                            | <u>162 141</u>              | <u>2,30</u>                 |
| <b>Matériaux de construction - 0,85 % (31 décembre 2022 : 0,66 %)</b>                                                  |     |                            |                             |                             |
| Builders FirstSource Inc, 4,250 %, 01/02/32 144A (i)                                                                   | USD | 5 000                      | 4 351                       | 0,06                        |
| Builders FirstSource Inc, 5,000 %, 01/03/30 144A (i)                                                                   | USD | 10 000                     | 9 350                       | 0,13                        |
| Camelot Return Merger Sub Inc, 8,750 %, 01/08/28 144A (i)                                                              | USD | 15 000                     | 14 175                      | 0,20                        |
| MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp, 5,500 %, 01/02/30 144A (i)                                                       | USD | 10 000                     | 8 250                       | 0,12                        |
| Standard Industries Inc, 4,375 %, 15/07/30 144A (i)                                                                    | USD | 10 000                     | 8 661                       | 0,12                        |
| Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp, 5,250 %, 15/01/29 144A (i)                                         | USD | 5 000                      | 4 724                       | 0,07                        |
| Victors Merger Corp, 6,375 %, 15/05/29 144A (i)                                                                        | USD | 15 000                     | 10 200                      | 0,15                        |
|                                                                                                                        |     |                            | <u>59 711</u>               | <u>0,85</u>                 |

|                                                                                                  |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                         |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                      |     |                    |                     |                     |
| <b>Chimie - 0,55 % (31 décembre 2022 : 0,25 %)</b>                                               |     |                    |                     |                     |
| Ashland Inc, 3,375 %, 01/09/31 144A (i)                                                          | USD | 5 000              | 3 994               | 0,06                |
| ASP Unifrax Holdings Inc, 5,250 %, 30/09/28 144A (i)                                             | USD | 25 000             | 18 048              | 0,25                |
| Chemours Co, 4,625 %, 15/11/29 144A (i)                                                          | USD | 20 000             | 16 902              | 0,24                |
|                                                                                                  |     |                    | 38 944              | 0,55                |
| <b>Services commerciaux - 1,62 % (31 décembre 2022 : 1,40 %)</b>                                 |     |                    |                     |                     |
| ADT Security Corp, 4,125 %, 01/08/29 144A (i)                                                    | USD | 45 000             | 38 869              | 0,55                |
| Block Inc, 2,750 %, 01/06/26                                                                     | USD | 15 000             | 13 657              | 0,20                |
| Gartner Inc, 3,750 %, 01/10/30 144A (i)                                                          | USD | 20 000             | 17 418              | 0,25                |
| Neptune Bidco US Inc, 9,290 %, 15/04/29 144A (i)                                                 | USD | 30 000             | 27 540              | 0,39                |
| Paysafe Finance PLC/Paysafe Holdings US Corp, 4,000 %, 15/06/29 144A (i) (ii)                    | USD | 10 000             | 7 861               | 0,11                |
| Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 3,375 %, 31/08/27 144A (i)               | USD | 5 000              | 4 410               | 0,06                |
| Sabre GBLB Inc, 11,250 %, 15/12/27 144A (i)                                                      | USD | 5 000              | 4 238               | 0,06                |
|                                                                                                  |     |                    | 113 993             | 1,62                |
| <b>Ordinateurs - 1,26 % (31 décembre 2022 : 0,57 %)</b>                                          |     |                    |                     |                     |
| NCR Corp, 5,000 %, 01/10/28 144A (i)                                                             | USD | 40 000             | 35 697              | 0,51                |
| Presidio Holdings Inc, 8,250 %, 01/02/28 144A (i)                                                | USD | 10 000             | 9 521               | 0,13                |
| Seagate HDD Cayman, 4,091 %, 01/06/29 (ii)                                                       | USD | 15 000             | 13 196              | 0,19                |
| Seagate HDD Cayman, 4,750 %, 01/01/25 (ii)                                                       | USD | 20 000             | 19 712              | 0,28                |
| Seagate HDD Cayman, 8,250 %, 15/12/29 144A (i) (ii)                                              | USD | 10 000             | 10 445              | 0,15                |
|                                                                                                  |     |                    | 88 571              | 1,26                |
| <b>Cosmétiques/soins personnels - 0,20 % (31 décembre 2022 : 0,31 %)</b>                         |     |                    |                     |                     |
| Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC, 4,750 %, 15/01/29 144A (i) | USD | 15 000             | 13 830              | 0,20                |
|                                                                                                  |     |                    | 13 830              | 0,20                |
| <b>Distribution/commerce de gros - 0,35 % (31 décembre 2022 : 0,09 %)</b>                        |     |                    |                     |                     |
| Resideo Funding Inc, 4,000 %, 01/09/29 144A (i)                                                  | USD | 30 000             | 24 888              | 0,35                |
|                                                                                                  |     |                    | 24 888              | 0,35                |
| <b>Électricité - 1,77 % (31 décembre 2022 : 1,53 %)</b>                                          |     |                    |                     |                     |
| Calpine Corp, 4,500 %, 15/02/28 144A (i)                                                         | USD | 40 000             | 36 213              | 0,51                |
| Calpine Corp, 5,250 %, 01/06/26 144A (i)                                                         | USD | 10 000             | 9 657               | 0,14                |
| Clearway Energy Operating LLC, 3,750 %, 15/02/31 144A (i)                                        | USD | 20 000             | 16 597              | 0,24                |
| Pattern Energy Operations LP/Pattern Energy Operations Inc, 4,500 %, 15/08/28 144A (i)           | USD | 5 000              | 4 567               | 0,06                |
| PG&E Corp, 5,000 %, 01/07/28                                                                     | USD | 15 000             | 13 764              | 0,20                |
| Talen Energy Supply LLC, 8,625 %, 01/06/30 144A (i)                                              | USD | 5 000              | 5 175               | 0,07                |
| Vistra Operations Co LLC, 3,550 %, 15/07/24 144A (i)                                             | USD | 40 000             | 38 632              | 0,55                |
|                                                                                                  |     |                    | 124 605             | 1,77                |

|                                                                                   |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>          |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                       |     |                    |                     |                     |
| <b>Composantes et équipement électriques - 0,55 % (31 décembre 2022 : 0,29 %)</b> |     |                    |                     |                     |
| Energizer Holdings Inc, 4,375 %, 31/03/29 144A (i)                                | USD | 45 000             | 38 777              | 0,55                |
|                                                                                   |     |                    | <u>38 777</u>       | <u>0,55</u>         |
| <b>Électronique - 0,70 % (31 décembre 2022 : 0,25 %)</b>                          |     |                    |                     |                     |
| Sensata Technologies BV, 5,000 %, 01/10/25 144A (i) (ii)                          | USD | 20 000             | 19 581              | 0,28                |
| Sensata Technologies Inc, 3,750 %, 15/02/31 144A (i)                              | USD | 35 000             | 29 942              | 0,42                |
|                                                                                   |     |                    | <u>49 523</u>       | <u>0,70</u>         |
| <b>Ingénierie et construction - 0,13 % (31 décembre 2022 : 0,16 %)</b>            |     |                    |                     |                     |
| Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 6,000 %, 01/02/26 144A (i)           | USD | 10 000             | 9 469               | 0,13                |
|                                                                                   |     |                    | <u>9 469</u>        | <u>0,13</u>         |
| <b>Divertissements - 2,05 % (31 décembre 2022 : 2,02 %)</b>                       |     |                    |                     |                     |
| Caesars Entertainment Inc, 6,250 %, 01/07/25 144A (i)                             | USD | 15 000             | 14 930              | 0,21                |
| Cinemark USA Inc, 5,250 %, 15/07/28 144A (i)                                      | USD | 10 000             | 8 796               | 0,12                |
| Everi Holdings Inc, 5,000 %, 15/07/29 144A (i)                                    | USD | 5 000              | 4 379               | 0,06                |
| Scientific Games International Inc, 7,000 %, 15/05/28 144A (i)                    | USD | 50 000             | 49 733              | 0,71                |
| Scientific Games International Inc, 7,250 %, 15/11/29 144A (i)                    | USD | 35 000             | 35 044              | 0,50                |
| SeaWorld Parks & Entertainment Inc, 5,250 %, 15/08/29 144A (i)                    | USD | 10 000             | 8 951               | 0,13                |
| Speedway Motorsports LLC/Speedway Funding II Inc, 4,875 %, 01/11/27 144A (i)      | USD | 15 000             | 13 840              | 0,20                |
| Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, 15/03/32                                       | USD | 10 000             | 8 869               | 0,12                |
|                                                                                   |     |                    | <u>144 542</u>      | <u>2,05</u>         |
| <b>Gestion de l'environnement - 0,93 % (31 décembre 2022 : 0,43 %)</b>            |     |                    |                     |                     |
| Clean Harbors Inc, 6,375 %, 01/02/31 144A (i)                                     | USD | 5 000              | 5 031               | 0,07                |
| Covanta Holding Corp, 4,875 %, 01/12/29 144A (i)                                  | USD | 40 000             | 34 600              | 0,49                |
| GFL Environmental Inc, 4,000 %, 01/08/28 144A (i)                                 | USD | 20 000             | 17 881              | 0,25                |
| Madison IAQ LLC, 5,875 %, 30/06/29 144A (i)                                       | USD | 10 000             | 8 099               | 0,12                |
|                                                                                   |     |                    | <u>65 611</u>       | <u>0,93</u>         |
| <b>Finance - 5,22 % (31 décembre 2022 : 4,95 %)</b>                               |     |                    |                     |                     |
| Aircastle Ltd, 5,250 % 144A (i) (ii) (iii) (iv)                                   | USD | 5 000              | 3 489               | 0,05                |
| Ally Financial Inc, 5,750 %, 20/11/25                                             | USD | 25 000             | 24 077              | 0,34                |
| Cobra AcquisitionCo LLC, 6,375 %, 01/11/29 144A (i)                               | USD | 10 000             | 7 050               | 0,10                |
| Coinbase Global Inc, 3,375 %, 01/10/28 144A (i)                                   | USD | 5 000              | 3 344               | 0,05                |
| Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6,500 %, 15/09/24 144A (i) (ii)                   | USD | 15 725             | 14 394              | 0,21                |
| Home Point Capital Inc, 5,000 %, 01/02/26 144A (i)                                | USD | 15 000             | 13 449              | 0,19                |
| Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5,125 %, 15/12/30 144A (i)                      | USD | 10 000             | 8 112               | 0,12                |
| Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5,750 %, 15/11/31 144A (i)                      | USD | 50 000             | 41 072              | 0,58                |
| Nationstar Mortgage Holdings Inc, 6,000 %, 15/01/27 144A (i)                      | USD | 5 000              | 4 651               | 0,07                |
| Navient Corp, 4,875 %, 15/03/28                                                   | USD | 15 000             | 12 845              | 0,18                |
| Navient Corp, 5,625 %, 01/08/33                                                   | USD | 35 000             | 26 320              | 0,37                |
| OneMain Finance Corp, 3,500 %, 15/01/27                                           | USD | 10 000             | 8 579               | 0,12                |
| OneMain Finance Corp, 4,000 %, 15/09/30                                           | USD | 25 000             | 19 250              | 0,27                |

|                                                                                                            |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                                   |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                                |     |                    |                     |                     |
| <b>Finance - 5,22 % (31 décembre 2022 : 4,95 %) (suite)</b>                                                |     |                    |                     |                     |
| OneMain Finance Corp, 5,375 %, 15/11/29                                                                    | USD | 5 000              | 4 251               | 0,06                |
| OneMain Finance Corp, 6,125 %, 15/03/24                                                                    | USD | 5 000              | 4 983               | 0,07                |
| OneMain Finance Corp, 7,125 %, 15/03/26                                                                    | USD | 35 000             | 34 387              | 0,49                |
| <b>Finance - 5,22 % (31 décembre 2022 : 4,95 %) (suite)</b>                                                |     |                    |                     |                     |
| Provident Funding Associates LP/PFG Finance Corp, 6,375 %, 15/06/25 144A (i)                               | USD | 20 000             | 17 600              | 0,25                |
| Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 2,875 %, 15/10/26 144A (i)                              | USD | 20 000             | 17 700              | 0,25                |
| Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 3,875 %, 01/03/31 144A (i)                              | USD | 10 000             | 8 109               | 0,12                |
| Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 4,000 %, 15/10/33 144A (i)                              | USD | 120 000            | 93 869              | 1,33                |
|                                                                                                            |     |                    | 367 531             | 5,22                |
| <b>Alimentation - 1,74 % (31 décembre 2022 : 2,06 %)</b>                                                   |     |                    |                     |                     |
| Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 3,250 %, 15/03/26 144A (i)                | USD | 5 000              | 4 618               | 0,06                |
| Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 4,625 %, 15/01/27 144A (i)                | USD | 35 000             | 33 163              | 0,47                |
| Lamb Weston Holdings Inc, 4,125 %, 31/01/30 144A (i)                                                       | USD | 10 000             | 8 937               | 0,13                |
| Lamb Weston Holdings Inc, 4,375 %, 31/01/32 144A (i)                                                       | USD | 15 000             | 13 399              | 0,19                |
| Lamb Weston Holdings Inc, 4,875 %, 15/05/28 144A (i)                                                       | USD | 10 000             | 9 577               | 0,14                |
| Performance Food Group Inc, 4,250 %, 01/08/29 144A (i)                                                     | USD | 15 000             | 13 355              | 0,19                |
| Performance Food Group Inc, 5,500 %, 15/10/27 144A (i)                                                     | USD | 10 000             | 9 635               | 0,14                |
| Post Holdings Inc, 4,625 %, 15/04/30 144A (i)                                                              | USD | 25 000             | 21 909              | 0,31                |
| Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 4,625 %, 01/03/29 144A (i) | USD | 10 000             | 8 012               | 0,11                |
|                                                                                                            |     |                    | 122 605             | 1,74                |
| <b>Services alimentaires - 0,07 % (31 décembre 2022 : 0,11 %)</b>                                          |     |                    |                     |                     |
| Aramark Services Inc, 5,000 %, 01/02/28 144A (i)                                                           | USD | 5 000              | 4 713               | 0,07                |
|                                                                                                            |     |                    | 4 713               | 0,07                |
| <b>Santé - 3,10 % (31 décembre 2022 : 2,72 %)</b>                                                          |     |                    |                     |                     |
| AHP Health Partners Inc, 5,750 %, 15/07/29 144A (i)                                                        | USD | 10 000             | 8 622               | 0,12                |
| Centene Corp, 2,450 %, 15/07/28                                                                            | USD | 30 000             | 25 643              | 0,37                |
| CHS/Community Health Systems Inc, 5,250 %, 15/05/30 144A (i)                                               | USD | 40 000             | 31 509              | 0,45                |
| DaVita Inc, 3,750 %, 15/02/31 144A (i)                                                                     | USD | 40 000             | 31 981              | 0,45                |
| Encompass Health Corp, 4,750 %, 01/02/30                                                                   | USD | 25 000             | 22 763              | 0,32                |
| Garden Spinco Corp, 8,625 %, 20/07/30 144A (i)                                                             | USD | 10 000             | 10 747              | 0,15                |
| Hologic Inc, 3,250 %, 15/02/29 144A (i)                                                                    | USD | 5 000              | 4 375               | 0,06                |
| Hologic Inc, 4,625 %, 01/02/28 144A (i)                                                                    | USD | 10 000             | 9 405               | 0,13                |
| LifePoint Health Inc, 5,375 %, 15/01/29 144A (i)                                                           | USD | 30 000             | 17 720              | 0,25                |
| Medline Borrower LP, 3,875 %, 01/04/29 144A (i)                                                            | USD | 15 000             | 13 036              | 0,19                |
| Molina Healthcare Inc, 3,875 %, 15/05/32 144A (i)                                                          | USD | 15 000             | 12 575              | 0,18                |
| Molina Healthcare Inc, 4,375 %, 15/06/28 144A (i)                                                          | USD | 15 000             | 13 828              | 0,20                |



|                                                                                          |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                 |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                              |     |                    |                     |                     |
| <b>Santé - 3,10 % (31 décembre 2022 : 2,72 %) (suite)</b>                                |     |                    |                     |                     |
| RP Escrow Issuer LLC, 5,250 %, 15/12/25 144A (i)                                         | USD | 10 000             | 7 377               | 0,11                |
| US Acute Care Solutions LLC, 6,375 %, 01/03/26 144A (i)                                  | USD | 10 000             | 8 562               | 0,12                |
|                                                                                          |     |                    | <u>218 143</u>      | <u>3,10</u>         |
| <b>Ameublement - 0,12 % (31 décembre 2022 : 0,14 %)</b>                                  |     |                    |                     |                     |
| Tempur Sealy International Inc, 3,875 %, 15/10/31 144A (i)                               | USD | 10 000             | 8 147               | 0,12                |
|                                                                                          |     |                    | <u>8 147</u>        | <u>0,12</u>         |
| <b>Articles ménagers - 0,33 % (31 décembre 2022 : 0,33 %)</b>                            |     |                    |                     |                     |
| Newell Brands Inc, 4,700 %, 01/04/26                                                     | USD | 25 000             | 23 484              | 0,33                |
|                                                                                          |     |                    | <u>23 484</u>       | <u>0,33</u>         |
| <b>Assurance - 1,70 % (31 décembre 2022 : 0,90 %)</b>                                    |     |                    |                     |                     |
| Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc, 4,250 %, 15/02/29 144A (i)                            | USD | 20 000             | 17 264              | 0,25                |
| Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc, 6,000 %, 01/08/29 144A (i)                            | USD | 15 000             | 12 987              | 0,19                |
| Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 4,250 %, 15/10/27 144A (i) | USD | 5 000              | 4 487               | 0,06                |
| AmWINS Group Inc, 4,875 %, 30/06/29 144A (i)                                             | USD | 15 000             | 13 545              | 0,19                |
| AssuredPartners Inc, 5,625 %, 15/01/29 144A (i)                                          | USD | 10 000             | 8 655               | 0,12                |
| BroadStreet Partners Inc, 5,875 %, 15/04/29 144A (i)                                     | USD | 10 000             | 8 675               | 0,12                |
| HUB International Ltd, 7,250 %, 15/06/30 144A (i)                                        | USD | 20 000             | 20 652              | 0,29                |
| Liberty Mutual Group Inc, 4,300 %, 01/02/61 144A (i)                                     | USD | 30 000             | 18 790              | 0,27                |
| USI Inc, 6,875 %, 01/05/2025 144A (i)                                                    | USD | 15 000             | 14 888              | 0,21                |
|                                                                                          |     |                    | <u>119 943</u>      | <u>1,70</u>         |
| <b>Internet - 3,84 % (31 décembre 2022 : 3,81 %)</b>                                     |     |                    |                     |                     |
| ANGI Group LLC, 3,875 %, 15/08/28 144A (i)                                               | USD | 10 000             | 8 165               | 0,12                |
| Arches Buyer Inc, 4,250 %, 01/06/28 144A (i)                                             | USD | 15 000             | 13 053              | 0,19                |
| Arches Buyer Inc, 6,125 %, 01/12/28 144A (i)                                             | USD | 5 000              | 4 309               | 0,06                |
| Gen Digital Inc, 6,750 %, 30/09/27 144A (i)                                              | USD | 15 000             | 14 958              | 0,21                |
| Match Group Holdings II LLC, 5,000 %, 15/12/27 144A (i)                                  | USD | 5 000              | 4 637               | 0,07                |
| Newfold Digital Holdings Group Inc, 6,000 %, 15/02/29 144A (i)                           | USD | 45 000             | 33 756              | 0,48                |
| Uber Technologies Inc, 4,500 %, 15/08/29 144A (i)                                        | USD | 190 000            | 174 876             | 2,48                |
| Uber Technologies Inc, 7,500 %, 15/09/27 144A (i)                                        | USD | 5 000              | 5 114               | 0,07                |
| Ziff Davis Inc, 4,625 %, 15/10/30 144A (i)                                               | USD | 13 000             | 11 260              | 0,16                |
|                                                                                          |     |                    | <u>270 128</u>      | <u>3,84</u>         |
| <b>Sociétés d'investissement - 1,44 % (31 décembre 2022 : 1,35 %)</b>                    |     |                    |                     |                     |
| Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 4,375 %, 01/02/29                   | USD | 30 000             | 23 571              | 0,34                |
| Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 5,250 %, 15/05/27                   | USD | 90 000             | 77 616              | 1,10                |
|                                                                                          |     |                    | <u>101 187</u>      | <u>1,44</u>         |
| <b>Fer/Acier - 0,72 % (31 décembre 2022 : 0,82 %)</b>                                    |     |                    |                     |                     |
| ATI Inc, 4,875 %, 01/10/29                                                               | USD | 10 000             | 9 002               | 0,13                |
| ATI Inc, 5,875 %, 01/12/2027                                                             | USD | 10 000             | 9 678               | 0,14                |

|                                                                                                              |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                                     |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                                  |     |                    |                     |                     |
| <b>Fer/Acier - 0,72 % (31 décembre 2022 : 0,82 %) (suite)</b>                                                |     |                    |                     |                     |
| Commercial Metals Co, 4,125 %, 15/01/30                                                                      | USD | 15 000             | 13 349              | 0,19                |
| Mineral Resources Ltd, 8,125 %, 01/05/27 144A (i) (ii)                                                       | USD | 15 000             | 15 002              | 0,21                |
| United States Steel Corp, 6,875 %, 01/03/29                                                                  | USD | 4 000              | 3 956               | 0,05                |
|                                                                                                              |     |                    | <u>50 987</u>       | <u>0,72</u>         |
| <b>Loisirs - 4,30 % (31 décembre 2022 : 2,85 %)</b>                                                          |     |                    |                     |                     |
| Carnival Corp, 5,750 %, 01/03/27 144A (i) (ii)                                                               | USD | 55 000             | 50 632              | 0,72                |
| Carnival Corp, 9,875 %, 01/08/27 144A (i) (ii)                                                               | USD | 25 000             | 26 041              | 0,37                |
| NCL Corp Ltd, 5,875 %, 15/03/26 144A (i) (ii)                                                                | USD | 70 000             | 65 490              | 0,93                |
| NCL Finance Ltd, 6,125 %, 15/03/28 144A (i) (ii)                                                             | USD | 5 000              | 4 500               | 0,06                |
| Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700 %, 15/03/28 (ii)                                                          | USD | 15 000             | 13 037              | 0,19                |
| Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, 01/07/26 144A (i) (ii)                                                 | USD | 40 000             | 36 718              | 0,52                |
| Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,500 %, 01/04/28 144A (i) (ii)                                                 | USD | 65 000             | 60 615              | 0,86                |
| Viking Cruises Ltd, 5,875 %, 15/09/27 144A (i) (ii)                                                          | USD | 10 000             | 9 191               | 0,13                |
| Viking Cruises Ltd, 7,000 %, 15/02/29 144A (i) (ii)                                                          | USD | 5 000              | 4 650               | 0,07                |
| Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 5,625 %, 15/02/29 144A (i) (ii)                                           | USD | 25 000             | 22 875              | 0,32                |
| VOC Escrow Ltd, 5,000 %, 15/02/28 144A (i) (ii)                                                              | USD | 10 000             | 9 175               | 0,13                |
|                                                                                                              |     |                    | <u>302 924</u>      | <u>4,30</u>         |
| <b>Hébergement - 3,51 % (31 décembre 2022 : 3,19 %)</b>                                                      |     |                    |                     |                     |
| Boyd Gaming Corp, 4,750 %, 15/06/31 144A (i)                                                                 | USD | 60 000             | 53 601              | 0,76                |
| Hilton Domestic Operating Co Inc, 3,625 %, 15/02/32 144A (i)                                                 | USD | 45 000             | 37 518              | 0,53                |
| Hilton Domestic Operating Co Inc, 3,750 %, 01/05/29 144A (i)                                                 | USD | 5 000              | 4 438               | 0,06                |
| Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 4,875 %, 01/07/31 144A (i)   | USD | 15 000             | 12 584              | 0,18                |
| Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 5,000 %, 01/06/2029 144A (i) | USD | 30 000             | 26 624              | 0,38                |
| Marriott Ownership Resorts Inc, 4,500 %, 15/06/29 144A (i)                                                   | USD | 65 000             | 56 099              | 0,80                |
| Marriott Ownership Resorts Inc, 4,750 %, 15/01/28                                                            | USD | 5 000              | 4 500               | 0,06                |
| Travel + Leisure Co, 4,625 %, 01/03/30 144A (i)                                                              | USD | 10 000             | 8 463               | 0,12                |
| Travel + Leisure Co, 6,000 %, 01/04/27                                                                       | USD | 45 000             | 43 681              | 0,62                |
|                                                                                                              |     |                    | <u>247 508</u>      | <u>3,51</u>         |
| <b>Matériels divers - 0,52 % (31 décembre 2022 : 0,12 %)</b>                                                 |     |                    |                     |                     |
| Chart Industries Inc, 7,500 %, 01/01/30 144A (i)                                                             | USD | 10 000             | 10 203              | 0,15                |
| GrafTech Finance Inc, 4,625 %, 15/12/28 144A (i)                                                             | USD | 20 000             | 16 250              | 0,23                |
| GrafTech Global Enterprises Inc, 9,875 %, 15/12/28 144A (i)                                                  | USD | 10 000             | 9 922               | 0,14                |
|                                                                                                              |     |                    | <u>36 375</u>       | <u>0,52</u>         |
| <b>Médias - 7,91 % (31 décembre 2022 : 7,82 %)</b>                                                           |     |                    |                     |                     |
| CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,250 %, 01/02/31 144A (i)                                       | USD | 50 000             | 40 392              | 0,57                |
| CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,250 %, 15/01/34 144A (i)                                       | USD | 60 000             | 45 346              | 0,64                |
| CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, 15/08/30 144A (i)                                       | USD | 65 000             | 54 125              | 0,77                |

|                                                                                          |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                 |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                              |     |                    |                     |                     |
| <b>Médias - 7,91 % (31 décembre 2022 : 7,82 %) (suite)</b>                               |     |                    |                     |                     |
| CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 5,000 %, 01/02/28 144A (i)                   | USD | 60 000             | 54 665              | 0,78                |
| CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 5,125 %, 01/05/27 144A (i)                   | USD | 35 000             | 32 594              | 0,46                |
| CSC Holdings LLC, 4,625 %, 01/12/30 144A (i)                                             | USD | 225 000            | 100 111             | 1,42                |
| Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co, 5,375 %, 15/08/26 144A (i) (v)       | USD | 30 000             | 1 013               | 0,01                |
| Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co, 6,625 %, 15/08/27 144A (i) (v)       | USD | 15 000             | 377                 | 0,01                |
| Directv Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor Inc, 5,875 %, 15/08/27 144A (i)       | USD | 60 000             | 54 338              | 0,77                |
| DISH DBS Corp, 5,125 %, 01/06/29                                                         | USD | 50 000             | 23 217              | 0,33                |
| DISH DBS Corp, 5,750 %, 01/12/28 144A (i)                                                | USD | 15 000             | 11 157              | 0,16                |
| DISH DBS Corp, 7,375 %, 01/07/28                                                         | USD | 40 000             | 21 400              | 0,30                |
| DISH DBS Corp, 7,750 %, 01/07/26                                                         | USD | 40 000             | 24 519              | 0,35                |
| iHeartCommunications Inc, 4,750 %, 15/01/28 144A (i)                                     | USD | 60 000             | 45 233              | 0,64                |
| iHeartCommunications Inc, 6,375 %, 01/05/26                                              | USD | 30 000             | 25 178              | 0,36                |
| Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc, 6,500 %, 15/09/28 144A (i)                       | USD | 20 000             | 11 671              | 0,17                |
| Sirius XM Radio Inc, 3,875 %, 01/09/31 144A (i)                                          | USD | 15 000             | 11 599              | 0,17                |
|                                                                                          |     |                    | 556 935             | 7,91                |
| <b>Exploitation minière - 0,51 % (31 décembre 2022 : 2,66 %)</b>                         |     |                    |                     |                     |
| Novelis Corp, 4,750 %, 30/01/30 144A (i)                                                 | USD | 40 000             | 35 548              | 0,51                |
|                                                                                          |     |                    | 35 548              | 0,51                |
| <b>Pétrole et gaz - 10,19 % (31 décembre 2022 : 8,46 %)</b>                              |     |                    |                     |                     |
| Antero Resources Corp, 5,375 %, 01/03/30 144A (i)                                        | USD | 15 000             | 13 886              | 0,20                |
| Apache Corp, 4,750 %, 15/04/43                                                           | USD | 10 000             | 7 350               | 0,10                |
| Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 7,000 %, 01/11/26 144A (i)         | USD | 25 000             | 24 192              | 0,34                |
| Baytex Energy Corp, 8,500 %, 30/04/30 144A (i)                                           | USD | 5 000              | 4 883               | 0,07                |
| Baytex Energy Corp, 8,750 %, 01/04/27 144A (i)                                           | USD | 30 000             | 30 380              | 0,43                |
| Bellatrix Exploration Ltd, 12,500 %, 15/12/23                                            | USD | 7 000              | 0                   | 0,00                |
| Callon Petroleum Co, 7,500 %, 15/06/30 144A (i)                                          | USD | 5 000              | 4 719               | 0,07                |
| Callon Petroleum Co, 8,000 %, 01/08/28 144A (i)                                          | USD | 10 000             | 9 889               | 0,14                |
| Calumet Specialty Products Partners LP/Calumet Finance Corp, 11,000 %, 15/04/25 144A (i) | USD | 3 000              | 3 101               | 0,04                |
| Chesapeake Energy Corp, 5,500 %, 01/02/26 144A (i)                                       | USD | 35 000             | 34 124              | 0,48                |
| Chesapeake Energy Corp, 6,750 %, 15/04/29 144A (i)                                       | USD | 5 000              | 4 961               | 0,07                |
| Chord Energy Corp, 6,375 %, 01/06/26 144A (i)                                            | USD | 5 000              | 4 957               | 0,07                |
| Civitas Resources Inc, 8,375 %, 01/07/28 144A (i)                                        | USD | 25 000             | 25 283              | 0,36                |
| Comstock Resources Inc, 6,750 %, 01/03/29 144A (i)                                       | USD | 10 000             | 9 149               | 0,13                |
| Continental Resources Inc, 2,875 %, 01/04/32 144A (i)                                    | USD | 40 000             | 30 732              | 0,44                |
| Continental Resources Inc, 4,900 %, 01/06/44                                             | USD | 15 000             | 11 656              | 0,17                |

|                                                                            |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>   |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                |     |                    |                     |                     |
| <b>Pétrole et gaz - 10,19 % (31 décembre 2022 : 8,46 %) (suite)</b>        |     |                    |                     |                     |
| Continental Resources Inc, 5,750 %, 15/01/31 144A (i)                      | USD | 20 000             | 19 013              | 0,27                |
| Crescent Energy Finance LLC, 7,250 %, 01/05/26 144A (i)                    | USD | 10 000             | 9 385               | 0,13                |
| CVR Energy Inc, 5,250 %, 15/02/25 144A (i)                                 | USD | 25 000             | 24 104              | 0,34                |
| Energean Israel Finance Ltd, 4,875 %, 30/03/26 144A (i) (ii)               | USD | 20 000             | 18 555              | 0,26                |
| EQT Corp, 3,900 %, 01/10/27                                                | USD | 25 000             | 23 113              | 0,33                |
| Gulfport Energy Corp, 8,000 %, 17/05/26 144A (i)                           | USD | 5 000              | 5 024               | 0,07                |
| Matador Resources Co, 5,875 %, 15/09/26                                    | USD | 20 000             | 19 381              | 0,27                |
| Matador Resources Co, 6,875 %, 15/04/28 144A (i)                           | USD | 15 000             | 14 847              | 0,21                |
| Mesquite Energy Inc, 6,125 %, 15/01/24                                     | USD | 420 000            | 6 300               | 0,09                |
| Murphy Oil Corp, 5,875 %, 01/12/42                                         | USD | 15 000             | 12 465              | 0,18                |
| Northern Oil & Gas Inc, 8,125 %, 01/03/28 144A (i)                         | USD | 30 000             | 29 400              | 0,42                |
| Northern Oil & Gas Inc, 8,750 %, 15/06/31 144A (i)                         | USD | 5 000              | 4 913               | 0,07                |
| Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, 15/03/46                               | USD | 40 000             | 41 182              | 0,58                |
| Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, 01/09/30                               | USD | 10 000             | 10 391              | 0,15                |
| Occidental Petroleum Corp, 7,500 %, 01/05/31                               | USD | 5 000              | 5 459               | 0,08                |
| Occidental Petroleum Corp, 8,875 %, 15/07/30                               | USD | 30 000             | 34 481              | 0,49                |
| Parkland Corp, 4,500 %, 01/10/29 144A (i)                                  | USD | 20 000             | 17 350              | 0,25                |
| Parkland Corp, 4,625 %, 01/05/30 144A (i)                                  | USD | 25 000             | 21 676              | 0,31                |
| Permian Resources Operating LLC, 5,375 %, 15/01/26 144A (i)                | USD | 5 000              | 4 754               | 0,07                |
| Permian Resources Operating LLC, 5,875 %, 01/07/29 144A (i)                | USD | 5 000              | 4 710               | 0,07                |
| Permian Resources Operating LLC, 6,875 %, 01/04/27 144A (i)                | USD | 30 000             | 29 550              | 0,42                |
| Petrobras Global Finance BV, 6,500 %, 03/07/33 (ii)                        | USD | 10 000             | 9 785               | 0,14                |
| Precision Drilling Corp, 6,875 %, 15/01/29 144A (i)                        | USD | 5 000              | 4 518               | 0,06                |
| Range Resources Corp, 8,250 %, 15/01/29                                    | USD | 10 000             | 10 412              | 0,15                |
| SM Energy Co, 5,625 %, 01/06/25                                            | USD | 10 000             | 9 772               | 0,14                |
| SM Energy Co, 6,750 %, 15/09/26                                            | USD | 10 000             | 9 747               | 0,14                |
| Southwestern Energy Co, 5,375 %, 01/02/29                                  | USD | 5 000              | 4 708               | 0,07                |
| Strathcona Resources Ltd, 6,875 %, 01/08/26 144A (i)                       | USD | 20 000             | 17 508              | 0,25                |
| Sunoco LP/Sunoco Finance Corp, 4,500 %, 15/05/29                           | USD | 5 000              | 4 436               | 0,06                |
| Tap Rock Resources LLC, 7,000 %, 01/10/26 144A (i)                         | USD | 5 000              | 5 150               | 0,07                |
| Transocean Poseidon Ltd, 6,875 %, 01/02/27 144A (i) (ii)                   | USD | 56 875             | 56 093              | 0,80                |
| Transocean Titan Financing Ltd, 8,375 %, 01/02/28 144A (i) (ii)            | USD | 10 000             | 10 213              | 0,14                |
|                                                                            |     |                    | <u>717 657</u>      | <u>10,19</u>        |
| <b>Services pétroliers et gaziers - 0,22 % (31 décembre 2022 : 0,60 %)</b> |     |                    |                     |                     |
| Weatherford International Ltd, 8,625 %, 30/04/30 144A (i) (ii)             | USD | 15 000             | 15 229              | 0,22                |
|                                                                            |     |                    | <u>15 229</u>       | <u>0,22</u>         |
| <b>Emballages - 0,33 % (31 décembre 2022 : 0,10 %)</b>                     |     |                    |                     |                     |
| Graham Packaging Co Inc, 7,125 %, 15/08/28 144A (i)                        | USD | 5 000              | 4 269               | 0,06                |
| LABL Inc, 5,875 %, 01/11/28 144A (i)                                       | USD | 10 000             | 9 095               | 0,13                |
| Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US, 6,125 %, 01/02/28 144A (i)             | USD | 10 000             | 9 926               | 0,14                |
|                                                                            |     |                    | <u>23 290</u>       | <u>0,33</u>         |

|                                                                                              |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                     |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                  |     |                    |                     |                     |
| <b>Produits pharmaceutiques - 3,69 % (31 décembre 2022 : 3,76 %)</b>                         |     |                    |                     |                     |
| AdaptHealth LLC, 5,125 %, 01/03/30 144A (i)                                                  | USD | 25 000             | 20 250              | 0,29                |
| Bausch Health Cos Inc, 4,875 %, 01/06/28 144A (i)                                            | USD | 70 000             | 41 664              | 0,59                |
| Bausch Health Cos Inc, 5,250 %, 30/01/30 144A (i)                                            | USD | 40 000             | 16 600              | 0,23                |
| Bausch Health Cos Inc, 6,125 %, 01/02/27 144A (i)                                            | USD | 15 000             | 9 603               | 0,14                |
| Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco Inc, 6,000 %, 30/06/28 144A (i) (ii) (v)                | USD | 15 000             | 823                 | 0,01                |
| Endo Luxembourg Finance Co I Sarl/Endo US Inc, 6,125 %, 01/04/29 144A (i) (ii) (v)           | USD | 5 000              | 3 700               | 0,05                |
| HLF Financing Sarl LLC/Herbalife International Inc, 4,875 %, 01/06/29 144A (i)               | USD | 5 000              | 3 564               | 0,05                |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, 01/10/26 (ii)                       | USD | 80 000             | 71 684              | 1,02                |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, 01/10/46 (ii)                       | USD | 140 000            | 92 026              | 1,31                |
|                                                                                              |     |                    | <u>259 914</u>      | <u>3,69</u>         |
| <b>Conduites d'hydrocarbures - 5,47 % (31 décembre 2022 : 4,49 %)</b>                        |     |                    |                     |                     |
| Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp, 5,375 %, 15/06/29 144A (i)       | USD | 10 000             | 9 292               | 0,13                |
| Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp, 7,875 %, 15/05/26 144A (i)       | USD | 5 000              | 5 071               | 0,07                |
| Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp, 7,625 %, 15/12/25 144A (i)                 | USD | 30 000             | 30 326              | 0,43                |
| Buckeye Partners LP, 5,600 %, 15/10/44                                                       | USD | 10 000             | 7 200               | 0,10                |
| Buckeye Partners LP, 5,850 %, 15/11/43                                                       | USD | 5 000              | 3 700               | 0,05                |
| Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, 01/03/31                                               | USD | 15 000             | 13 207              | 0,19                |
| Crestwood Midstream Partners LP/Crestwood Midstream Finance Corp, 6,000 %, 01/02/29 144A (i) | USD | 15 000             | 14 006              | 0,20                |
| EnLink Midstream LLC, 6,500 %, 01/09/30 144A (i)                                             | USD | 10 000             | 9 989               | 0,14                |
| EnLink Midstream Partners LP, 5,050 %, 01/04/45                                              | USD | 5 000              | 3 989               | 0,06                |
| EnLink Midstream Partners LP, 5,450 %, 01/06/47                                              | USD | 15 000             | 12 330              | 0,17                |
| Enterprise Products Operating LLC, 5,250 %, 16/08/77 (iii)                                   | USD | 5 000              | 4 372               | 0,06                |
| EQM Midstream Partners LP, 5,500 %, 15/07/28                                                 | USD | 10 000             | 9 462               | 0,13                |
| EQM Midstream Partners LP, 6,500 %, 01/07/27 144A (i)                                        | USD | 35 000             | 34 519              | 0,49                |
| EQM Midstream Partners LP, 7,500 %, 01/06/27 144A (i)                                        | USD | 20 000             | 20 191              | 0,29                |
| Hess Midstream Operations LP, 4,250 %, 15/02/30 144A (i)                                     | USD | 25 000             | 21 813              | 0,31                |
| Hess Midstream Operations LP, 5,125 %, 15/06/28 144A (i)                                     | USD | 15 000             | 14 038              | 0,20                |
| Hess Midstream Operations LP, 5,625 %, 15/02/26                                              | USD | 20 000             | 19 675              | 0,28                |
| Hess Midstream Operations LP, 5,625 %, 15/02/26 144A (i)                                     | USD | 15 000             | 14 756              | 0,21                |
| Holly Energy Partners LP/Holly Energy Finance Corp, 5,000 %, 01/02/28 144A (i)               | USD | 10 000             | 9 225               | 0,13                |
| Holly Energy Partners LP/Holly Energy Finance Corp, 6,375 %, 15/04/27 144A (i)               | USD | 10 000             | 9 878               | 0,14                |
| Kinetik Holdings LP, 5,875 %, 15/06/30 144A (i)                                              | USD | 15 000             | 14 257              | 0,20                |
| NuStar Logistics LP, 5,750 %, 01/10/25                                                       | USD | 10 000             | 9 750               | 0,14                |

|                                                                                      |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>             |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                          |     |                    |                     |                     |
| <b>Conduites d'hydrocarbures – 5,47 % (31 décembre 2022 : 4,49 %) (suite)</b>        |     |                    |                     |                     |
| Targa Resources Corp, 6,125 %, 15/03/33                                              | USD | 30 000             | 30 654              | 0,44                |
| Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp, 6,875 %, 15/01/29 | USD | 5 000              | 5 100               | 0,07                |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC, 3,875 %, 01/11/33 144A (i)                        | USD | 35 000             | 28 661              | 0,41                |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4,125 %, 15/08/31 144A (i)                        | USD | 10 000             | 8 600               | 0,12                |
| Western Midstream Operating LP, 4,750 %, 15/08/28                                    | USD | 5 000              | 4 746               | 0,07                |
| Western Midstream Operating LP, 5,300 %, 01/03/48                                    | USD | 10 000             | 8 347               | 0,12                |
| Western Midstream Operating LP, 5,500 %, 01/02/50                                    | USD | 10 000             | 8 191               | 0,12                |
|                                                                                      |     |                    | 385 345             | 5,47                |
| <b>Immobilier - 0,16 % (31 décembre 2022 : 0,17 %)</b>                               |     |                    |                     |                     |
| Realogy Group LLC/Realogy Co.-Issuer Corp, 5,750 %, 15/01/29 144A (i)                | USD | 15 000             | 11 223              | 0,16                |
|                                                                                      |     |                    | 11 223              | 0,16                |
| <b>REIT - 2,40 % (31 décembre 2022 : 2,36 %)</b>                                     |     |                    |                     |                     |
| Iron Mountain Inc, 4,500 %, 15/02/31 144A (i)                                        | USD | 10 000             | 8 592               | 0,12                |
| Iron Mountain Inc, 4,875 %, 15/09/29 144A (i)                                        | USD | 40 000             | 35 806              | 0,51                |
| Iron Mountain Inc, 5,250 %, 15/07/30 144A (i)                                        | USD | 10 000             | 9 011               | 0,13                |
| MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, 3,500 %, 15/03/31                     | USD | 15 000             | 10 335              | 0,15                |
| SBA Communications Corp, 3,125 %, 01/02/29                                           | USD | 5 000              | 4 238               | 0,06                |
| SBA Communications Corp, 3,875 %, 15/02/27                                           | USD | 10 000             | 9 212               | 0,13                |
| Service Properties Trust, 3,950 %, 15/01/28                                          | USD | 5 000              | 3 916               | 0,05                |
| Service Properties Trust, 7,500 %, 15/09/25                                          | USD | 25 000             | 24 550              | 0,35                |
| Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 4,750 %, 15/04/28 144A (i)   | USD | 20 000             | 16 598              | 0,23                |
| VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,250 %, 01/12/26 144A (i)                      | USD | 45 000             | 42 097              | 0,60                |
| VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 5,625 %, 01/05/24 144A (i)                      | USD | 5 000              | 4 969               | 0,07                |
|                                                                                      |     |                    | 169 324             | 2,40                |
| <b>Distributeurs - 4,84 % (31 décembre 2022 : 3,52 %)</b>                            |     |                    |                     |                     |
| 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 3,500 %, 15/02/29 144A (i)                       | USD | 5 000              | 4 385               | 0,06                |
| 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 3,875 %, 15/01/28 144A (i)                       | USD | 65 000             | 59 421              | 0,84                |
| Asbury Automotive Group Inc, 4,500 %, 01/03/28                                       | USD | 10 000             | 9 168               | 0,13                |
| Asbury Automotive Group Inc, 4,625 %, 15/11/29 144A (i)                              | USD | 35 000             | 31 067              | 0,44                |
| Bath & Body Works Inc, 5,250 %, 01/02/28                                             | USD | 5 000              | 4 754               | 0,07                |
| Bath & Body Works Inc, 6,625 %, 01/10/30 144A (i)                                    | USD | 5 000              | 4 827               | 0,07                |
| Bath & Body Works Inc, 6,875 %, 01/11/35                                             | USD | 5 000              | 4 575               | 0,07                |
| Bloomin' Brands Inc/OSI Restaurant Partners LLC, 5,125 %, 15/04/29 144A (i)          | USD | 10 000             | 8 936               | 0,13                |
| Ferrellgas LP/Ferrellgas Finance Corp, 5,375 %, 01/04/26 144A (i)                    | USD | 15 000             | 13 951              | 0,20                |
| Foundation Building Materials Inc, 6,000 %, 01/03/29 144A (i)                        | USD | 25 000             | 20 875              | 0,30                |

|                                                                                            |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                   |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                |     |                    |                     |                     |
| <b>Distributeurs – 4,84 % (31 décembre 2022 : 3,52 %) (suite)</b>                          |     |                    |                     |                     |
| Ken Garff Automotive LLC, 4,875 %, 15/09/28 144A (i)                                       | USD | 5 000              | 4 398               | 0,06                |
| KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC, 4,750 %, 01/06/27 144A (i) | USD | 60 000             | 57 913              | 0,82                |
| LBM Acquisition LLC, 6,250 %, 15/01/29 144A (i)                                            | USD | 10 000             | 8 272               | 0,12                |
| Lithia Motors Inc, 4,375 %, 15/01/31 144A (i)                                              | USD | 5 000              | 4 316               | 0,06                |
| Macy's Retail Holdings LLC, 5,875 %, 01/04/29 144A (i)                                     | USD | 15 000             | 13 687              | 0,19                |
| NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC, 7,125 %, 01/04/26 144A (i)                     | USD | 10 000             | 9 308               | 0,13                |
| Papa John's International Inc, 3,875 %, 15/09/29 144A (i)                                  | USD | 25 000             | 21 163              | 0,30                |
| Patrick Industries Inc, 4,750 %, 01/05/29 144A (i)                                         | USD | 10 000             | 8 589               | 0,12                |
| Sonic Automotive Inc, 4,625 %, 15/11/29 144A (i)                                           | USD | 25 000             | 20 936              | 0,30                |
| Sonic Automotive Inc, 4,875 %, 15/11/31 144A (i)                                           | USD | 10 000             | 8 206               | 0,12                |
| Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp, 6,375 %, 30/09/26 144A (i)      | USD | 10 000             | 9 448               | 0,13                |
| Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,000 %, 01/06/31 144A (i)      | USD | 10 000             | 8 371               | 0,12                |
| Yum! Brands Inc, 3,625 %, 15/03/31                                                         | USD | 5 000              | 4 320               | 0,06                |
|                                                                                            |     |                    | 340 886             | 4,84                |
| <b>Semi-conducteurs - 1,31 % (31 décembre 2022 : 1,04 %)</b>                               |     |                    |                     |                     |
| Broadcom Inc, 4,300 %, 15/11/32                                                            | USD | 25 000             | 22 932              | 0,33                |
| Entegris Escrow Corp, 4,750 %, 15/04/29 144A (i)                                           | USD | 30 000             | 27 850              | 0,39                |
| Micron Technology Inc, 6,750 %, 01/11/29                                                   | USD | 40 000             | 41 579              | 0,59                |
|                                                                                            |     |                    | 92 361              | 1,31                |
| <b>Logiciels - 0,94 % (31 décembre 2022 : 1,57 %)</b>                                      |     |                    |                     |                     |
| Cloud Software Group Inc, 6,500 %, 31/03/29 144A (i)                                       | USD | 20 000             | 17 808              | 0,25                |
| Dun & Bradstreet Corp, 5,000 %, 15/12/29 144A (i)                                          | USD | 5 000              | 4 409               | 0,06                |
| Elastic NV, 4,125 %, 15/07/29 144A (i) (ii)                                                | USD | 20 000             | 17 253              | 0,25                |
| Open Text Corp, 6,900 %, 01/12/27 144A (i)                                                 | USD | 20 000             | 20 361              | 0,29                |
| Playtika Holding Corp, 4,250 %, 15/03/29 144A (i)                                          | USD | 5 000              | 4 437               | 0,07                |
| Rackspace Technology Global Inc, 5,375 %, 01/12/28 144A (i)                                | USD | 5 000              | 1 581               | 0,02                |
|                                                                                            |     |                    | 65 849              | 0,94                |
| <b>Titres souverains - 7,26 % (31 décembre 2022 : 6,27 %)</b>                              |     |                    |                     |                     |
| United States Treasury Bill, 5,291 %, 17/10/23                                             | USD | 450 000            | 443 097             | 6,29                |
| United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, 15/12/23                                        | USD | 70 000             | 68 408              | 0,97                |
|                                                                                            |     |                    | 511 505             | 7,26                |
| <b>Télécommunications - 2,72 % (31 décembre 2022 : 6,54 %)</b>                             |     |                    |                     |                     |
| CommScope Technologies LLC, 5,000 %, 15/03/27 144A (i)                                     | USD | 95 000             | 66 126              | 0,94                |
| Frontier Communications Holdings LLC, 5,875 %, 15/10/27 144A (i)                           | USD | 30 000             | 27 533              | 0,39                |
| Frontier Communications Holdings LLC, 8,750 %, 15/05/30 144A (i)                           | USD | 5 000              | 4 887               | 0,07                |
| GoTo Group Inc, 5,500 %, 01/09/27 144A (i)                                                 | USD | 25 000             | 13 753              | 0,20                |

|                                                                                     |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>USD | % de<br>l'actif net |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|---------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>            |     |                    |                     |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                         |     |                    |                     |                     |
| <b>Télécommunications - 2,72 % (31 décembre 2022 : 6,54 %) (suite)</b>              |     |                    |                     |                     |
| Level 3 Financing Inc, 3,625 %, 15/01/29 144A (i)                                   | USD | 10 000             | 5 998               | 0,08                |
| Level 3 Financing Inc, 4,250 %, 01/07/28 144A (i)                                   | USD | 5 000              | 3 219               | 0,05                |
| Telecom Italia Capital SA, 6,000 %, 30/09/34 (ii)                                   | USD | 65 000             | 52 419              | 0,74                |
| Telesat Canada/Telesat LLC, 5,625 %, 06/12/26 144A (i)                              | USD | 15 000             | 9 257               | 0,13                |
| ViaSat Inc, 6,500 %, 15/07/28 144A (i)                                              | USD | 10 000             | 8 475               | 0,12                |
|                                                                                     |     |                    | 191 667             | 2,72                |
| <b>Jouets/Jeux/Loisirs - 0,13 % (31 décembre 2022 : 0,23 %)</b>                     |     |                    |                     |                     |
| Mattel Inc, 3,750 %, 01/04/29 144A (i)                                              | USD | 10 000             | 8 798               | 0,13                |
|                                                                                     |     |                    | 8 798               | 0,13                |
| <b>Services de transport - 0,71 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                   |     |                    |                     |                     |
| Rand Parent LLC, 8,500 %, 15/02/30 144A (i)                                         | USD | 55 000             | 49 799              | 0,71                |
|                                                                                     |     |                    | 49 799              | 0,71                |
| <b>Eau - 0,14 % (31 décembre 2022 : 0,06 %)</b>                                     |     |                    |                     |                     |
| Solaris Midstream Holdings LLC, 7,625 %, 01/04/26 144A (i)                          | USD | 10 000             | 9 678               | 0,14                |
|                                                                                     |     |                    | 9 678               | 0,14                |
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES</b>                                       |     |                    | <b>6 514 219</b>    | <b>92,50</b>        |
| <b>OBLIGATIONS CONVERTIBLES - 5,04 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 5,62 %)</b> |     |                    |                     |                     |
| <b>Compagnies aériennes - 0,57 % (31 décembre 2022 : 0,56 %)</b>                    |     |                    |                     |                     |
| Southwest Airlines Co, 1,250 %, 01/05/25                                            | USD | 35 000             | 40 128              | 0,57                |
|                                                                                     |     |                    | 40 128              | 0,57                |
| <b>Biotechnologie - 0,97 % (31 décembre 2022 : 0,95 %)</b>                          |     |                    |                     |                     |
| BioMarin Pharmaceutical Inc, 1,250 %, 15/05/27                                      | USD | 50 000             | 50 265              | 0,71                |
| Livongo Health Inc, 0,875 %, 01/06/25                                               | USD | 20 000             | 18 068              | 0,26                |
|                                                                                     |     |                    | 68 333              | 0,97                |
| <b>Cosmétiques/soins personnels - 0,11 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>            |     |                    |                     |                     |
| Beauty Health Co, 1,250 %, 01/10/26 144A (i)                                        | USD | 10 000             | 7 844               | 0,11                |
|                                                                                     |     |                    | 7 844               | 0,11                |
| <b>Santé - 0,80 % (31 décembre 2022 : 0,78 %)</b>                                   |     |                    |                     |                     |
| Lantheus Holdings Inc, 2,625 %, 15/12/27 144A (i)                                   | USD | 10 000             | 12 956              | 0,18                |
| Teladoc Health Inc, 1,250 %, 01/06/27                                               | USD | 55 000             | 43 725              | 0,62                |
|                                                                                     |     |                    | 56 681              | 0,80                |
| <b>Médias - 2,13 % (31 décembre 2022 : 2,51 %)</b>                                  |     |                    |                     |                     |
| DISH Network Corp, 3,375 %, 15/08/26                                                | USD | 295 000            | 149 712             | 2,13                |
|                                                                                     |     |                    | 149 712             | 2,13                |
| <b>Pétrole et gaz - 0,24 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                          |     |                    |                     |                     |
| Northern Oil & Gas Inc, 3,625 %, 15/04/29 144A (i)                                  | USD | 15 000             | 16 728              | 0,24                |
|                                                                                     |     |                    | 16 728              | 0,24                |



|                                                                                                      |     | <u>Valeur<br/>nominale</u> | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de<br/>l'actif net</u> |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                             |     |                            |                             |                             |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                          |     |                            |                             |                             |
| <b>Semi-conducteurs - 0,11 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                                         |     |                            |                             |                             |
| Wolfspeed Inc, 1,875 %, 01/12/29 144A (i)                                                            | USD | 10 000                     | 7 710                       | 0,11                        |
|                                                                                                      |     |                            | <u>7 710</u>                | <u>0,11</u>                 |
| <b>Logiciels - 0,11 % (31 décembre 2022 : 0,21 %)</b>                                                |     |                            |                             |                             |
| Unity Software Inc, Zero Coupon Bond, 15/11/26                                                       | USD | 10 000                     | 7 985                       | 0,11                        |
|                                                                                                      |     |                            | <u>7 985</u>                | <u>0,11</u>                 |
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS CONVERTIBLES</b>                                                            |     |                            | <b>355 121</b>              | <b>5,04</b>                 |
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES<br/>OBLIGATIONS À MOYEN TERME</b>                       |     |                            | <b>6 869 340</b>            | <b>97,54</b>                |
|                                                                                                      |     |                            |                             |                             |
|                                                                                                      |     | <u>Actions</u>             | <u>Juste valeur<br/>USD</u> | <u>% de<br/>l'actif net</u> |
| <b>ACTIONS PRIVILÉGIÉES NON CONVERTIBLES – 1,09 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 :<br/>0,96 %)</b> |     |                            |                             |                             |
| <b>Constructeurs de logements - 0,48 % (31 décembre 2022 : 0,42 %)</b>                               |     |                            |                             |                             |
| Hovnanian Enterprises Inc, 7,625 % (iv)                                                              | USD | 1 902                      | 34 017                      | 0,48                        |
|                                                                                                      |     |                            | <u>34 017</u>               | <u>0,48</u>                 |
| <b>REIT - 0,61 % (31 décembre 2022 : 0,54 %)</b>                                                     |     |                            |                             |                             |
| Highwoods Properties Inc, 8,625 % (iv)                                                               | USD | 45                         | 43 074                      | 0,61                        |
|                                                                                                      |     |                            | <u>43 074</u>               | <u>0,61</u>                 |
| <b>TOTAL DES ACTIONS PRIVILÉGIÉES NON<br/>CONVERTIBLES</b>                                           |     |                            | <b>77 091</b>               | <b>1,09</b>                 |
| <b>ACTIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES - 0,26 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 0,22 %)</b>         |     |                            |                             |                             |
| <b>Logiciels - 0,26 % (31 décembre 2022 : 0,22 %)</b>                                                |     |                            |                             |                             |
| Clarivate PLC, 5,250 % 01/06/24                                                                      | USD | 445                        | 18 316                      | 0,26                        |
|                                                                                                      |     |                            | <u>18 316</u>               | <u>0,26</u>                 |
| <b>TOTAL DES ACTIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES</b>                                                   |     |                            | <b>18 316</b>               | <b>0,26</b>                 |

**NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC**

**LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND (suite)**

| <b>Calendrier des investissements</b> | <b>Au 30 juin 2023</b> |  |
|---------------------------------------|------------------------|--|
|---------------------------------------|------------------------|--|

**ACTIONS ORDINAIRES – 0,02 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 0,02 %)**

**Pétrole et gaz - 0,02 % (31 décembre 2022 : 0,02 %)**

|                                     |     |     |              |             |
|-------------------------------------|-----|-----|--------------|-------------|
| Battalion Oil Corp                  | USD | 207 | <u>1 182</u> | <u>0,02</u> |
|                                     |     |     | <u>1 182</u> | <u>0,02</u> |
| <b>TOTAL DES ACTIONS ORDINAIRES</b> |     |     | <b>1 182</b> | <b>0,02</b> |

**FONDS D'INVESTISSEMENT : 2,21 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 2,83 %)**

**Services commerciaux - 2,21 % (31 décembre 2022 : 2,83 %)**

|                                         |     |    |                |             |
|-----------------------------------------|-----|----|----------------|-------------|
| Loomis Sayles Asia Bond Plus Fund (ii)  | USD | 22 | <u>155 446</u> | <u>2,21</u> |
|                                         |     |    | <u>155 446</u> | <u>2,21</u> |
| <b>TOTAL DES FONDS D'INVESTISSEMENT</b> |     |    | <b>155 446</b> | <b>2,21</b> |

**TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR  
PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS  
INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS  
(Coût : 8 480 381 USD)**

|                  |               |
|------------------|---------------|
| <u>7 121 375</u> | <u>101,12</u> |
|------------------|---------------|

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS - (0,10 %) (31 décembre 2022 : 0,00 %)

## Contrats de change à terme en cours - (0,10 %) (31 décembre 2022 : 0,00 %)

| Échéance                                                                                                                     | Montant acheté | Montant vendu | Contrepartie            | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente USD | % de l'actif<br>net         |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|---------------|-------------------------|---------------------------------------------|-----------------------------|
| 31/07/23                                                                                                                     | 1 629 810 EUR  | 1 787 344 USD | Brown Brothers Harriman | (6 744)                                     | (0,10 %)                    |
| 31/07/23                                                                                                                     | 9 761 EUR      | 10 704 USD    | Brown Brothers Harriman | (40)                                        | (0,00 %)                    |
| 31/07/23                                                                                                                     | 2 787 EUR      | 3 056 USD     | Brown Brothers Harriman | (12)                                        | (0,00 %)                    |
| 31/07/23                                                                                                                     | 266 EUR        | 290 USD       | Brown Brothers Harriman | 0                                           | (0,00 %)                    |
| Moins-value latente sur les contrats de change à terme en cours                                                              |                |               |                         | (6 796)                                     | (0,10 %)                    |
| <b>Perte latente nette sur les contrats de change à terme en cours</b>                                                       |                |               |                         | <b>(6 796)</b>                              | <b>(0,10 %)</b>             |
|                                                                                                                              |                |               |                         | <b>Juste valeur<br/>USD</b>                 | <b>% de l'actif<br/>net</b> |
| <b>Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat</b>                               |                |               |                         | <b>7 121 375</b>                            | <b>101,12</b>               |
| <b>Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat</b>                                |                |               |                         | <b>(6 796)</b>                              | <b>(0,10)</b>               |
| <b>TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS</b> |                |               |                         | <b>7 114 579</b>                            | <b>101,02</b>               |
| Avoirs nets en banque                                                                                                        |                |               |                         | 289 719                                     | 4,11                        |
| Autres actifs                                                                                                                |                |               |                         | 384 840                                     | 5,47                        |
| Moins autres passifs                                                                                                         |                |               |                         | (746 600)                                   | (10,60)                     |
| <b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D' ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES</b>                                           |                |               |                         | <b>7 042 538</b>                            | <b>100,00</b>               |

- (i) Titres exempts d'enregistrement en vertu de la Rule 144A (i) de la Loi américaine sur les valeurs mobilières Securities Act de 1933. Ces titres peuvent être revendus dans le cadre d'opérations exemptes d'enregistrement, normalement à des acheteurs institutionnels qualifiés.
- (ii) Titres émis par des émetteurs non américains ou non canadiens.
- (iii) Indique un titre à taux variable. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2023.
- (iv) Obligations perpétuelles.
- (v) Titre en défaut.

## Abréviations

EUR : Euro  
USD : Dollar américain

**NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC****LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND (suite)**

| <b>Calendrier des investissements</b> | <b>Au 30 juin 2023</b> |
|---------------------------------------|------------------------|
|---------------------------------------|------------------------|

| <b>Analyse de l'actif total</b>                                                                                        | <b>% de<br/>l'actif total</b> |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle ou échangés sur un marché réglementé | 91,43                         |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | (0,09)                        |
| Actif circulant                                                                                                        | 8,66                          |
|                                                                                                                        | <u>100,00</u>                 |

|                                                                                                              |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME –</b>                                               |     |                    |                        |                     |
| <b>97,20 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 97,42 %)</b>                                                   |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 97,20 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 97,42 %)</b>                    |     |                    |                        |                     |
| <b>Australie - 1,96 % (31 décembre 2022 : 2,51 %)</b>                                                        |     |                    |                        |                     |
| Commonwealth Bank of Australia, 5,591 %, 01/11/28 (i) (ii)                                                   | GBP | 100 000            | 128 946                | 0,34                |
| National Australia Bank Ltd, 5,000 %, 11/03/24 (i)                                                           | AUD | 500 000            | 332 785                | 0,86                |
| New South Wales Treasury Corp, 2,000 %, 08/03/33 (i)                                                         | AUD | 485 000            | 254 904                | 0,66                |
| New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, 20/05/26 (i)                                                         | AUD | 60 000             | 39 567                 | 0,10                |
|                                                                                                              |     |                    | <u>756 202</u>         | <u>1,96</u>         |
| <b>Brésil - 1,03 % (31 décembre 2022 : 1,33 %)</b>                                                           |     |                    |                        |                     |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10,000 %, 01/01/27 (i)                                             | BRL | 1 930 000          | 397 780                | 1,03                |
|                                                                                                              |     |                    | <u>397 780</u>         | <u>1,03</u>         |
| <b>Canada - 3,68 % (31 décembre 2022 : 1,76 %)</b>                                                           |     |                    |                        |                     |
| Canada Housing Trust No 1, 1,550 %, 15/12/26 144A (iii)                                                      | CAD | 175 000            | 121 217                | 0,31                |
| Canadian Government, 1,500 %, 01/06/26                                                                       | CAD | 845 000            | 594 287                | 1,54                |
| CPPIB Capital Inc, 0,875 %, 06/02/29 EMTN                                                                    | EUR | 380 000            | 361 302                | 0,94                |
| Province of British Columbia Canada, 4,300 %, 18/06/42                                                       | CAD | 100 000            | 77 020                 | 0,20                |
| Province of Ontario Canada, 1,900 %, 02/12/51 *                                                              | CAD | 545 000            | 265 492                | 0,69                |
|                                                                                                              |     |                    | <u>1 419 318</u>       | <u>3,68</u>         |
| <b>Chine - 5,83 % (31 décembre 2022 : 6,60 %)</b>                                                            |     |                    |                        |                     |
| China Development Bank, 3,020 %, 06/03/33 (i)                                                                | CNY | 3 200 000          | 446 752                | 1,16                |
| China Development Bank, 3,120 %, 13/09/31 (i)                                                                | CNY | 2 780 000          | 389 079                | 1,01                |
| China Development Bank, 3,300 %, 03/03/26 (i)                                                                | CNY | 4 700 000          | 661 826                | 1,72                |
| China Government Bond, 1,990 %, 09/04/25 (i)                                                                 | CNY | 2 100 000          | 287 977                | 0,74                |
| China Government Bond, 3,720 %, 12/04/51 (i)                                                                 | CNY | 3 020 000          | 463 135                | 1,20                |
|                                                                                                              |     |                    | <u>2 248 769</u>       | <u>5,83</u>         |
| <b>Danemark - 0,59 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                                                         |     |                    |                        |                     |
| Danske Bank A/S, 4,750 %, 21/06/30 EMTN (i) (ii)                                                             | EUR | 210 000            | 228 198                | 0,59                |
|                                                                                                              |     |                    | <u>228 198</u>         | <u>0,59</u>         |
| <b>France - 2,23 % (31 décembre 2022 : 1,75 %)</b>                                                           |     |                    |                        |                     |
| BNP Paribas SA, 2,500 %, 31/03/32 EMTN (i) (ii)                                                              | EUR | 100 000            | 96 991                 | 0,25                |
| French Republic Government Bond OAT, 3,250 %, 25/05/45 (i)                                                   | EUR | 150 000            | 163 970                | 0,43                |
| French Republic Government Bond OAT, Zero Coupon Bond, 25/11/30 (i)                                          | EUR | 115 000            | 101 925                | 0,26                |
| French Republic Government Bond OAT, Zero Coupon Bond, 25/05/32 (i)                                          | EUR | 500 000            | 423 974                | 1,10                |
| Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal, 2,125 %, 21/06/52 (i) (ii) | EUR | 100 000            | 75 099                 | 0,19                |
|                                                                                                              |     |                    | <u>861 959</u>         | <u>2,23</u>         |
| <b>Allemagne - 7,86 % (31 décembre 2022 : 8,91 %)</b>                                                        |     |                    |                        |                     |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, 15/08/28 (i)                                              | EUR | 780 000            | 759 159                | 1,97                |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,000 %, 15/08/24 (i)                                              | EUR | 840 000            | 892 864                | 2,31                |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, 15/08/32 (i)                                              | EUR | 650 000            | 670 585                | 1,74                |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300 %, 15/02/33 (i)                                              | EUR | 290 000            | 314 230                | 0,81                |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Zero Coupon Bond, 15/08/52 (i)                                     | EUR | 420 000            | 234 387                | 0,61                |
| Deutsche Bank AG, 3,742 %, 07/01/33 (i) (ii)                                                                 | USD | 220 000            | 161 341                | 0,42                |
|                                                                                                              |     |                    | <u>3 032 566</u>       | <u>7,86</u>         |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                                |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>       |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                    |     |                    |                        |                     |
| <b>Indonésie - 1,35 % (31 décembre 2022 : 0,44 %)</b>                          |     |                    |                        |                     |
| Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 15/02/33 (i)*                                | IDR | 7 418 000 000      | 519 787                | 1,35                |
|                                                                                |     |                    | 519 787                | 1,35                |
| <b>Irlande - 0,93 % (31 décembre 2022 : 0,98 %)</b>                            |     |                    |                        |                     |
| Republic of Ireland, 1,000 %, 15/05/26 (ii)                                    | EUR | 150 000            | 154 554                | 0,40                |
| Republic of Ireland, Zero coupon Bond, 18/10/31 (i)                            | EUR | 110 000            | 95 384                 | 0,25                |
| Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 5,125 %, 23/11/52 EMTN (i) (ii) | GBP | 100 000            | 109 820                | 0,28                |
|                                                                                |     |                    | 359 758                | 0,93                |
| <b>Israël - 0,12 % (31 décembre 2022 : 0,13 %)</b>                             |     |                    |                        |                     |
| Israel Government Bond – Fixed, 1,000 %, 31/03/30 (i)                          | ILS | 200 000            | 45 199                 | 0,12                |
|                                                                                |     |                    | 45 199                 | 0,12                |
| <b>Italie – 2,04 % (31 décembre 2022 : 2,48 %)</b>                             |     |                    |                        |                     |
| Intesa Sanpaolo SpA, 5,148 %, 10/06/30 EMTN (i)                                | GBP | 140 000            | 143 407                | 0,37                |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1,350 %, 01/04/30 (i)                       | EUR | 425 000            | 396 783                | 1,03                |
| UniCredit SpA, 5,459 %, 30/06/35 144A (i) (ii) (iii)                           | USD | 290 000            | 246 108                | 0,64                |
|                                                                                |     |                    | 786 298                | 2,04                |
| <b>Japon - 7,18 % (31 décembre 2022 : 6,39 %)</b>                              |     |                    |                        |                     |
| Development Bank of Japan Inc, 0,875 %, 10/10/25 EMTN (i)                      | EUR | 335 000            | 341 326                | 0,89                |
| Japan Government Five Year Bond, 0,100 %, 20/12/25 (i)                         | JPY | 233 400 000        | 1 621 988              | 4,20                |
| Japan Government Thirty Year Bond, 0,300 %, 20/06/46 (i)                       | JPY | 138 850 000        | 808 103                | 2,09                |
|                                                                                |     |                    | 2 771 417              | 7,18                |
| <b>Luxembourg - 0,54 % (31 décembre 2022 : 1,21 %)</b>                         |     |                    |                        |                     |
| Logicor Financing Sarl, 0,875 %, 14/01/31 EMTN (i)                             | EUR | 100 000            | 72 800                 | 0,19                |
| Logicor Financing Sarl, 1,625 %, 17/01/30 EMTN (i)                             | EUR | 170 000            | 136 629                | 0,35                |
|                                                                                |     |                    | 209 429                | 0,54                |
| <b>Malaisie - 0,37 % (31 décembre 2022 : 0,34 %)</b>                           |     |                    |                        |                     |
| Malaysia Government Bond, 3,906 %, 15/07/26 (i)*                               | MYR | 660 000            | 143 041                | 0,37                |
|                                                                                |     |                    | 143 041                | 0,37                |
| <b>Mexique - 1,74 % (31 décembre 2022 : 1,28 %)</b>                            |     |                    |                        |                     |
| Mexican Bonos, 8,500 %, 31/05/29 (i)                                           | MXN | 8 760 700          | 505 362                | 1,31                |
| Mexico Government International Bond, 3,500 %, 12/02/34 (i)                    | USD | 200 000            | 167 514                | 0,43                |
|                                                                                |     |                    | 672 876                | 1,74                |
| <b>Pays-Bas – 0,88 % (31 décembre 2022 : 1,53 %)</b>                           |     |                    |                        |                     |
| Cooperatieve Rabobank UA, 1,250 %, 31/05/32 EMTN (i)                           | EUR | 100 000            | 92 771                 | 0,24                |
| Digital Dutch Finco BV, 1,000 %, 15/01/32 (i)                                  | EUR | 100 000            | 76 894                 | 0,20                |
| EDP Finance BV, 0,375 %, 16/09/26 EMTN (i)                                     | EUR | 100 000            | 97 705                 | 0,25                |
| Enel Finance International NV, 5,750 %, 14/09/40 EMTN (i)                      | GBP | 60 000             | 71 674                 | 0,19                |
|                                                                                |     |                    | 339 044                | 0,88                |
| <b>Nouvelle-Zélande - 1,17 % (31 décembre 2022 : 1,27 %)</b>                   |     |                    |                        |                     |
| New Zealand Government Bond, 4,500 %, 15/04/27 (i)                             | NZD | 745 000            | 453 248                | 1,17                |
|                                                                                |     |                    | 453 248                | 1,17                |
| <b>Norvège - 0,92 % (31 décembre 2022 : 1,09 %)</b>                            |     |                    |                        |                     |
| Aker BP ASA, 4,000 %, 15/01/31 144A (i) (iii)                                  | USD | 290 000            | 257 899                | 0,67                |
| Norway Government Bond, 1,750 %, 13/03/25 144A (i) (iii)                       | NOK | 1 085 000          | 97 334                 | 0,25                |
|                                                                                |     |                    | 355 233                | 0,92                |
| <b>Singapour - 1,10 % (31 décembre 2022 : 0,59 %)</b>                          |     |                    |                        |                     |
| Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, 19/05/33 (i)                   | USD | 130 000            | 129 510                | 0,33                |
| Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300 %, 19/05/53 (i)                   | USD | 100 000            | 103 968                | 0,27                |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                        |     |             | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------------|-----|-------------|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME</b>           |     |             |                    |                        |                     |
| <b>(suite)</b>                                                         |     |             |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                            |     |             |                    |                        |                     |
| <b>Singapour - 1,10 % (31 décembre 2022 : 0,59 %) (suite)</b>          |     |             |                    |                        |                     |
| Singapore Government Bond, 2,125 %, 01/06/26 (i)                       | SGD | 270 000     | 192 523            | 0,50                   |                     |
|                                                                        |     |             | 426 001            | 1,10                   |                     |
| <b>Afrique du Sud - 1,98 % (31 décembre 2022 : 1,75 %)</b>             |     |             |                    |                        |                     |
| Republic of South Africa Government Bond, 7,000 %, 28/02/31 (i)        | ZAR | 18 040 000  | 763 856            | 1,98                   |                     |
|                                                                        |     |             | 763 856            | 1,98                   |                     |
| <b>Corée du Sud - 2,07 % (31 décembre 2022 : 1,26 %)</b>               |     |             |                    |                        |                     |
| Korea Treasury Bond, 1,375 %, 10/06/30 (i)                             | KRW | 536 020 000 | 348 656            | 0,90                   |                     |
| Korea Treasury Bond, 4,250 %, 10/12/32 (i)                             | KRW | 569 920 000 | 450 635            | 1,17                   |                     |
|                                                                        |     |             | 799 291            | 2,07                   |                     |
| <b>Espagne - 2,67 % (31 décembre 2022 : 2,41 %)</b>                    |     |             |                    |                        |                     |
| Autonomous Community of Madrid Spain, 4,300 %, 15/09/26 (i)            | EUR | 155 000     | 172 299            | 0,45                   |                     |
| CaixaBank SA, 6,875 %, 25/10/33 EMTN (i) (ii)                          | GBP | 100 000     | 118 343            | 0,31                   |                     |
| Spain Government Bond, 1,300 %, 31/10/26 144A (i) (iii)                | EUR | 360 000     | 368 403            | 0,95                   |                     |
| Spain Government Bond, 4,200 %, 31/01/37 144A (i) (iii)                | EUR | 320 000     | 371 617            | 0,96                   |                     |
|                                                                        |     |             | 1 030 662          | 2,67                   |                     |
| <b>Titres supranationaux - 0,84 % (31 décembre 2022 : 3,08 %)</b>      |     |             |                    |                        |                     |
| Nordic Investment Bank, 1,500 %, 13/03/25 EMTN (i)                     | NOK | 3 650 000   | 324 262            | 0,84                   |                     |
|                                                                        |     |             | 324 262            | 0,84                   |                     |
| <b>Suède - 0,39 % (31 décembre 2022 : 0,08 %)</b>                      |     |             |                    |                        |                     |
| Kommuninvest I Sverige AB, 1,000 %, 12/05/25 (i)                       | SEK | 520 000     | 45 560             | 0,12                   |                     |
| Sweden Government Bond, 2,500 %, 12/05/25 (i)                          | SEK | 1 135 000   | 103 284            | 0,27                   |                     |
|                                                                        |     |             | 148 844            | 0,39                   |                     |
| <b>Suisse - 0,98 % (31 décembre 2022 : 0,49 %)</b>                     |     |             |                    |                        |                     |
| UBS Group AG, 0,650 %, 10/09/29 EMTN (i)                               | EUR | 200 000     | 170 695            | 0,44                   |                     |
| UBS Group AG, 2,125 %, 13/10/26 (i) (ii)                               | EUR | 100 000     | 101 506            | 0,27                   |                     |
| UBS Group AG, 3,250 %, 04/02/26 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 100 000     | 105 050            | 0,27                   |                     |
|                                                                        |     |             | 377 251            | 0,98                   |                     |
| <b>Thaïlande - 0,32 % (31 décembre 2022 : 0,35 %)</b>                  |     |             |                    |                        |                     |
| Thailand Government Bond, 1,600 %, 17/12/29 (i)*                       | THB | 4 600 000   | 123 079            | 0,32                   |                     |
|                                                                        |     |             | 123 079            | 0,32                   |                     |
| <b>Royaume-Uni - 3,80 % (31 décembre 2022 : 4,36 %)</b>                |     |             |                    |                        |                     |
| Channel Link Enterprises Finance PLC, 2,706 %, 30/06/50 (i) (ii)       | EUR | 125 000     | 123 675            | 0,32                   |                     |
| National Grid Electricity Transmission PLC, 0,872 %, 26/11/40 EMTN (i) | EUR | 100 000     | 65 082             | 0,17                   |                     |
| NatWest Group PLC, 5,808 %, 13/09/29 (i) (ii)                          | USD | 200 000     | 197 061            | 0,51                   |                     |
| Rio Tinto Finance USA PLC, 5,000 %, 09/03/33 (i)                       | USD | 225 000     | 226 979            | 0,59                   |                     |
| United Kingdom Treasury, 4,250 %, 07/12/55 (i)                         | GBP | 120 000     | 149 854            | 0,39                   |                     |
| United Kingdom Treasury, 4,750 %, 07/12/30 (i)                         | GBP | 540 000     | 701 715            | 1,82                   |                     |
|                                                                        |     |             | 1 464 366          | 3,80                   |                     |
| <b>États-Unis - 42,63 % (31 décembre 2022 : 40,70 %)</b>               |     |             |                    |                        |                     |
| Ally Financial Inc, 3,875 %, 21/05/24                                  | USD | 30 000      | 29 301             | 0,08                   |                     |
| Ally Financial Inc, 5,800 %, 01/05/25                                  | USD | 25 000      | 24 575             | 0,06                   |                     |
| Amgen Inc, 5,250 %, 02/03/33                                           | USD | 195 000     | 195 249            | 0,51                   |                     |
| Amgen Inc, 5,650 %, 02/03/53                                           | USD | 80 000      | 81 016             | 0,21                   |                     |
| AT&T Inc, 2,250 %, 01/02/32                                            | USD | 335 000     | 266 090            | 0,69                   |                     |
| AT&T Inc, 3,650 %, 01/06/51                                            | USD | 185 000     | 135 812            | 0,35                   |                     |
| AT&T Inc, 5,400 %, 15/02/34                                            | USD | 65 000      | 65 112             | 0,17                   |                     |
| Bank of America Corp, 5,288 %, 25/04/34 (ii)                           | USD | 250 000     | 247 677            | 0,64                   |                     |

|                                                                                                  |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME</b>                                     |     |                    |                        |                     |
| <b>(suite)</b>                                                                                   |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                      |     |                    |                        |                     |
| <b>États-Unis – 42,63 % (31 décembre 2022 : 40,70 %) (suite)</b>                                 |     |                    |                        |                     |
| Broadcom Inc, 2,450 %, 15/02/31 144A (iii)                                                       | USD | 50 000             | 40 665                 | 0,11                |
| Broadcom Inc, 3,419 %, 15/04/33 144A (iii)                                                       | USD | 25 000             | 20 906                 | 0,05                |
| Broadcom Inc, 3,469 %, 15/04/34 144A (iii)                                                       | USD | 40 000             | 32 812                 | 0,09                |
| Centene Corp, 2,450 %, 15/07/28                                                                  | USD | 55 000             | 47 012                 | 0,12                |
| Centene Corp, 2,500 %, 01/03/31                                                                  | USD | 265 000            | 211 330                | 0,55                |
| Centene Corp, 3,000 %, 15/10/30                                                                  | USD | 110 000            | 91 663                 | 0,24                |
| CF Industries Inc, 5,150 %, 15/03/34                                                             | USD | 25 000             | 23 916                 | 0,06                |
| Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 2,300 %, 01/02/32 | USD | 10 000             | 7 570                  | 0,02                |
| Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 2,800 %, 01/04/31 | USD | 170 000            | 136 792                | 0,35                |
| Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 3,700 %, 01/04/51 | USD | 70 000             | 44 232                 | 0,11                |
| Citigroup Inc, 2,400 %, 31/10/25                                                                 | JPY | 25 000 000         | 179 099                | 0,46                |
| Citigroup Inc, 4,400 %, 10/06/25                                                                 | USD | 75 000             | 72 849                 | 0,19                |
| Comcast Corp, 4,250 %, 15/01/33                                                                  | USD | 10 000             | 9 500                  | 0,03                |
| Comcast Corp, 4,650 %, 15/02/33                                                                  | USD | 35 000             | 34 745                 | 0,09                |
| Continental Resources Inc, 2,875 %, 01/04/32 144A (iii)                                          | USD | 175 000            | 134 453                | 0,35                |
| Continental Resources Inc, 4,375 %, 15/01/28                                                     | USD | 76 000             | 71 371                 | 0,19                |
| CVS Health Corp, 5,300 %, 01/06/33                                                               | USD | 235 000            | 234 635                | 0,61                |
| Delta Air Lines Class B Pass Through Trust, 4,250 %, 30/07/23                                    | USD | 82 196             | 81 957                 | 0,21                |
| Energy Transfer LP, 5,300 %, 15/04/47                                                            | USD | 55 000             | 47 837                 | 0,12                |
| EQT Corp, 3,625 %, 15/05/31 144A (iii)                                                           | USD | 115 000            | 98 911                 | 0,26                |
| ERAC USA Finance LLC, 4,500 %, 15/02/45 144A (iii)                                               | USD | 75 000             | 65 259                 | 0,17                |
| Fannie Mae Pool, 2,000 %, 01/05/51                                                               | USD | 118 128            | 96 775                 | 0,25                |
| Fannie Mae Pool, 2,000 %, 01/11/51                                                               | USD | 640 936            | 523 537                | 1,36                |
| Fannie Mae Pool, 2,000 %, 01/11/51                                                               | USD | 692 079            | 564 666                | 1,46                |
| Fannie Mae Pool, 2,500 %, 01/05/52                                                               | USD | 47 381             | 40 226                 | 0,10                |
| Fannie Mae Pool, 3,000 %, 01/04/45                                                               | USD | 27 728             | 24 909                 | 0,06                |
| Fannie Mae Pool, 3,000 %, 01/11/51                                                               | USD | 763 369            | 672 276                | 1,74                |
| Fannie Mae Pool, 4,000 %, 01/06/47                                                               | USD | 50 409             | 48 155                 | 0,13                |
| Fannie Mae Pool, 4,000 %, 01/03/49                                                               | USD | 274 597            | 261 205                | 0,68                |
| Fannie Mae Pool, 4,500 %, 01/11/45                                                               | USD | 22 405             | 21 954                 | 0,06                |
| Fannie Mae Pool, 4,500 %, 01/07/46                                                               | USD | 1 599              | 1 561                  | 0,00                |
| Fannie Mae Pool, 4,500 %, 01/02/47                                                               | USD | 10 116             | 9 862                  | 0,03                |
| Fannie Mae Pool, 4,500 %, 01/03/47                                                               | USD | 180 121            | 176 402                | 0,46                |
| Fannie Mae Pool, 4,500 %, 01/09/52                                                               | USD | 96 156             | 92 457                 | 0,24                |
| Fannie Mae Pool, 5,000 %, 01/08/52                                                               | USD | 219 591            | 215 725                | 0,56                |
| Fannie Mae Pool, 6,500 %, 01/05/53                                                               | USD | 216 984            | 221 753                | 0,57                |
| Fannie Mae-Aces, 2,958 %, 25/11/27 (ii)                                                          | USD | 1 398 252          | 1 303 210              | 3,38                |
| Fannie Mae-Aces, 3,029 %, 25/09/27 (ii)                                                          | USD | 72 286             | 67 389                 | 0,18                |
| Freddie Mac Gold Pool, 3,500 %, 01/12/46                                                         | USD | 9 487              | 8 903                  | 0,02                |
| Freddie Mac Gold Pool, 4,500 %, 01/07/39                                                         | USD | 24 488             | 24 211                 | 0,06                |
| Freddie Mac Pool, 2,500 %, 01/12/51                                                              | USD | 727 485            | 617 836                | 1,60                |
| Freddie Mac Pool, 4,500 %, 01/05/53                                                              | USD | 384 273            | 369 662                | 0,96                |
| Freddie Mac Pool, 5,000 %, 01/10/48                                                              | USD | 101 112            | 100 680                | 0,26                |
| Freddie Mac Pool, 5,000 %, 01/11/48                                                              | USD | 68 930             | 68 700                 | 0,18                |
| Goldman Sachs Group Inc, 1,000 %, 24/11/25 EMTN                                                  | CHF | 155 000            | 167 686                | 0,43                |
| HCA Inc, 2,375 %, 15/07/31                                                                       | USD | 340 000            | 271 911                | 0,70                |
| HCA Inc, 3,625 %, 15/03/32 144A (iii)                                                            | USD | 5 000              | 4 340                  | 0,01                |



NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC FUND (suite)

Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|  | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|--|--------------------|------------------------|---------------------|
|--|--------------------|------------------------|---------------------|

**OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME  
(suite)**

**OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)**

**États-Unis – 42,63 % (31 décembre 2022 : 40,70 %) (suite)**

|                                                                  |     |           |                   |              |
|------------------------------------------------------------------|-----|-----------|-------------------|--------------|
| HCA Inc, 5,500 %, 01/06/33                                       | USD | 110 000   | 109 813           | 0,28         |
| Oracle Corp, 5,550 %, 06/02/53                                   | USD | 100 000   | 96 834            | 0,25         |
| Ovintiv Inc, 6,250 %, 15/07/33                                   | USD | 10 000    | 9 863             | 0,03         |
| Ovintiv Inc, 6,500 %, 15/08/34                                   | USD | 39 000    | 39 084            | 0,10         |
| Ovintiv Inc, 6,500 %, 01/02/38                                   | USD | 20 000    | 19 608            | 0,05         |
| Ovintiv Inc, 7,200 %, 01/11/31                                   | USD | 10 000    | 10 493            | 0,03         |
| Ovintiv Inc, 7,375 %, 01/11/31                                   | USD | 75 000    | 80 430            | 0,21         |
| T-Mobile USA Inc, 2,550 %, 15/02/31                              | USD | 90 000    | 74 809            | 0,19         |
| T-Mobile USA Inc, 3,400 %, 15/10/52                              | USD | 55 000    | 39 251            | 0,10         |
| T-Mobile USA Inc, 5,050 %, 15/07/33                              | USD | 335 000   | 328 936           | 0,85         |
| Towd Point Mortgage Trust, 2,750 %, 25/10/57 144A (ii) (iii)     | USD | 82 904    | 78 346            | 0,20         |
| United Airlines, 3,650 %, 07/10/25                               | USD | 158 681   | 147 423           | 0,38         |
| United States Treasury Inflation Indexed Note, 0,625 %, 15/07/32 | USD | 501 173   | 460 511           | 1,19         |
| United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, 15/02/41              | USD | 1 035 000 | 751 628           | 1,95         |
| United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, 15/05/51              | USD | 715 000   | 531 586           | 1,38         |
| United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 15/09/25              | USD | 955 000   | 929 185           | 2,41         |
| United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 31/01/30              | USD | 940 000   | 912 130           | 2,36         |
| United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, 31/05/28              | USD | 340 000   | 332 563           | 0,86         |
| United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, 15/02/53              | USD | 225 000   | 215 930           | 0,56         |
| United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, 15/11/42              | USD | 75 000    | 74 520            | 0,19         |
| United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, 31/10/27              | USD | 1 490 000 | 1 482 201         | 3,84         |
| United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, 31/10/24              | USD | 415 000   | 409 991           | 1,06         |
| UnitedHealth Group Inc, 4,500 %, 15/04/33                        | USD | 490 000   | 477 261           | 1,24         |
| Verizon Communications Inc, 2,850 %, 03/09/41                    | USD | 25 000    | 17 781            | 0,05         |
| VMware Inc, 2,200 %, 15/08/31                                    | USD | 145 000   | 113 941           | 0,30         |
|                                                                  |     |           | <u>16 452 455</u> | <u>42,63</u> |

**TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES** **37 510 189** **97,20**

**TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES  
OBLIGATIONS À MOYEN TERME** **37 510 189** **97,20**

**TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR  
PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS  
INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS  
(Coût : 41 140 187 USD)**

**37 510 189** **97,20**

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS - (0,17 %) (31 décembre 2022 : (0,07 %))**

**Contrats de change à terme en cours - (0,17 %) (31 décembre 2022 : (0,06 %))**

| Échéance   | Montant acheté | Montant vendu | Contrepartie    | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente<br>USD | % de l'actif<br>net |
|------------|----------------|---------------|-----------------|------------------------------------------------|---------------------|
| 05/09/2023 | 299 036 USD    | 1 520 000 BRL | Bank of America | (12 449)                                       | (0,03 %)            |
| 05/09/2023 | 56 698 USD     | 292 000 BRL   | Bank of America | (3 140)                                        | (0,01 %)            |

**NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC**

**LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC FUND (suite)**

**Calendrier des investissements**

**Au 30 juin 2023**

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)**

**Contrats de change à terme en cours - (0,17 %) (31 décembre 2022 : (0,06 %)) (suite)**

| Échéance | Montant acheté  | Montant vendu     | Contrepartie            | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente<br>USD | % de l'actif<br>net |
|----------|-----------------|-------------------|-------------------------|------------------------------------------------|---------------------|
| 20/09/23 | 304 730 000 JPY | 2 218 962 USD     | Bank of America         | (84 656)                                       | (0,22 %)            |
| 20/09/23 | 401 442 USD     | 513 585 000 KRW   | Bank of America         | 10 023                                         | 0,03 %              |
| 20/09/23 | 287 000 PLN     | 63 352 EUR        | Barclays Bank PLC       | 977                                            | 0,00 %              |
| 21/09/23 | 121 589 USD     | 163 000 SGD       | Barclays Bank PLC       | 784                                            | 0,00 %              |
| 27/07/23 | 33 317 USD      | 55 000 NZD        | BNP Paribas SA          | (375)                                          | (0,00 %)            |
| 27/07/23 | 35 571 USD      | 58 000 NZD        | BNP Paribas SA          | 41                                             | 0,00 %              |
| 27/07/23 | 324 944 USD     | 526 000 NZD       | BNP Paribas SA          | 2 724                                          | 0,01 %              |
| 20/09/23 | 1 889 000 CNH   | 266 559 USD       | BNP Paribas SA          | (5 180)                                        | (0,02 %)            |
| 20/09/23 | 374 878 USD     | 295 000 GBP       | BNP Paribas SA          | (247)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 395 699 USD     | 5 895 119 000 IDR | BNP Paribas SA          | 2 747                                          | 0,01 %              |
| 31/07/23 | 163 232 EUR     | 179 010 USD       | Brown Brothers Harriman | (675)                                          | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 646 532 SGD     | 478 824 USD       | Brown Brothers Harriman | (614)                                          | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 54 779 SGD      | 31 935 GBP        | Brown Brothers Harriman | (91)                                           | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 13 829 EUR      | 11 939 GBP        | Brown Brothers Harriman | (74)                                           | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 22 485 SGD      | 25 067 AUD        | Brown Brothers Harriman | (69)                                           | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 5 676 EUR       | 9 371 AUD         | Brown Brothers Harriman | (42)                                           | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 9 908 EUR       | 14 364 CAD        | Brown Brothers Harriman | (35)                                           | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 31 360 EUR      | 248 891 CNH       | Brown Brothers Harriman | (26)                                           | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 8 880 EUR       | 13 148 SGD        | Brown Brothers Harriman | (24)                                           | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 39 251 SGD      | 38 422 CAD        | Brown Brothers Harriman | (16)                                           | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 7 505 SGD       | 4 964 CHF         | Brown Brothers Harriman | (13)                                           | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 1 895 EUR       | 1 856 CHF         | Brown Brothers Harriman | (10)                                           | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 1 350 EUR       | 1 481 USD         | Brown Brothers Harriman | (6)                                            | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 40 538 EUR      | 6 374 559 JPY     | Brown Brothers Harriman | (6)                                            | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 4 483 EUR       | 4 902 USD         | Brown Brothers Harriman | (5)                                            | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 5 814 SGD       | 4 304 USD         | Brown Brothers Harriman | (4)                                            | (0,00 %)            |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

## Contrats de change à terme en cours - (0,17 %) (31 décembre 2022 : (0,06 %)) (suite)

| Échéance | Montant acheté | Montant vendu | Contrepartie            | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente<br>USD | % de l'actif<br>net |
|----------|----------------|---------------|-------------------------|------------------------------------------------|---------------------|
| 31/07/23 | 368 055 JPY    | 2 344 EUR     | Brown Brothers Harriman | (3)                                            | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 8 373 CNH      | 1 057 EUR     | Brown Brothers Harriman | (2)                                            | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 114 EUR        | 99 GBP        | Brown Brothers Harriman | (1)                                            | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 138 EUR        | 119 GBP       | Brown Brothers Harriman | (1)                                            | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 709 AUD        | 639 SGD       | Brown Brothers Harriman | (1)                                            | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 2 079 SGD      | 1 409 EUR     | Brown Brothers Harriman | (1)                                            | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 172 096 JPY    | 1 618 SGD     | Brown Brothers Harriman | (1)                                            | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 0 EUR          | 0 CAD         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 0 SGD          | 0 EUR         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 0 EUR          | 0 AUD         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 0 EUR          | 2 SEK         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 0 EUR          | 0 CAD         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 0 CHF          | 0 EUR         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 0 EUR          | 0 CHF         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 1 SEK          | 0 EUR         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 1 EUR          | 1 GBP         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 2 EUR          | 1 GBP         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 2 EUR          | 3 SGD         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 2 AUD          | 1 EUR         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 5 USD          | 4 EUR         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 11 EUR         | 127 SEK       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 12 EUR         | 91 CNH        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 16 EUR         | 16 CHF        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 16 EUR         | 15 CHF        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 17 CHF         | 17 EUR        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 20 EUR         | 3 146 JPY     | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

## Contrats de change à terme en cours - (0,17 %) (31 décembre 2022 : (0,06 %)) (suite)

| Échéance | Montant acheté | Montant vendu | Contrepartie            | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente<br>USD | % de l'actif<br>net |
|----------|----------------|---------------|-------------------------|------------------------------------------------|---------------------|
| 31/07/23 | 22 EUR         | 32 CAD        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 27 EUR         | 322 SEK       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 28 EUR         | 41 CAD        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 33 EUR         | 37 USD        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 34 SGD         | 23 EUR        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 42 EUR         | 70 AUD        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 47 EUR         | 78 AUD        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 67 SEK         | 8 SGD         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 69 CNH         | 9 EUR         | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 73 EUR         | 109 SGD       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 76 CHF         | 115 SGD       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 82 EUR         | 119 CAD       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 118 SEK        | 10 EUR        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 199 AUD        | 121 EUR       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 201 EUR        | 172 GBP       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 234 EUR        | 346 SGD       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 259 EUR        | 2 059 CNH     | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 335 EUR        | 52 734 JPY    | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 374 CAD        | 382 SGD       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 514 SGD        | 299 GBP       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 595 USD        | 544 EUR       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 1 087 CNH      | 203 SGD       | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 3 034 JPY      | 19 EUR        | Brown Brothers Harriman | 0                                              | (0,00 %)            |
| 31/07/23 | 2 535 EUR      | 398 196 JPY   | Brown Brothers Harriman | 3                                              | 0,00 %              |
| 31/07/23 | 1 304 EUR      | 15 323 SEK    | Brown Brothers Harriman | 4                                              | 0,00 %              |
| 31/07/23 | 1 481 EUR      | 11 697 CNH    | Brown Brothers Harriman | 6                                              | 0,00 %              |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

## Contrats de change à terme en cours - (0,17 %) (31 décembre 2022 : (0,06 %)) (suite)

| Échéance                                                               | Montant acheté | Montant vendu  | Contrepartie            | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente<br>USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------------|----------------|----------------|-------------------------|------------------------------------------------|---------------------|
| 31/07/23                                                               | 5 161 SGD      | 40 988 SEK     | Brown Brothers Harriman | 18                                             | 0,00 %              |
| 31/07/23                                                               | 124 225 SGD    | 665 762 CNH    | Brown Brothers Harriman | 166                                            | 0,00 %              |
| 31/07/23                                                               | 160 569 SGD    | 17 050 358 JPY | Brown Brothers Harriman | 292                                            | 0,00 %              |
| 31/07/23                                                               | 323 529 SGD    | 218 492 EUR    | Brown Brothers Harriman | 592                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23                                                               | 90 000 SGD     | 67 531 USD     | HSBC Bank               | (831)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23                                                               | 67 140 USD     | 90 000 SGD     | HSBC Bank               | 441                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23                                                               | 370 316 EUR    | 4 275 000 NOK  | HSBC Bank               | 5 483                                          | 0,01 %              |
| 20/09/23                                                               | 394 611 USD    | 6 902 000 MXN  | UBS Securities LLC      | (1 824)                                        | (0,01 %)            |
| 20/09/23                                                               | 105 670 USD    | 156 000 AUD    | UBS Securities LLC      | 1 601                                          | 0,00 %              |
| 20/09/23                                                               | 691 000 CAD    | 520 518 USD    | UBS Securities LLC      | 2 317                                          | 0,01 %              |
| 20/09/23                                                               | 526 159 USD    | 691 000 CAD    | UBS Securities LLC      | 3 325                                          | 0,01 %              |
| 20/09/23                                                               | 574 700 USD    | 10 640 000 ZAR | UBS Securities LLC      | 15 939                                         | 0,04 %              |
| Plus-value latente sur les contrats de change à terme en cours         |                |                |                         | 47 483                                         | 0,12 %              |
| Moins-value latente sur les contrats de change à terme en cours        |                |                |                         | (110 422)                                      | (0,29 %)            |
| <b>Perte latente nette sur les contrats de change à terme en cours</b> |                |                |                         | <b>(62 939)</b>                                | <b>(0,17 %)</b>     |

## Contrats à terme normalisés – (0,00 %) (31 décembre 2022 : (0,01 %))

| Nombre de<br>contrats | Libellé                                          | Contrepartie | Engagement | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | % de l'actif<br>net |
|-----------------------|--------------------------------------------------|--------------|------------|-----------------------------------------|---------------------|
| (7)                   | US 5 Year Note September 2023<br>Futures         | JP Morgan    | 760 392    | 10 736                                  | 0,03 %              |
| (1)                   | US Long Bond September 2023<br>Futures           | JP Morgan    | 126 160    | (746)                                   | (0,00 %)            |
| 1                     | Euro-Bund September 2023<br>Futures              | JP Morgan    | 146 423    | (513)                                   | (0,00 %)            |
| 2                     | Euro-Buxl 30 Year Bond<br>September 2023 Futures | JP Morgan    | 301 552    | 3 055                                   | 0,01 %              |
| 4                     | Euro-Schatz September 2023<br>Futures            | JP Morgan    | 461 209    | (3 644)                                 | (0,01 %)            |
| 2                     | Long Gilt September 2023<br>Futures              | JP Morgan    | 243 565    | (1 246)                                 | (0,01 %)            |
| 8                     | US 10 Year Note September 2023<br>Futures        | JP Morgan    | 906 625    | (8 500)                                 | (0,02 %)            |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Contrats à terme normalisés – (0,00 %) (31 décembre 2022 : (0,01 %)) (suite)

| Nombre de<br>contrats                                                                                                                | Libellé                                    | Contrepartie | Engagement | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------|------------|-----------------------------------------|---------------------|
| 5                                                                                                                                    | US 10 Year Ultra September 2023<br>Futures | JP Morgan    | 593 154    | (966)                                   | (0,00 %)            |
| Plus-value latente sur les contrats à terme normalisés                                                                               |                                            |              |            | 13 791                                  | 0,04 %              |
| Moins-value latente sur les contrats à terme normalisés                                                                              |                                            |              |            | (15 615)                                | (0,04 %)            |
| <b>Moins-value nette latente sur les contrats à terme normalisés</b>                                                                 |                                            |              |            | <b>(1 824)</b>                          | <b>(0,00 %)</b>     |
|                                                                                                                                      |                                            |              |            | Juste valeur<br>USD                     | % de l'actif<br>net |
| Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat                                              |                                            |              |            | 37 571 463                              | 97,36               |
| Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat                                               |                                            |              |            | (126 037)                               | (0,33)              |
| <b>TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE<br/>VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT<br/>ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS</b> |                                            |              |            | <b>37 445 426</b>                       | <b>97,03</b>        |
| Avoirs nets en banque                                                                                                                |                                            |              |            | 1 005 912                               | 2,61                |
| Autres actifs                                                                                                                        |                                            |              |            | 306 041                                 | 0,79                |
| Moins autres passifs                                                                                                                 |                                            |              |            | (165 671)                               | (0,43)              |
| <b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D' ACTIONS<br/>PARTICIPANTES REMBOURSABLES</b>                                               |                                            |              |            | <b>38 591 708</b>                       | <b>100,00</b>       |

## LES DIX PREMIÈRES PARTICIPATIONS SECTORIELLES AU 30 JUIN 2023 EN POURCENTAGE DE L'ACTIF NET

|                            |         |
|----------------------------|---------|
| Titres souverains          | 52,10 % |
| Activités bancaires        | 12,00 % |
| Garanties UMBS             | 10,70 % |
| CMBS                       | 3,55 %  |
| Santé                      | 3,14 %  |
| Télécommunications         | 2,40 %  |
| Exécutifs locaux étrangers | 2,22 %  |
| Pétrole et gaz             | 1,87 %  |
| Produits pharmaceutiques   | 1,21 %  |
| Finance                    | 1,08 %  |

(i) Titres émis par des émetteurs non américains ou non canadiens.

(ii) Indique un titre à taux variable. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2023.

(iii) Titres exempts d'enregistrement en vertu de la Rule 144A (i) de la Loi américaine sur les valeurs mobilières Securities Act de 1933. Ces titres peuvent être revendus dans le cadre d'opérations exemptes d'enregistrement, normalement à des acheteurs institutionnels qualifiés.

\* Titres non cotés.

Autres informations :

Sauf indication contraire, tous les titres à long terme mentionnés ci-dessus sont négociés sur des marchés réglementés.

## Abréviations

|       |                          |
|-------|--------------------------|
| AUD : | Dollar australien        |
| BRL:  | Réal brésilien           |
| CAD : | Dollar canadien          |
| CHF : | Franc suisse             |
| CNH : | Yuan chinois             |
| CNY : | Yuan Renminbi chinois    |
| EUR : | Euro                     |
| GBP : | Livre sterling           |
| IDR : | Roupie indonésienne      |
| ILS : | Nouveau Shekel Israélien |
| JPY : | Yen japonais             |
| KRW : | Won coréen               |
| MXN : | Peso mexicain            |
| MYR : | Ringgit malais           |
| NOK : | Couronne norvégienne     |
| NZD : | Dollar néo-zélandais     |
| PLN : | Zloty polonais           |
| SEK : | Couronne suédoise        |
| SGD : | Dollar de Singapour      |
| THB : | Baht thaïlandais         |
| USD : | Dollar américain         |
| ZAR : | Rand sud-africain        |

| <b>Analyse de l'actif total</b>                                                                                                        | <b>% de<br/>l'actif total</b> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle                                                      | 67,41                         |
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé                                                | 19,49                         |
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire autres que ceux admis à une cote officielle ou négociés sur un marché réglementé | 9,88                          |
| Instruments financiers dérivés                                                                                                         | (0,17)                        |
| Actif circulant                                                                                                                        | 3,39                          |
|                                                                                                                                        | <u>100,00</u>                 |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                                           |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME –</b>                            |     |                    |                        |                     |
| <b>46,02 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 33,43 %)</b>                                |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 46,02 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 33,43 %)</b> |     |                    |                        |                     |
| <b>Australie - 0,31 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                                     |     |                    |                        |                     |
| Northern Star Resources Ltd, 6,125 %, 11/04/33 144A (i) (ii)                              | USD | 85 000             | 82 507                 | 0,31                |
|                                                                                           |     |                    | 82 507                 | 0,31                |
| <b>Bermudes - 0,06 % (31 décembre 2022 : 0,06 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Athene Holding Ltd, 6,150 %, 03/04/30 (ii)                                                | USD | 15 000             | 15 066                 | 0,06                |
|                                                                                           |     |                    | 15 066                 | 0,06                |
| <b>Brésil - 0,26 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                                        |     |                    |                        |                     |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10,000 %, 01/01/31 (ii)                         | BRL | 343 000            | 69 106                 | 0,26                |
|                                                                                           |     |                    | 69 106                 | 0,26                |
| <b>Canada - 1,38 % (31 décembre 2022 : 0,42 %)</b>                                        |     |                    |                        |                     |
| CI Financial Corp, 3,200 %, 17/12/30                                                      | USD | 20 000             | 14 989                 | 0,06                |
| Magna International Inc, 5,980 %, 21/03/26                                                | USD | 55 000             | 55 025                 | 0,21                |
| Masonite International Corp, 3,500 %, 15/02/30 144A (i)                                   | USD | 19 000             | 15 960                 | 0,06                |
| Methanex Corp, 5,650 %, 01/12/44                                                          | USD | 20 000             | 16 323                 | 0,06                |
| Nutrien Ltd, 4,900 %, 27/03/28                                                            | USD | 65 000             | 63 751                 | 0,24                |
| Nutrien Ltd, 5,800 %, 27/03/53                                                            | USD | 15 000             | 15 051                 | 0,06                |
| Suncor Energy Inc, 6,800 %, 15/05/38                                                      | USD | 13 000             | 13 793                 | 0,05                |
| Teck Resources Ltd, 6,000 %, 15/08/40                                                     | USD | 15 000             | 14 614                 | 0,06                |
| Tervita Corp, 11,000 %, 01/12/25 144A (i)                                                 | USD | 16 000             | 16 974                 | 0,06                |
| TransAlta Corp, 6,500 %, 15/03/40                                                         | USD | 15 000             | 14 278                 | 0,05                |
| TransCanada PipeLines Ltd, 6,203 %, 09/03/26                                              | USD | 125 000            | 125 087                | 0,47                |
|                                                                                           |     |                    | 365 845                | 1,38                |
| <b>Îles Caïmans - 2,77 % (31 décembre 2022 : 0,05 %)</b>                                  |     |                    |                        |                     |
| Gaci First Investment Co, 4,875 %, 14/02/35 (ii)                                          | USD | 390 000            | 372 450                | 1,41                |
| Gaci First Investment Co, 5,125 %, 14/02/53 (ii)                                          | USD | 390 000            | 349 538                | 1,32                |
| Spirit Loyalty Cayman Ltd/Spirit IP Cayman Ltd, 8,000 %, 20/09/25 144A (i) (ii)           | USD | 11 968             | 12 058                 | 0,04                |
|                                                                                           |     |                    | 734 046                | 2,77                |
| <b>Chine - 6,28 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                                         |     |                    |                        |                     |
| China Government International Bond, 1,200 %, 21/10/30 (ii)                               | USD | 2 000 000          | 1 662 481              | 6,28                |
|                                                                                           |     |                    | 1 662 481              | 6,28                |
| <b>Colombie - 1,77 % (31 décembre 2022 : 1,43 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Colombian TES, 7,750 %, 18/09/30 (ii)                                                     | COP | 2 196 500 000      | 467 770                | 1,77                |
|                                                                                           |     |                    | 467 770                | 1,77                |
| <b>Finlande - 0,02 % (31 décembre 2022 : 0,02 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Nokia OYJ, 6,625 %, 15/05/39 (ii)                                                         | USD | 5 000              | 4 781                  | 0,02                |
|                                                                                           |     |                    | 4 781                  | 0,02                |
| <b>Indonésie - 1,37 % (31 décembre 2022 : 0,15 %)</b>                                     |     |                    |                        |                     |
| Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 15/09/30 (ii)*                                          | IDR | 5 238 000 000      | 363 207                | 1,37                |
|                                                                                           |     |                    | 363 207                | 1,37                |
| <b>Luxembourg - 0,18 % (31 décembre 2022 : 0,01 %)</b>                                    |     |                    |                        |                     |
| Medtronic Global Holdings SCA, 4,250 %, 30/03/28 (ii)                                     | USD | 45 000             | 43 921                 | 0,17                |
| Telecom Italia Capital SA, 7,721 %, 04/06/38 (ii)                                         | USD | 4 000              | 3 537                  | 0,01                |
|                                                                                           |     |                    | 47 458                 | 0,18                |
| <b>Malaisie - 0,34 % (31 décembre 2022 : 0,18 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Malaysia Government Bond, 2,632 %, 15/04/31 (ii)*                                         | MYR | 458 000            | 89 922                 | 0,34                |
|                                                                                           |     |                    | 89 922                 | 0,34                |



NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

| Calendrier des investissements                                   |     |           | Au 30 juin 2023    |                        |                     |
|------------------------------------------------------------------|-----|-----------|--------------------|------------------------|---------------------|
|                                                                  |     |           | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
| OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br>(suite) |     |           |                    |                        |                     |
| OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)                             |     |           |                    |                        |                     |
| Mexique - 0,97 % (31 décembre 2022 : 0,22 %)                     |     |           |                    |                        |                     |
| Mexican Bonos, 7,750 %, 29/05/31 (ii)                            | MXN | 4 650 800 | 256 367            | 0,97                   |                     |
|                                                                  |     |           | 256 367            | 0,97                   |                     |
| Pérou - 0,51 % (31 décembre 2022 : 0,52 %)                       |     |           |                    |                        |                     |
| Peruvian Government International Bond, 3,230 %, 28/07/21 (ii)   | USD | 225 000   | 135 902            | 0,51                   |                     |
|                                                                  |     |           | 135 902            | 0,51                   |                     |
| Afrique du Sud - 0,68 % (31 décembre 2022 : 0,19 %)              |     |           |                    |                        |                     |
| Republic of South Africa Government Bond, 8,000 %, 31/01/30 (ii) | ZAR | 3 839 600 | 179 437            | 0,68                   |                     |
|                                                                  |     |           | 179 437            | 0,68                   |                     |
| Royaume-Uni - 0,56 % (31 décembre 2022 : 0,56 %)                 |     |           |                    |                        |                     |
| Polyus Finance PLC, 3,250 %, 14/10/28 144A (i) (ii)              | USD | 235 000   | 149 159            | 0,56                   |                     |
|                                                                  |     |           | 149 159            | 0,56                   |                     |
| États-Unis - 26,74 % (31 décembre 2022 : 28,43 %)                |     |           |                    |                        |                     |
| Bank of America Corp, 5,202 %, 25/04/29 (iii)                    | USD | 125 000   | 123 634            | 0,47                   |                     |
| Blackstone Secured Lending Fund, 2,850 %, 30/09/28               | USD | 80 000    | 65 558             | 0,25                   |                     |
| Crown Castle Inc, 5,100 %, 01/05/33                              | USD | 55 000    | 54 048             | 0,20                   |                     |
| CVS Health Corp, 5,250 %, 21/02/33                               | USD | 95 000    | 94 631             | 0,36                   |                     |
| Eli Lilly & Co, 4,700 %, 27/02/33                                | USD | 60 000    | 60 786             | 0,23                   |                     |
| Energy Transfer LP, 5,750 %, 15/02/33                            | USD | 90 000    | 90 589             | 0,34                   |                     |
| General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, 06/04/26               | USD | 125 000   | 123 570            | 0,47                   |                     |
| Intel Corp, 5,200 %, 10/02/33                                    | USD | 130 000   | 131 232            | 0,50                   |                     |
| Kinder Morgan Inc, 5,200 %, 01/06/33                             | USD | 225 000   | 218 042            | 0,82                   |                     |
| Mars Inc, 4,750 %, 20/04/33 144A (i)                             | USD | 60 000    | 59 474             | 0,22                   |                     |
| McCormick & Co Inc, 4,950 %, 15/04/33                            | USD | 70 000    | 68 710             | 0,26                   |                     |
| Meta Platforms Inc, 4,450 %, 15/08/52                            | USD | 150 000   | 130 431            | 0,49                   |                     |
| Morgan Stanley, 5,164 %, 20/04/29 (iii)                          | USD | 70 000    | 69 145             | 0,26                   |                     |
| NextEra Energy Capital Holdings Inc, 6,051 %, 01/03/25           | USD | 30 000    | 30 113             | 0,11                   |                     |
| Republic Services Inc, 5,000 %, 01/04/34                         | USD | 20 000    | 19 955             | 0,08                   |                     |
| Take-Two Interactive Software Inc, 4,950 %, 28/03/28             | USD | 125 000   | 123 520            | 0,47                   |                     |
| T-Mobile USA Inc, 5,050 %, 15/07/33                              | USD | 125 000   | 122 737            | 0,46                   |                     |
| Truist Financial Corp, 6,047 %, 08/06/27 (iii)                   | USD | 95 000    | 95 039             | 0,36                   |                     |
| United Parcel Service Inc, 4,875 %, 03/03/33                     | USD | 110 000   | 111 160            | 0,42                   |                     |
| United States Treasury Bill, 5,023 %, 20/07/23                   | USD | 350 000   | 349 083            | 1,32                   |                     |
| United States Treasury Bill, 5,051 %, 31/08/23                   | USD | 820 000   | 813 244            | 3,07                   |                     |
| United States Treasury Bill, 5,113 %, 15/08/23                   | USD | 2 240 000 | 2 225 872          | 8,41                   |                     |
| United States Treasury Bill, 5,270 %, 17/10/23                   | USD | 1 450 000 | 1 427 445          | 5,39                   |                     |
| United States Treasury Bill, 5,378 %, 09/11/23                   | USD | 190 000   | 186 368            | 0,70                   |                     |
| UnitedHealth Group Inc, 4,500 %, 15/04/33                        | USD | 125 000   | 121 750            | 0,46                   |                     |
| Utah Acquisition Sub Inc, 5,250 %, 15/06/46                      | USD | 15 000    | 11 826             | 0,04                   |                     |
| Warnermedia Holdings Inc, 6,412 %, 15/03/26                      | USD | 65 000    | 65 054             | 0,25                   |                     |
| Wells Fargo & Co, 5,389 %, 24/04/34 (iii)                        | USD | 76 000    | 75 515             | 0,29                   |                     |
| Western Midstream Operating LP, 6,150 %, 01/04/33                | USD | 10 000    | 10 079             | 0,04                   |                     |
|                                                                  |     |           | 7 078 610          | 26,74                  |                     |

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|  |  | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|--|--|--------------------|------------------------|---------------------|
|--|--|--------------------|------------------------|---------------------|

**OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME  
(suite)**

**OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)**

**Uruguay - 1,82 % (31 décembre 2022 : 0,16 %)**

|                                             |     |            |         |      |
|---------------------------------------------|-----|------------|---------|------|
| Republic of Uruguay, 8,250 %, 21/05/31 (ii) | UYU | 19 567 000 | 480 864 | 1,82 |
|                                             |     |            | 480 864 | 1,82 |

|                                               |  |  |                   |              |
|-----------------------------------------------|--|--|-------------------|--------------|
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES</b> |  |  | <b>12 182 528</b> | <b>46,02</b> |
|-----------------------------------------------|--|--|-------------------|--------------|

|                                                                                |  |  |                   |              |
|--------------------------------------------------------------------------------|--|--|-------------------|--------------|
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES<br/>OBLIGATIONS À MOYEN TERME</b> |  |  | <b>12 182 528</b> | <b>46,02</b> |
|--------------------------------------------------------------------------------|--|--|-------------------|--------------|

|  |  | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|--|--|---------|------------------------|---------------------|
|--|--|---------|------------------------|---------------------|

**ACTIONS PRIVILÉGIÉES NON CONVERTIBLES – 0,00 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 :  
0,00 %)**

**Allemagne - 0,00 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)**

|                                 |     |   |     |      |
|---------------------------------|-----|---|-----|------|
| Dr Ing hc F Porsche AG 144A (i) | EUR | 3 | 372 | 0,00 |
|                                 |     |   | 372 | 0,00 |

|                                                            |  |  |            |             |
|------------------------------------------------------------|--|--|------------|-------------|
| <b>TOTAL DES ACTIONS PRIVILÉGIÉES NON<br/>CONVERTIBLES</b> |  |  | <b>372</b> | <b>0,00</b> |
|------------------------------------------------------------|--|--|------------|-------------|

**ACTIONS ORDINAIRES – 28,18 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 47,04 %)**

**Autriche – 0,02 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)**

|                     |     |    |       |      |
|---------------------|-----|----|-------|------|
| Erste Group Bank AG | EUR | 12 | 420   | 0,00 |
| OMV AG              | EUR | 9  | 381   | 0,00 |
| Verbund AG          | EUR | 53 | 4 247 | 0,02 |
| voestalpine AG      | EUR | 12 | 431   | 0,00 |
|                     |     |    | 5 479 | 0,02 |

**Belgique – 0,00 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)**

|           |     |   |     |      |
|-----------|-----|---|-----|------|
| Solvay SA | EUR | 4 | 446 | 0,00 |
|           |     |   | 446 | 0,00 |

**Bermudes - 0,03 % (31 décembre 2022 : 0,01 %)**

|                            |     |    |       |      |
|----------------------------|-----|----|-------|------|
| Arch Capital Group Ltd     | USD | 51 | 3 817 | 0,01 |
| Everest Re Group Ltd       | USD | 6  | 2 051 | 0,01 |
| RenaissanceRe Holdings Ltd | USD | 17 | 3 171 | 0,01 |
|                            |     |    | 9 039 | 0,03 |

**Brésil – 0,31 % (31 décembre 2022 : 0,38 %)**

|                                             |     |       |        |      |
|---------------------------------------------|-----|-------|--------|------|
| Alupar Investimento SA                      | BRL | 3 120 | 19 390 | 0,07 |
| Cia de Saneamento de Minas Gerais Copasa MG | BRL | 2 400 | 10 522 | 0,04 |
| Metalurgica Gerdau SA                       | BRL | 6 500 | 15 927 | 0,06 |
| Odontoprev SA                               | BRL | 1 200 | 3 122  | 0,01 |
| Santos Brasil Participacoes SA              | BRL | 9 600 | 20 219 | 0,08 |
| SLC Agricola SA                             | BRL | 1 760 | 13 944 | 0,05 |
|                                             |     |       | 83 124 | 0,31 |

**Canada – 0,01 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)**

|                         |     |   |       |      |
|-------------------------|-----|---|-------|------|
| Lululemon Athletica Inc | USD | 6 | 2 271 | 0,01 |
|                         |     |   | 2 271 | 0,01 |

## LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

| Calendrier des investissements                        |     | Au 30 juin 2023 |                        |                     |
|-------------------------------------------------------|-----|-----------------|------------------------|---------------------|
|                                                       |     | Actions         | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                     |     |                 |                        |                     |
| <b>Chili – 0,01 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>     |     |                 |                        |                     |
| Antofagasta PLC                                       | GBP | 144             | 2 675                  | 0,01                |
|                                                       |     |                 | 2 675                  | 0,01                |
| <b>Chine – 0,32 % (31 décembre 2022 : 0,59 %)</b>     |     |                 |                        |                     |
| A-Living Smart City Services Co Ltd 144A (i)          | HKD | 9 000           | 5 788                  | 0,02                |
| China Nonferrous Mining Corp Ltd                      | HKD | 32 000          | 15 109                 | 0,06                |
| China Resources Medical Holdings Co Ltd               | HKD | 19 000          | 14 571                 | 0,05                |
| CIFI Ever Sunshine Services Group Ltd                 | HKD | 22 729          | 8 846                  | 0,03                |
| Fufeng Group Ltd                                      | HKD | 29 000          | 14 654                 | 0,06                |
| Hello Group Inc                                       | USD | 1 623           | 15 597                 | 0,06                |
| Jinan Acetate Chemical Co Ltd                         | TWD | 568             | 10 067                 | 0,04                |
|                                                       |     |                 | 84 632                 | 0,32                |
| <b>Danemark – 0,01 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>  |     |                 |                        |                     |
| Novo Nordisk A/S                                      | DKK | 18              | 2 900                  | 0,01                |
|                                                       |     |                 | 2 900                  | 0,01                |
| <b>Finlande - 0,02 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>  |     |                 |                        |                     |
| Fortum OYJ                                            | EUR | 28              | 375                    | 0,00                |
| Kesko OYJ                                             | EUR | 19              | 357                    | 0,00                |
| Nokia OYJ                                             | EUR | 81              | 339                    | 0,00                |
| Nordea Bank Abp                                       | SEK | 194             | 2 107                  | 0,01                |
| Wartsila OYJ Abp                                      | EUR | 306             | 3 444                  | 0,01                |
|                                                       |     |                 | 6 622                  | 0,02                |
| <b>France – 0,12 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>    |     |                 |                        |                     |
| Alstom SA                                             | EUR | 104             | 3 100                  | 0,02                |
| AXA SA                                                | EUR | 93              | 2 742                  | 0,01                |
| BNP Paribas SA                                        | EUR | 7               | 441                    | 0,00                |
| Bouygues SA                                           | EUR | 12              | 403                    | 0,00                |
| Carrefour SA                                          | EUR | 126             | 2 386                  | 0,01                |
| Cie de Saint-Gobain                                   | EUR | 7               | 426                    | 0,00                |
| Cie Générale des Établissements Michelin SCA          | EUR | 13              | 384                    | 0,00                |
| Credit Agricole SA                                    | EUR | 36              | 427                    | 0,00                |
| Eiffage SA                                            | EUR | 4               | 417                    | 0,00                |
| EssilorLuxottica SA                                   | EUR | 15              | 2 825                  | 0,01                |
| Orange SA                                             | EUR | 33              | 385                    | 0,00                |
| Pernod Ricard SA                                      | EUR | 12              | 2 650                  | 0,01                |
| Remy Cointreau SA                                     | EUR | 11              | 1 764                  | 0,01                |
| Renault SA                                            | EUR | 10              | 421                    | 0,00                |
| Sanofi                                                | EUR | 4               | 428                    | 0,00                |
| Teleperformance                                       | EUR | 20              | 3 348                  | 0,02                |
| Valeo                                                 | EUR | 141             | 3 020                  | 0,01                |
| Veolia Environnement SA                               | EUR | 95              | 3 000                  | 0,01                |
| Vinci SA                                              | EUR | 3               | 348                    | 0,00                |
| Vivendi SE                                            | EUR | 272             | 2 494                  | 0,01                |
|                                                       |     |                 | 31 409                 | 0,12                |
| <b>Allemagne – 0,14 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b> |     |                 |                        |                     |
| Bayer AG                                              | EUR | 6               | 332                    | 0,00                |
| Bayerische Motoren Werke AG                           | EUR | 4               | 491                    | 0,01                |
| Brenntag SE                                           | EUR | 5               | 389                    | 0,00                |
| Commerzbank AG                                        | EUR | 280             | 3 101                  | 0,02                |
| Continental AG                                        | EUR | 39              | 2 940                  | 0,01                |
| Daimler Truck Holding AG                              | EUR | 12              | 432                    | 0,00                |
| Deutsche Bank AG                                      | EUR | 254             | 2 665                  | 0,01                |

## LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                               |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|---------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                             |     |         |                        |                     |
| <b>Allemagne - 0,14 % (31 décembre 2022 : 0,00 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| Deutsche Lufthansa AG                                         | EUR | 38      | 389                    | 0,00                |
| Deutsche Post AG                                              | EUR | 8       | 390                    | 0,00                |
| Fresenius SE & Co KGaA                                        | EUR | 15      | 415                    | 0,00                |
| HelloFresh SE                                                 | EUR | 194     | 4 783                  | 0,02                |
| Infineon Technologies AG                                      | EUR | 73      | 3 009                  | 0,01                |
| Mercedes-Benz Group AG                                        | EUR | 5       | 402                    | 0,00                |
| Porsche Automobil Holding SE                                  | EUR | 7       | 421                    | 0,00                |
| Rheinmetall AG                                                | EUR | 9       | 2 463                  | 0,01                |
| RWE AG                                                        | EUR | 9       | 391                    | 0,00                |
| Sartorius AG                                                  | EUR | 6       | 2 076                  | 0,01                |
| Siemens AG                                                    | EUR | 18      | 2 996                  | 0,01                |
| Siemens Energy AG                                             | EUR | 134     | 2 365                  | 0,01                |
| Symrise AG                                                    | EUR | 25      | 2 619                  | 0,01                |
| Volkswagen AG                                                 | EUR | 3       | 402                    | 0,00                |
| Zalando SE 144A (i)                                           | EUR | 99      | 2 847                  | 0,01                |
|                                                               |     |         | 36 318                 | 0,14                |
| <b>Grèce - 0,12 % (31 décembre 2022 : 0,04 %)</b>             |     |         |                        |                     |
| Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA                        | EUR | 445     | 11 263                 | 0,04                |
| Piraeus Financial Holdings SA                                 | EUR | 6 020   | 19 743                 | 0,08                |
|                                                               |     |         | 31 006                 | 0,12                |
| <b>Hong Kong - 0,13 % (31 décembre 2022 : 0,12 %)</b>         |     |         |                        |                     |
| Prudential PLC                                                | GBP | 213     | 3 002                  | 0,01                |
| Shougang Fushan Resources Group Ltd                           | HKD | 54 000  | 13 575                 | 0,05                |
| Skyworth Group Ltd                                            | HKD | 12 000  | 5 298                  | 0,02                |
| SSY Group Ltd                                                 | HKD | 18 000  | 11 484                 | 0,05                |
|                                                               |     |         | 33 359                 | 0,13                |
| <b>Inde - 1,59 % (31 décembre 2022 : 1,69 %)</b>              |     |         |                        |                     |
| Allcargo Terminals Ltd                                        | INR | 1 509   | 702                    | 0,00                |
| Ashok Leyland Ltd                                             | INR | 2 335   | 4 762                  | 0,02                |
| Astral Ltd                                                    | INR | 698     | 16 875                 | 0,06                |
| Canara Bank                                                   | INR | 4 731   | 17 416                 | 0,07                |
| Coromandel International Ltd                                  | INR | 1 407   | 16 264                 | 0,06                |
| Cummins India Ltd                                             | INR | 921     | 21 834                 | 0,08                |
| Cyient Ltd                                                    | INR | 726     | 13 301                 | 0,05                |
| Deepak Nitrite Ltd                                            | INR | 303     | 8 031                  | 0,03                |
| Finolex Cables Ltd                                            | INR | 1 588   | 16 686                 | 0,06                |
| GHCL Textiles Ltd                                             | INR | 1 158   | 1 052                  | 0,00                |
| Glenmark Pharmaceuticals Ltd                                  | INR | 1 662   | 13 716                 | 0,05                |
| Granules India Ltd                                            | INR | 2 166   | 7 848                  | 0,03                |
| Gujarat Narmada Valley Fertilizers & Chemicals Ltd            | INR | 1 323   | 9 656                  | 0,04                |
| Hindustan Copper Ltd                                          | INR | 6 028   | 8 524                  | 0,03                |
| Indian Bank                                                   | INR | 2 765   | 9 869                  | 0,04                |
| Karnataka Bank Ltd                                            | INR | 9 739   | 22 414                 | 0,08                |
| Karur Vysya Bank Ltd                                          | INR | 12 946  | 19 655                 | 0,07                |
| L&T Technology Services Ltd 144A (i)                          | INR | 252     | 12 084                 | 0,05                |
| Mahanagar Gas Ltd                                             | INR | 1 218   | 15 589                 | 0,06                |
| National Aluminium Co Ltd                                     | INR | 9 461   | 9 480                  | 0,04                |
| NCC Ltd                                                       | INR | 8 358   | 12 409                 | 0,05                |
| Oracle Financial Services Software Ltd                        | INR | 401     | 18 883                 | 0,07                |
| Persistent Systems Ltd                                        | INR | 162     | 9 888                  | 0,04                |
| Praj Industries Ltd                                           | INR | 2 218   | 10 206                 | 0,04                |
| Raymond Ltd                                                   | INR | 822     | 16 951                 | 0,06                |

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                          |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|----------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                        |     |         |                        |                     |
| <b>Inde – 1,59 % (31 décembre 2022 : 1,69 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| REC Ltd                                                  | INR | 11 859  | 23 823                 | 0,09                |
| Schaeffler India Ltd                                     | INR | 453     | 17 173                 | 0,07                |
| Sun TV Network Ltd                                       | INR | 2 430   | 12 959                 | 0,05                |
| Tanla Platforms Ltd                                      | INR | 544     | 6 777                  | 0,03                |
| Tata Communications Ltd                                  | INR | 595     | 11 597                 | 0,04                |
| Torrent Power Ltd                                        | INR | 777     | 5 825                  | 0,02                |
| TransIndia Realty & Logistics Parks Ltd                  | INR | 1 509   | 702                    | 0,00                |
| Triveni Turbine Ltd                                      | INR | 3 817   | 18 851                 | 0,07                |
| Tube Investments of India Ltd                            | INR | 260     | 10 080                 | 0,04                |
|                                                          |     |         | 421 882                | 1,59                |
| <b>Indonésie – 0,11 % (31 décembre 2022 : 0,24 %)</b>    |     |         |                        |                     |
| AKR Corporindo Tbk PT                                    | IDR | 80 600  | 7 634                  | 0,03                |
| Indo Tambangraya Megah Tbk PT                            | IDR | 5 400   | 8 689                  | 0,03                |
| Perusahaan Gas Negara Tbk PT                             | IDR | 145 600 | 12 674                 | 0,05                |
|                                                          |     |         | 28 997                 | 0,11                |
| <b>Irlande – 0,10 % (31 décembre 2022 : 0,17 %)</b>      |     |         |                        |                     |
| AIB Group PLC                                            | EUR | 692     | 2 907                  | 0,01                |
| Allegion PLC                                             | USD | 96      | 11 522                 | 0,04                |
| Bank of Ireland Group PLC                                | EUR | 277     | 2 641                  | 0,01                |
| CRH PLC                                                  | EUR | 56      | 3 085                  | 0,01                |
| DCC PLC                                                  | GBP | 7       | 391                    | 0,00                |
| Trane Technologies PLC                                   | USD | 38      | 7 268                  | 0,03                |
|                                                          |     |         | 27 814                 | 0,10                |
| <b>Israël - 0,04 % (31 décembre 2022 : 0,01 %)</b>       |     |         |                        |                     |
| Wix.com Ltd                                              | USD | 122     | 9 545                  | 0,04                |
|                                                          |     |         | 9 545                  | 0,04                |
| <b>Italie – 0,04 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>       |     |         |                        |                     |
| ENI SpA                                                  | EUR | 28      | 403                    | 0,00                |
| FinecoBank Banca Fineco SpA                              | EUR | 281     | 3 775                  | 0,02                |
| Telecom Italia SpA                                       | EUR | 8 756   | 2 463                  | 0,01                |
| UniCredit SpA                                            | EUR | 129     | 2 993                  | 0,01                |
|                                                          |     |         | 9 634                  | 0,04                |
| <b>Jordanie - 0,01 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>     |     |         |                        |                     |
| Hikma Pharmaceuticals PLC                                | GBP | 115     | 2 764                  | 0,01                |
|                                                          |     |         | 2 764                  | 0,01                |
| <b>Luxembourg - 0,02 % (31 décembre 2022 : 0,12 %)</b>   |     |         |                        |                     |
| ArcelorMittal SA                                         | EUR | 13      | 353                    | 0,00                |
| Tenaris SA                                               | EUR | 255     | 3 816                  | 0,02                |
|                                                          |     |         | 4 169                  | 0,02                |
| <b>Malaisie – 0,09 % (31 décembre 2022 : 0,06 %)</b>     |     |         |                        |                     |
| Inari Amertron Bhd                                       | MYR | 25 200  | 14 793                 | 0,06                |
| TIME dotCom Bhd                                          | MYR | 7 307   | 8 141                  | 0,03                |
|                                                          |     |         | 22 934                 | 0,09                |
| <b>Mexique – 0,25 % (31 décembre 2022 : 0,40 %)</b>      |     |         |                        |                     |
| Alsea SAB de CV                                          | MXN | 6 892   | 22 403                 | 0,08                |
| Banco del Bajío SA 144A (i)                              | MXN | 4 891   | 14 912                 | 0,06                |
| Genomma Lab Internacional SAB de CV                      | MXN | 13 186  | 10 133                 | 0,04                |
| Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV           | MXN | 1 658   | 17 595                 | 0,07                |
|                                                          |     |         | 65 043                 | 0,25                |
| <b>Pays-Bas – 0,09 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>     |     |         |                        |                     |
| Adyen NV 144A (i)                                        | EUR | 1       | 1 730                  | 0,01                |

## LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                              |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                            |     |         |                        |                     |
| <b>Pays-Bas – 0,09 % (31 décembre 2022 : 0,00 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| Akzo Nobel NV                                                | EUR | 37      | 3 016                  | 0,01                |
| Argenx SE*                                                   | USD | 7       | 2 713                  | 0,01                |
| ASML Holding NV                                              | EUR | 4       | 2 893                  | 0,01                |
| EXOR NV                                                      | EUR | 34      | 3 030                  | 0,01                |
| ING Groep NV                                                 | EUR | 208     | 2 800                  | 0,01                |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV                                | EUR | 12      | 409                    | 0,01                |
| Koninklijke DSM NV                                           | EUR | 23      | 2 862                  | 0,01                |
| OCI NV                                                       | EUR | 14      | 336                    | 0,00                |
| Prosus NV                                                    | EUR | 35      | 2 563                  | 0,01                |
| Randstad NV                                                  | EUR | 6       | 316                    | 0,00                |
| Stellantis NV                                                | EUR | 22      | 386                    | 0,00                |
|                                                              |     |         | 23 054                 | 0,09                |
| <b>Norvège – 0,02 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>          |     |         |                        |                     |
| Aker BP ASA                                                  | NOK | 145     | 3 408                  | 0,02                |
| Mowi ASA                                                     | NOK | 22      | 350                    | 0,00                |
| Norsk Hydro ASA                                              | NOK | 56      | 333                    | 0,00                |
| Yara International ASA                                       | NOK | 9       | 318                    | 0,00                |
|                                                              |     |         | 4 409                  | 0,02                |
| <b>Panama - 0,03 % (31 décembre 2022 : 0,01 %)</b>           |     |         |                        |                     |
| Copa Holdings SA                                             | USD | 73      | 8 072                  | 0,03                |
|                                                              |     |         | 8 072                  | 0,03                |
| <b>Pologne – 0,06 % (31 décembre 2022 : 0,06 %)</b>          |     |         |                        |                     |
| Polski Koncern Naftowy ORLEN SA                              | PLN | 1 091   | 17 296                 | 0,06                |
|                                                              |     |         | 17 296                 | 0,06                |
| <b>Portugal – 0,02 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>         |     |         |                        |                     |
| EDP - Energias de Portugal SA                                | EUR | 526     | 2 569                  | 0,01                |
| Galp Energia SGPS SA                                         | EUR | 250     | 2 924                  | 0,01                |
|                                                              |     |         | 5 493                  | 0,02                |
| <b>Porto Rico – 0,01 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>       |     |         |                        |                     |
| Popular Inc                                                  | USD | 57      | 3 450                  | 0,01                |
|                                                              |     |         | 3 450                  | 0,01                |
| <b>Arabie saoudite – 0,33 % (31 décembre 2022 : 0,22 %)</b>  |     |         |                        |                     |
| Al Hammadi Holding                                           | SAR | 1 264   | 20 524                 | 0,08                |
| Alamar Foods                                                 | SAR | 401     | 14 006                 | 0,05                |
| Almunajem Foods Co                                           | SAR | 989     | 17 271                 | 0,07                |
| Astra Industrial Group                                       | SAR | 783     | 18 183                 | 0,07                |
| Dallah Healthcare Co                                         | SAR | 370     | 16 553                 | 0,06                |
|                                                              |     |         | 86 537                 | 0,33                |
| <b>Afrique du Sud – 0,21 % (31 décembre 2022 : 0,25 %)</b>   |     |         |                        |                     |
| AVI Ltd                                                      | ZAR | 2 896   | 10 438                 | 0,04                |
| Investec Ltd                                                 | ZAR | 1 904   | 10 685                 | 0,04                |
| Momentum Metropolitan Holdings                               | ZAR | 8 568   | 8 191                  | 0,03                |
| Sappi Ltd                                                    | ZAR | 3 294   | 6 802                  | 0,03                |
| Thungela Resources Ltd                                       | ZAR | 581     | 4 550                  | 0,02                |
| Truworths International Ltd                                  | ZAR | 4 623   | 13 851                 | 0,05                |
|                                                              |     |         | 54 517                 | 0,21                |
| <b>Corée du Sud – 1,08 % (31 décembre 2022 : 0,95 %)</b>     |     |         |                        |                     |
| BNK Financial Group Inc                                      | KRW | 1 533   | 8 063                  | 0,03                |
| Caregen Co Ltd                                               | KRW | 59      | 11 620                 | 0,04                |
| Daeduck Electronics Co Ltd                                   | KRW | 615     | 15 052                 | 0,06                |
| Daewoong Pharmaceutical Co Ltd                               | KRW | 88      | 6 431                  | 0,02                |

## LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                  |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                                |     |         |                        |                     |
| <b>Corée du Sud – 1,08 % (31 décembre 2022 : 0,95 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| DB HiTek Co Ltd                                                  | KRW | 299     | 14 319                 | 0,05                |
| DGB Financial Group Inc                                          | KRW | 2 474   | 13 650                 | 0,05                |
| GOLFZON Co Ltd.                                                  | KRW | 113     | 9 922                  | 0,04                |
| Hansae Co Ltd.                                                   | KRW | 311     | 5 063                  | 0,02                |
| Hanwha Aerospace Co Ltd.                                         | KRW | 214     | 20 691                 | 0,08                |
| Hanwha Corp                                                      | KRW | 544     | 12 365                 | 0,05                |
| Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd                           | KRW | 721     | 16 990                 | 0,06                |
| JB Financial Group Co Ltd                                        | KRW | 1 236   | 7 945                  | 0,03                |
| JYP Entertainment Corp                                           | KRW | 185     | 18 364                 | 0,07                |
| KIWOOM Securities Co Ltd                                         | KRW | 142     | 9 527                  | 0,04                |
| LOTTE Fine Chemical Co Ltd                                       | KRW | 173     | 9 112                  | 0,04                |
| Lutronic Corp                                                    | KRW | 864     | 23 868                 | 0,09                |
| LX INTERNATIONAL CORP                                            | KRW | 364     | 9 959                  | 0,04                |
| Medytox Inc                                                      | KRW | 19      | 3 396                  | 0,01                |
| PharmaResearch Co Ltd                                            | KRW | 191     | 20 830                 | 0,08                |
| SL Corp                                                          | KRW | 516     | 14 372                 | 0,05                |
| SM Entertainment Co Ltd                                          | KRW | 136     | 11 023                 | 0,04                |
| Youngone Corp                                                    | KRW | 465     | 22 762                 | 0,09                |
|                                                                  |     |         | 285 324                | 1,08                |
| <b>Espagne – 0,03 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>              |     |         |                        |                     |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA                               | EUR | 56      | 430                    | 0,00                |
| Banco Santander SA                                               | EUR | 107     | 395                    | 0,00                |
| CaixaBank SA                                                     | EUR | 509     | 2 103                  | 0,01                |
| Corp ACCIONA Energias Renovables SA                              | EUR | 72      | 2 405                  | 0,01                |
| Endesa SA                                                        | EUR | 18      | 386                    | 0,00                |
| Grifols SA                                                       | EUR | 212     | 2 715                  | 0,01                |
| Repsol SA                                                        | EUR | 25      | 364                    | 0,00                |
| Telefónica SA                                                    | EUR | 95      | 385                    | 0,00                |
|                                                                  |     |         | 9 183                  | 0,03                |
| <b>Suède – 0,10 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                |     |         |                        |                     |
| Embracer Group AB                                                | SEK | 566     | 1 413                  | 0,01                |
| EQT AB                                                           | SEK | 141     | 2 707                  | 0,01                |
| Evolution AB 144A (i)                                            | SEK | 21      | 2 655                  | 0,01                |
| H & M Hennes & Mauritz AB                                        | SEK | 311     | 5 332                  | 0,02                |
| Nibe Industrier AB                                               | SEK | 261     | 2 474                  | 0,01                |
| Sandvik AB                                                       | SEK | 139     | 2 705                  | 0,01                |
| Securitas AB                                                     | SEK | 47      | 385                    | 0,00                |
| Skanska AB                                                       | SEK | 25      | 350                    | 0,00                |
| Spotify Technology SA                                            | USD | 37      | 5 940                  | 0,02                |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson                                  | SEK | 70      | 379                    | 0,00                |
| Telia Co AB                                                      | SEK | 1 069   | 2 341                  | 0,01                |
| Volvo AB                                                         | SEK | 20      | 413                    | 0,00                |
|                                                                  |     |         | 27 094                 | 0,10                |
| <b>Suisse – 0,16 % (31 décembre 2022 : 0,09 %)</b>               |     |         |                        |                     |
| Chubb Ltd                                                        | USD | 31      | 5 969                  | 0,02                |
| Cie Financiere Richemont SA                                      | CHF | 18      | 3 051                  | 0,01                |
| Clariant AG                                                      | CHF | 170     | 2 455                  | 0,01                |
| Garmin Ltd                                                       | USD | 245     | 25 551                 | 0,10                |
| Glencore PLC                                                     | GBP | 69      | 390                    | 0,00                |
| Roche Holding AG                                                 | CHF | 1       | 306                    | 0,00                |
| Roche Holding AG                                                 | CHF | 1       | 328                    | 0,00                |
| SIG Group AG                                                     | CHF | 107     | 2 952                  | 0,01                |

## LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

| Calendrier des investissements                             |     | Au 30 juin 2023 |                        |                     |
|------------------------------------------------------------|-----|-----------------|------------------------|---------------------|
|                                                            |     | Actions         | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                          |     |                 |                        |                     |
| <b>Suisse - 0,16 % (31 décembre 2022 : 0,09 %) (suite)</b> |     |                 |                        |                     |
| Sika AG                                                    | CHF | 10              | 2 858                  | 0,01                |
|                                                            |     |                 | 43 860                 | 0,16                |
| <b>Taiwan – 1,81 % (31 décembre 2022 : 1,16 %)</b>         |     |                 |                        |                     |
| Alexander Marine Co Ltd                                    | TWD | 495             | 9 314                  | 0,03                |
| Asia Vital Components Co Ltd                               | TWD | 1 900           | 16 533                 | 0,06                |
| Bora Pharmaceuticals Co Ltd.                               | TWD | 1 000           | 25 012                 | 0,09                |
| Chicony Electronics Co Ltd                                 | TWD | 5 800           | 18 250                 | 0,07                |
| China Motor Corp                                           | TWD | 5 000           | 14 930                 | 0,06                |
| Compeq Manufacturing Co Ltd                                | TWD | 5 000           | 7 128                  | 0,03                |
| Ever Supreme Bio Technology Co Ltd                         | TWD | 1 099           | 6 899                  | 0,03                |
| Fitipower Integrated Technology Inc                        | TWD | 3 000           | 13 774                 | 0,05                |
| FLEXium Interconnect Inc                                   | TWD | 3 000           | 8 920                  | 0,03                |
| Formosa International Hotels Corp                          | TWD | 1 900           | 15 831                 | 0,06                |
| Fusheng Precision Co Ltd                                   | TWD | 3 000           | 21 288                 | 0,08                |
| Gigabyte Technology Co Ltd                                 | TWD | 2 000           | 15 637                 | 0,06                |
| Global Mixed Mode Technology Inc                           | TWD | 1 000           | 6 245                  | 0,02                |
| Grape King Bio Ltd                                         | TWD | 3 167           | 17 083                 | 0,06                |
| Great Tree Pharmacy Co Ltd                                 | TWD | 1 000           | 12 137                 | 0,05                |
| International Games System Co Ltd                          | TWD | 1 000           | 19 843                 | 0,07                |
| ITE Technology Inc                                         | TWD | 2 000           | 7 224                  | 0,03                |
| King Yuan Electronics Co Ltd                               | TWD | 4 000           | 7 321                  | 0,03                |
| Primax Electronics Ltd                                     | TWD | 6 000           | 12 676                 | 0,05                |
| Radiant Opto-Electronics Corp                              | TWD | 4 000           | 14 128                 | 0,05                |
| Raydium Semiconductor Corp                                 | TWD | 1 000           | 10 307                 | 0,04                |
| Sanyang Motor Co Ltd                                       | TWD | 6 000           | 17 242                 | 0,06                |
| Sercomm Corp                                               | TWD | 3 000           | 10 114                 | 0,04                |
| Simplo Technology Co Ltd                                   | TWD | 1 700           | 17 931                 | 0,07                |
| Sino-American Silicon Products Inc                         | TWD | 3 000           | 15 556                 | 0,06                |
| Sitronix Technology Corp                                   | TWD | 2 000           | 15 059                 | 0,06                |
| Sporton International Inc                                  | TWD | 2 000           | 16 311                 | 0,06                |
| Synmosa Biopharma Corp                                     | TWD | 3 003           | 4 238                  | 0,02                |
| TaiDoc Technology Corp                                     | TWD | 1 000           | 5 972                  | 0,02                |
| Taiwan Surface Mounting Technology Corp                    | TWD | 4 795           | 15 473                 | 0,06                |
| Ton Yi Industrial Corp                                     | TWD | 6 784           | 4 302                  | 0,02                |
| Tong Yang Industry Co Ltd                                  | TWD | 8 000           | 13 537                 | 0,05                |
| Topkey Corp                                                | TWD | 2 025           | 12 549                 | 0,05                |
| TTY Biopharm Co Ltd                                        | TWD | 7 000           | 17 621                 | 0,07                |
| Tung Thih Electronic Co Ltd                                | TWD | 2 000           | 9 344                  | 0,03                |
| United Integrated Services Co Ltd                          | TWD | 1 000           | 7 000                  | 0,03                |
| Yulon Finance Corp                                         | TWD | 2 457           | 15 660                 | 0,06                |
|                                                            |     |                 | 478 389                | 1,81                |
| <b>Thaïlande – 0,34 % (31 décembre 2022 : 0,25 %)</b>      |     |                 |                        |                     |
| Bangkok Chain Hospital PCL                                 | THB | 28 200          | 14 078                 | 0,05                |
| Chularat Hospital PCL                                      | THB | 141 600         | 11 981                 | 0,05                |
| Ichitan Group PCL                                          | THB | 26 200          | 10 198                 | 0,04                |
| Mega Lifesciences PCL                                      | THB | 12 000          | 12 692                 | 0,05                |
| Sri Trang Agro-Industry PCL                                | THB | 12 600          | 6 041                  | 0,02                |
| Thanachart Capital PCL                                     | THB | 11 600          | 16 277                 | 0,06                |
| Tipco Asphalt PCL                                          | THB | 36 300          | 19 146                 | 0,07                |
|                                                            |     |                 | 90 413                 | 0,34                |
| <b>Royaume-Uni – 0,21 % (31 décembre 2022 : 0,19 %)</b>    |     |                 |                        |                     |
| 3i Group PLC                                               | GBP | 20              | 495                    | 0,00                |



NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                                 |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|-----------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                               |     |         |                        |                     |
| <b>Royaume-Uni – 0,21 % (31 décembre 2022 : 0,19 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| Ashtead Group PLC                                               | GBP | 34      | 2 353                  | 0,01                |
| AstraZeneca PLC                                                 | GBP | 20      | 2 867                  | 0,01                |
| Barclays PLC                                                    | GBP | 229     | 447                    | 0,00                |
| Barratt Developments PLC                                        | GBP | 69      | 363                    | 0,00                |
| Berkeley Group Holdings PLC                                     | GBP | 8       | 399                    | 0,00                |
| British American Tobacco PLC                                    | GBP | 11      | 365                    | 0,00                |
| BT Group PLC                                                    | GBP | 219     | 341                    | 0,00                |
| Capri Holdings Ltd                                              | USD | 75      | 2 692                  | 0,01                |
| CNH Industrial NV                                               | EUR | 161     | 2 319                  | 0,01                |
| Croda International PLC                                         | GBP | 34      | 2 432                  | 0,01                |
| GSK PLC                                                         | GBP | 22      | 388                    | 0,00                |
| HSBC Holdings PLC                                               | GBP | 359     | 2 838                  | 0,01                |
| Imperial Brands PLC                                             | GBP | 101     | 2 232                  | 0,01                |
| Informa PLC                                                     | GBP | 330     | 3 046                  | 0,01                |
| J Sainsbury PLC                                                 | GBP | 119     | 407                    | 0,00                |
| Janus Henderson Group PLC                                       | USD | 184     | 5 014                  | 0,02                |
| Kingfisher PLC                                                  | GBP | 119     | 351                    | 0,00                |
| Legal & General Group PLC                                       | GBP | 135     | 390                    | 0,00                |
| Lloyds Banking Group PLC                                        | GBP | 670     | 371                    | 0,00                |
| NatWest Group PLC                                               | GBP | 734     | 2 247                  | 0,01                |
| Ocado Group PLC                                                 | GBP | 679     | 4 903                  | 0,02                |
| Pentair PLC                                                     | USD | 91      | 5 879                  | 0,03                |
| Rolls-Royce Holdings PLC                                        | GBP | 1 522   | 2 923                  | 0,01                |
| SSE PLC                                                         | GBP | 128     | 2 996                  | 0,01                |
| Standard Chartered PLC                                          | GBP | 270     | 2 344                  | 0,01                |
| Vodafone Group PLC                                              | GBP | 351     | 330                    | 0,00                |
| Whitbread PLC                                                   | GBP | 78      | 3 358                  | 0,02                |
|                                                                 |     |         | 55 090                 | 0,21                |
| <b>États-Unis – 20,15 % (31 décembre 2022 : 39,94 %)</b>        |     |         |                        |                     |
| 3M Co                                                           | USD | 171     | 17 115                 | 0,06                |
| AbbVie Inc                                                      | USD | 216     | 29 102                 | 0,11                |
| Activision Blizzard Inc                                         | USD | 69      | 5 817                  | 0,02                |
| Acuity Brands Inc                                               | USD | 40      | 6 523                  | 0,02                |
| Adobe Inc                                                       | USD | 26      | 12 714                 | 0,05                |
| ADT Inc                                                         | USD | 683     | 4 118                  | 0,02                |
| Advance Auto Parts Inc                                          | USD | 389     | 27 347                 | 0,10                |
| Advanced Drainage Systems Inc                                   | USD | 62      | 7 054                  | 0,03                |
| AES Corp                                                        | USD | 1 206   | 25 000                 | 0,09                |
| Affiliated Managers Group Inc                                   | USD | 36      | 5 396                  | 0,02                |
| AGCO Corp                                                       | USD | 132     | 17 347                 | 0,07                |
| Agilent Technologies Inc                                        | USD | 347     | 41 727                 | 0,16                |
| agilon health Inc                                               | USD | 114     | 1 977                  | 0,01                |
| Air Products & Chemicals Inc                                    | USD | 33      | 9 884                  | 0,04                |
| Airbnb Inc                                                      | USD | 161     | 20 634                 | 0,08                |
| Albemarle Corp                                                  | USD | 24      | 5 354                  | 0,02                |
| Albertsons Cos Inc                                              | USD | 160     | 3 491                  | 0,01                |
| Allegro MicroSystems Inc                                        | USD | 94      | 4 243                  | 0,02                |
| Alliant Energy Corp                                             | USD | 113     | 5 930                  | 0,02                |
| Allison Transmission Holdings Inc                               | USD | 187     | 10 558                 | 0,04                |
| Alnylam Pharmaceuticals Inc                                     | USD | 25      | 4 748                  | 0,02                |
| Alphabet Inc                                                    | USD | 489     | 59 154                 | 0,22                |
| Alphabet Inc                                                    | USD | 588     | 70 384                 | 0,27                |

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                                  |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                                |     |         |                        |                     |
| <b>États-Unis – 20,15 % (31 décembre 2022 : 39,94 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| Altice USA Inc                                                   | USD | 1 580   | 4 772                  | 0,02                |
| Altria Group Inc                                                 | USD | 542     | 24 553                 | 0,09                |
| Amazon.com Inc                                                   | USD | 225     | 29 331                 | 0,11                |
| AMC Entertainment Holdings Inc                                   | USD | 1 073   | 4 721                  | 0,02                |
| Amdocs Ltd                                                       | USD | 61      | 6 030                  | 0,02                |
| Ameren Corp                                                      | USD | 69      | 5 635                  | 0,02                |
| American Airlines Group Inc                                      | USD | 354     | 6 351                  | 0,02                |
| American Electric Power Co Inc                                   | USD | 66      | 5 557                  | 0,02                |
| American International Group Inc                                 | USD | 299     | 17 204                 | 0,07                |
| American Water Works Co Inc                                      | USD | 94      | 13 418                 | 0,05                |
| Ameriprise Financial Inc                                         | USD | 56      | 18 601                 | 0,07                |
| AmerisourceBergen Corp                                           | USD | 37      | 7 120                  | 0,03                |
| Amgen Inc                                                        | USD | 112     | 24 866                 | 0,09                |
| Analog Devices Inc                                               | USD | 83      | 16 169                 | 0,06                |
| Aon PLC                                                          | USD | 109     | 37 627                 | 0,14                |
| APA Corp                                                         | USD | 232     | 7 927                  | 0,03                |
| Apple Inc                                                        | USD | 501     | 97 179                 | 0,37                |
| Applied Materials Inc                                            | USD | 40      | 5 782                  | 0,02                |
| Archer-Daniels-Midland Co                                        | USD | 174     | 13 147                 | 0,05                |
| Arista Networks Inc                                              | USD | 21      | 3 403                  | 0,01                |
| Arrow Electronics Inc                                            | USD | 27      | 3 867                  | 0,01                |
| AT&T Inc                                                         | USD | 1 163   | 18 550                 | 0,07                |
| Atmos Energy Corp                                                | USD | 55      | 6 399                  | 0,02                |
| Autodesk Inc                                                     | USD | 76      | 15 550                 | 0,06                |
| Automatic Data Processing Inc                                    | USD | 169     | 37 145                 | 0,14                |
| AutoNation Inc                                                   | USD | 39      | 6 420                  | 0,02                |
| AutoZone Inc                                                     | USD | 12      | 29 920                 | 0,11                |
| Avangrid Inc                                                     | USD | 274     | 10 324                 | 0,04                |
| Avis Budget Group Inc                                            | USD | 44      | 10 061                 | 0,04                |
| Avnet Inc                                                        | USD | 186     | 9 384                  | 0,04                |
| Axalta Coating Systems Ltd                                       | USD | 166     | 5 446                  | 0,02                |
| Axon Enterprise Inc                                              | USD | 26      | 5 073                  | 0,02                |
| Bank OZK                                                         | USD | 139     | 5 582                  | 0,02                |
| Becton Dickinson & Co                                            | USD | 24      | 6 336                  | 0,02                |
| Bentley Systems Inc                                              | USD | 45      | 2 440                  | 0,01                |
| Berkshire Hathaway Inc                                           | USD | 58      | 19 778                 | 0,07                |
| Best Buy Co Inc                                                  | USD | 65      | 5 327                  | 0,02                |
| Bill.com Holdings Inc                                            | USD | 46      | 5 375                  | 0,02                |
| Biogen Inc                                                       | USD | 11      | 3 133                  | 0,01                |
| BJ's Wholesale Club Holdings Inc                                 | USD | 34      | 2 142                  | 0,01                |
| Blackstone Inc                                                   | USD | 58      | 5 392                  | 0,02                |
| Blue Owl Capital Inc                                             | USD | 292     | 3 402                  | 0,01                |
| Boeing Co                                                        | USD | 10      | 2 112                  | 0,01                |
| Booking Holdings Inc                                             | USD | 8       | 21 603                 | 0,08                |
| Booz Allen Hamilton Holding Corp                                 | USD | 63      | 7 031                  | 0,03                |
| Boyd Gaming Corp                                                 | USD | 110     | 7 631                  | 0,03                |
| Bright Horizons Family Solutions Inc                             | USD | 63      | 5 824                  | 0,02                |
| Bristol-Myers Squibb Co                                          | USD | 333     | 21 295                 | 0,08                |
| Broadcom Inc                                                     | USD | 39      | 33 830                 | 0,13                |
| Brookfield Renewable Corp                                        | USD | 248     | 7 817                  | 0,03                |
| Brown-Forman Corp                                                | USD | 373     | 24 909                 | 0,09                |
| Brunswick Corp                                                   | USD | 83      | 7 191                  | 0,03                |

## LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                                  |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                                |     |         |                        |                     |
| <b>États-Unis – 20,15 % (31 décembre 2022 : 39,94 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| Builders FirstSource Inc                                         | USD | 226     | 30 736                 | 0,12                |
| Bunge Ltd                                                        | USD | 86      | 8 114                  | 0,03                |
| Cable One Inc                                                    | USD | 14      | 9 199                  | 0,03                |
| CACI International Inc                                           | USD | 20      | 6 817                  | 0,03                |
| Cadence Design Systems Inc                                       | USD | 57      | 13 368                 | 0,05                |
| Campbell Soup Co                                                 | USD | 106     | 4 845                  | 0,02                |
| Cardinal Health Inc                                              | USD | 191     | 18 063                 | 0,07                |
| Carrier Global Corp                                              | USD | 108     | 5 369                  | 0,02                |
| Casey's General Stores Inc                                       | USD | 38      | 9 267                  | 0,04                |
| Caterpillar Inc                                                  | USD | 78      | 19 192                 | 0,07                |
| Cboe Global Markets Inc                                          | USD | 250     | 34 502                 | 0,13                |
| Celanese Corp                                                    | USD | 31      | 3 590                  | 0,01                |
| CenterPoint Energy Inc                                           | USD | 204     | 5 947                  | 0,02                |
| CF Industries Holdings Inc                                       | USD | 118     | 8 192                  | 0,03                |
| CH Robinson Worldwide Inc                                        | USD | 69      | 6 510                  | 0,02                |
| Charter Communications Inc                                       | USD | 20      | 7 347                  | 0,03                |
| Chemed Corp                                                      | USD | 11      | 5 958                  | 0,02                |
| Chemours Co                                                      | USD | 109     | 4 021                  | 0,02                |
| Chevron Corp                                                     | USD | 120     | 18 882                 | 0,07                |
| Chipotle Mexican Grill Inc                                       | USD | 10      | 21 390                 | 0,08                |
| Choice Hotels International Inc                                  | USD | 61      | 7 169                  | 0,03                |
| Church & Dwight Co Inc                                           | USD | 68      | 6 816                  | 0,03                |
| Churchill Downs Inc                                              | USD | 96      | 13 360                 | 0,05                |
| Cigna Corp                                                       | USD | 19      | 5 331                  | 0,02                |
| Cirrus Logic Inc                                                 | USD | 45      | 3 645                  | 0,01                |
| Citigroup Inc                                                    | USD | 306     | 14 088                 | 0,05                |
| Clean Harbors Inc                                                | USD | 15      | 2 466                  | 0,01                |
| Clorox Co                                                        | USD | 98      | 15 586                 | 0,06                |
| CME Group Inc                                                    | USD | 31      | 5 744                  | 0,02                |
| CMS Energy Corp                                                  | USD | 97      | 5 699                  | 0,02                |
| Coca-Cola Co                                                     | USD | 583     | 35 108                 | 0,13                |
| Cognizant Technology Solutions Corp                              | USD | 55      | 3 590                  | 0,01                |
| Coinbase Global Inc                                              | USD | 46      | 3 291                  | 0,01                |
| Colgate-Palmolive Co                                             | USD | 145     | 11 171                 | 0,04                |
| Comcast Corp                                                     | USD | 465     | 19 321                 | 0,07                |
| Comerica Inc                                                     | USD | 75      | 3 177                  | 0,01                |
| Conagra Brands Inc                                               | USD | 285     | 9 610                  | 0,04                |
| Consolidated Edison Inc                                          | USD | 62      | 5 605                  | 0,02                |
| Constellation Brands Inc                                         | USD | 27      | 6 646                  | 0,03                |
| Constellation Energy Corp                                        | USD | 41      | 3 754                  | 0,01                |
| Cooper Cos Inc                                                   | USD | 13      | 4 985                  | 0,02                |
| Copart Inc                                                       | USD | 43      | 3 922                  | 0,02                |
| Core & Main Inc                                                  | USD | 306     | 9 590                  | 0,04                |
| Corebridge Financial Inc                                         | USD | 424     | 7 488                  | 0,03                |
| Coty Inc                                                         | USD | 462     | 5 678                  | 0,02                |
| Credit Acceptance Corp                                           | USD | 12      | 6 095                  | 0,02                |
| CrowdStrike Holdings Inc                                         | USD | 25      | 3 672                  | 0,01                |
| CSX Corp                                                         | USD | 171     | 5 831                  | 0,02                |
| Cummins Inc                                                      | USD | 30      | 7 355                  | 0,03                |
| CVS Health Corp                                                  | USD | 160     | 11 061                 | 0,04                |
| Danaher Corp                                                     | USD | 177     | 42 480                 | 0,16                |
| Darling Ingredients Inc                                          | USD | 208     | 13 268                 | 0,05                |

## LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                                  |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                                |     |         |                        |                     |
| <b>États-Unis – 20,15 % (31 décembre 2022 : 39,94 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| DaVita Inc                                                       | USD | 104     | 10 449                 | 0,04                |
| Deckers Outdoor Corp                                             | USD | 16      | 8 443                  | 0,03                |
| Deere & Co                                                       | USD | 8       | 3 242                  | 0,01                |
| Dell Technologies Inc                                            | USD | 85      | 4 599                  | 0,02                |
| Delta Air Lines Inc                                              | USD | 251     | 11 933                 | 0,05                |
| DexCom Inc                                                       | USD | 60      | 7 711                  | 0,03                |
| Dick's Sporting Goods Inc                                        | USD | 23      | 3 040                  | 0,01                |
| Discover Financial Services                                      | USD | 196     | 22 903                 | 0,09                |
| DISH Network Corp                                                | USD | 4 981   | 32 825                 | 0,12                |
| Dominion Energy Inc                                              | USD | 110     | 5 697                  | 0,02                |
| DoorDash Inc                                                     | USD | 51      | 3 897                  | 0,01                |
| DoubleVerify Holdings Inc                                        | USD | 114     | 4 437                  | 0,02                |
| Doximity Inc                                                     | USD | 148     | 5 035                  | 0,02                |
| DR Horton Inc                                                    | USD | 31      | 3 772                  | 0,01                |
| DraftKings Inc                                                   | USD | 259     | 6 882                  | 0,03                |
| Dropbox Inc                                                      | USD | 150     | 4 000                  | 0,02                |
| DTE Energy Co                                                    | USD | 55      | 6 051                  | 0,02                |
| Duke Energy Corp                                                 | USD | 348     | 31 230                 | 0,12                |
| DXC Technology Co                                                | USD | 214     | 5 718                  | 0,02                |
| Eagle Materials Inc                                              | USD | 59      | 10 999                 | 0,04                |
| East West Bancorp Inc                                            | USD | 88      | 4 646                  | 0,02                |
| Ecolab Inc                                                       | USD | 29      | 5 414                  | 0,02                |
| Edison International                                             | USD | 43      | 2 986                  | 0,01                |
| Edwards Lifesciences Corp                                        | USD | 408     | 38 487                 | 0,15                |
| Elastic NV                                                       | USD | 59      | 3 783                  | 0,01                |
| Electronic Arts Inc                                              | USD | 40      | 5 188                  | 0,02                |
| Elevance Health Inc                                              | USD | 10      | 4 443                  | 0,02                |
| Eli Lilly & Co                                                   | USD | 32      | 15 007                 | 0,06                |
| Enphase Energy Inc                                               | USD | 24      | 4 020                  | 0,02                |
| Entergy Corp                                                     | USD | 182     | 17 721                 | 0,07                |
| Enviva Inc                                                       | USD | 205     | 2 224                  | 0,01                |
| Equitable Holdings Inc                                           | USD | 211     | 5 731                  | 0,02                |
| Erie Indemnity Co                                                | USD | 15      | 3 150                  | 0,01                |
| Etsy Inc                                                         | USD | 25      | 2 115                  | 0,01                |
| Evergy Inc                                                       | USD | 99      | 5 784                  | 0,02                |
| Eversource Energy                                                | USD | 77      | 5 461                  | 0,02                |
| Exact Sciences Corp                                              | USD | 48      | 4 507                  | 0,02                |
| Expedia Group Inc                                                | USD | 106     | 11 595                 | 0,04                |
| Expeditors International of Washington Inc                       | USD | 63      | 7 631                  | 0,03                |
| Exxon Mobil Corp                                                 | USD | 259     | 27 778                 | 0,11                |
| F&G Annuities & Life Inc                                         | USD | 663     | 16 429                 | 0,06                |
| FactSet Research Systems Inc                                     | USD | 68      | 27 244                 | 0,10                |
| Fair Isaac Corp                                                  | USD | 4       | 3 237                  | 0,01                |
| First Citizens BancShares Inc                                    | USD | 2       | 2 567                  | 0,01                |
| First Republic Bank*                                             | USD | 1 236   | 680                    | 0,00                |
| First Solar Inc                                                  | USD | 75      | 14 257                 | 0,05                |
| FirstEnergy Corp                                                 | USD | 149     | 5 793                  | 0,02                |
| Five Below Inc                                                   | USD | 12      | 2 358                  | 0,01                |
| Floor & Decor Holdings Inc                                       | USD | 24      | 2 495                  | 0,01                |
| Flowers Foods Inc                                                | USD | 213     | 5 299                  | 0,02                |
| Fortinet Inc                                                     | USD | 1 063   | 80 352                 | 0,30                |
| Fortune Brands Innovations Inc                                   | USD | 83      | 5 972                  | 0,02                |

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                                  |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                                |     |         |                        |                     |
| <b>États-Unis – 20,15 % (31 décembre 2022 : 39,94 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| Freshpet Inc                                                     | USD | 51      | 3 356                  | 0,01                |
| GameStop Corp                                                    | USD | 133     | 3 225                  | 0,01                |
| Gartner Inc                                                      | USD | 16      | 5 605                  | 0,02                |
| Gen Digital Inc                                                  | USD | 306     | 5 676                  | 0,02                |
| General Dynamics Corp                                            | USD | 26      | 5 594                  | 0,02                |
| General Electric Co                                              | USD | 33      | 3 625                  | 0,01                |
| General Mills Inc                                                | USD | 264     | 20 249                 | 0,08                |
| General Motors Co                                                | USD | 94      | 3 625                  | 0,01                |
| Gilead Sciences Inc                                              | USD | 302     | 23 275                 | 0,09                |
| Ginkgo Bioworks Holdings Inc                                     | USD | 2 353   | 4 377                  | 0,02                |
| Graphic Packaging Holding Co                                     | USD | 202     | 4 854                  | 0,02                |
| Grocery Outlet Holding Corp                                      | USD | 181     | 5 540                  | 0,02                |
| Guardant Health Inc                                              | USD | 124     | 4 439                  | 0,02                |
| Guidewire Software Inc                                           | USD | 62      | 4 717                  | 0,02                |
| Halliburton Co                                                   | USD | 104     | 3 431                  | 0,01                |
| Harley-Davidson Inc                                              | USD | 221     | 7 781                  | 0,03                |
| Hasbro Inc                                                       | USD | 96      | 6 218                  | 0,02                |
| Hawaiian Electric Industries Inc                                 | USD | 158     | 5 720                  | 0,02                |
| HCA Healthcare Inc                                               | USD | 8       | 2 428                  | 0,01                |
| Hershey Co                                                       | USD | 43      | 10 737                 | 0,04                |
| Hertz Global Holdings Inc                                        | USD | 516     | 9 489                  | 0,04                |
| Hess Corp                                                        | USD | 38      | 5 166                  | 0,02                |
| Hewlett Packard Enterprise Co                                    | USD | 547     | 9 190                  | 0,03                |
| Hexcel Corp                                                      | USD | 69      | 5 245                  | 0,02                |
| HF Sinclair Corp                                                 | USD | 67      | 2 989                  | 0,01                |
| Hilton Worldwide Holdings Inc                                    | USD | 91      | 13 245                 | 0,05                |
| Hologic Inc                                                      | USD | 85      | 6 882                  | 0,03                |
| Home Depot Inc                                                   | USD | 122     | 37 898                 | 0,14                |
| Hormel Foods Corp                                                | USD | 142     | 5 711                  | 0,02                |
| Howmet Aerospace Inc                                             | USD | 123     | 6 096                  | 0,02                |
| HP Inc                                                           | USD | 286     | 8 783                  | 0,03                |
| Hubbell Inc                                                      | USD | 14      | 4 642                  | 0,02                |
| HubSpot Inc                                                      | USD | 27      | 14 366                 | 0,05                |
| Humana Inc                                                       | USD | 39      | 17 438                 | 0,07                |
| Huntington Ingalls Industries Inc                                | USD | 24      | 5 462                  | 0,02                |
| Hyatt Hotels Corp                                                | USD | 19      | 2 177                  | 0,01                |
| IAC Inc                                                          | USD | 96      | 6 029                  | 0,02                |
| IDACORP Inc                                                      | USD | 55      | 5 643                  | 0,02                |
| Illinois Tool Works Inc                                          | USD | 29      | 7 255                  | 0,03                |
| Incyte Corp                                                      | USD | 46      | 2 863                  | 0,01                |
| Ingredion Inc                                                    | USD | 57      | 6 039                  | 0,02                |
| Insulet Corp                                                     | USD | 20      | 5 767                  | 0,02                |
| Intel Corp                                                       | USD | 163     | 5 451                  | 0,02                |
| Interactive Brokers Group Inc                                    | USD | 132     | 10 965                 | 0,04                |
| Intercontinental Exchange Inc                                    | USD | 252     | 28 496                 | 0,11                |
| International Business Machines Corp                             | USD | 84      | 11 240                 | 0,04                |
| International Flavors & Fragrances Inc                           | USD | 81      | 6 447                  | 0,02                |
| Intuit Inc                                                       | USD | 148     | 67 812                 | 0,26                |
| Intuitive Surgical Inc                                           | USD | 7       | 2 394                  | 0,01                |
| J M Smucker Co                                                   | USD | 38      | 5 611                  | 0,02                |
| Jabil Inc                                                        | USD | 63      | 6 800                  | 0,03                |
| Jack Henry & Associates Inc                                      | USD | 176     | 29 450                 | 0,11                |

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                                  |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                                |     |         |                        |                     |
| <b>États-Unis – 20,15 % (31 décembre 2022 : 39,94 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| Jacobs Solutions Inc                                             | USD | 183     | 21 757                 | 0,08                |
| Jamf Holding Corp                                                | USD | 175     | 3 416                  | 0,01                |
| JB Hunt Transport Services Inc                                   | USD | 28      | 5 069                  | 0,02                |
| Johnson & Johnson                                                | USD | 199     | 32 938                 | 0,12                |
| Johnson Controls International PLC                               | USD | 82      | 5 587                  | 0,02                |
| JPMorgan Chase & Co                                              | USD | 201     | 29 233                 | 0,11                |
| Kellogg Co                                                       | USD | 163     | 10 986                 | 0,04                |
| Keurig Dr Pepper Inc                                             | USD | 733     | 22 921                 | 0,09                |
| KeyCorp                                                          | USD | 261     | 2 412                  | 0,01                |
| Kimberly-Clark Corp                                              | USD | 186     | 25 679                 | 0,10                |
| KLA Corp                                                         | USD | 45      | 21 826                 | 0,08                |
| Knife River Corp                                                 | USD | 129     | 5 611                  | 0,02                |
| Kraft Heinz Co                                                   | USD | 152     | 5 396                  | 0,02                |
| Kroger Co                                                        | USD | 507     | 23 829                 | 0,09                |
| Kyndryl Holdings Inc                                             | USD | 355     | 4 714                  | 0,02                |
| Laboratory Corp of America Holdings                              | USD | 22      | 5 309                  | 0,02                |
| Lam Research Corp                                                | USD | 9       | 5 786                  | 0,02                |
| Lamb Weston Holdings Inc                                         | USD | 51      | 5 862                  | 0,02                |
| Landstar System Inc                                              | USD | 27      | 5 199                  | 0,02                |
| Las Vegas Sands Corp                                             | USD | 38      | 2 204                  | 0,01                |
| Lattice Semiconductor Corp                                       | USD | 81      | 7 782                  | 0,03                |
| Leidos Holdings Inc                                              | USD | 63      | 5 574                  | 0,02                |
| Lennar Corp                                                      | USD | 30      | 3 759                  | 0,01                |
| Lennar Corp                                                      | USD | 77      | 8 699                  | 0,03                |
| Liberty Broadband Corp                                           | USD | 63      | 5 023                  | 0,02                |
| Liberty Broadband Corp                                           | USD | 63      | 5 047                  | 0,02                |
| Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM                              | USD | 190     | 6 219                  | 0,02                |
| Linde PLC                                                        | USD | 25      | 9 527                  | 0,04                |
| Lithia Motors Inc                                                | USD | 23      | 6 995                  | 0,03                |
| LKQ Corp                                                         | USD | 125     | 7 284                  | 0,03                |
| Louisiana-Pacific Corp                                           | USD | 90      | 6 748                  | 0,03                |
| Lowe's Cos Inc                                                   | USD | 163     | 36 789                 | 0,14                |
| LPL Financial Holdings Inc                                       | USD | 25      | 5 436                  | 0,02                |
| Lyft Inc                                                         | USD | 480     | 4 603                  | 0,02                |
| LyondellBasell Industries NV                                     | USD | 97      | 8 908                  | 0,03                |
| Macy's Inc                                                       | USD | 301     | 4 831                  | 0,02                |
| Manhattan Associates Inc                                         | USD | 12      | 2 399                  | 0,01                |
| ManpowerGroup Inc                                                | USD | 64      | 5 082                  | 0,02                |
| Marathon Petroleum Corp                                          | USD | 110     | 12 826                 | 0,05                |
| Maravai LifeSciences Holdings Inc                                | USD | 354     | 4 400                  | 0,02                |
| MarketAxess Holdings Inc                                         | USD | 100     | 26 142                 | 0,10                |
| Marriott International Inc                                       | USD | 109     | 20 022                 | 0,08                |
| Marriott Vacations Worldwide Corp                                | USD | 38      | 4 663                  | 0,02                |
| Marsh & McLennan Cos Inc                                         | USD | 155     | 29 152                 | 0,11                |
| Masco Corp                                                       | USD | 407     | 23 354                 | 0,09                |
| Masterbrand Inc                                                  | USD | 439     | 5 106                  | 0,02                |
| Mastercard Inc                                                   | USD | 80      | 31 464                 | 0,12                |
| Match Group Inc                                                  | USD | 846     | 35 405                 | 0,13                |
| McCormick & Co Inc                                               | USD | 78      | 6 804                  | 0,03                |
| McDonald's Corp                                                  | USD | 21      | 6 267                  | 0,02                |
| McKesson Corp                                                    | USD | 58      | 24 784                 | 0,09                |
| MDU Resources Group Inc                                          | USD | 516     | 10 805                 | 0,04                |

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                                  |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                                |     |         |                        |                     |
| <b>États-Unis – 20,15 % (31 décembre 2022 : 39,94 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| Merck & Co Inc                                                   | USD | 303     | 34 963                 | 0,13                |
| Mercury Systems Inc                                              | USD | 142     | 4 912                  | 0,02                |
| Meta Platforms Inc                                               | USD | 77      | 22 097                 | 0,08                |
| MetLife Inc                                                      | USD | 96      | 5 427                  | 0,02                |
| Mettler-Toledo International Inc                                 | USD | 3       | 3 935                  | 0,02                |
| MGIC Investment Corp                                             | USD | 250     | 3 947                  | 0,02                |
| MGM Resorts International                                        | USD | 117     | 5 139                  | 0,02                |
| Microchip Technology Inc                                         | USD | 247     | 22 129                 | 0,08                |
| Micron Technology Inc                                            | USD | 80      | 5 049                  | 0,02                |
| Microsoft Corp                                                   | USD | 490     | 166 865                | 0,63                |
| Moderna Inc                                                      | USD | 45      | 5 467                  | 0,02                |
| Molson Coors Beverage Co                                         | USD | 94      | 6 189                  | 0,02                |
| Mondelez International Inc                                       | USD | 84      | 6 127                  | 0,02                |
| Morgan Stanley                                                   | USD | 57      | 4 868                  | 0,02                |
| Mosaic Co                                                        | USD | 116     | 4 060                  | 0,02                |
| Motorola Solutions Inc                                           | USD | 11      | 3 226                  | 0,01                |
| MP Materials Corp                                                | USD | 191     | 4 370                  | 0,02                |
| MSC Industrial Direct Co Inc                                     | USD | 30      | 2 858                  | 0,01                |
| Natera Inc                                                       | USD | 55      | 2 676                  | 0,01                |
| National Fuel Gas Co                                             | USD | 146     | 7 499                  | 0,03                |
| National Instruments Corp                                        | USD | 70      | 4 018                  | 0,02                |
| nCino Inc                                                        | USD | 167     | 5 030                  | 0,02                |
| NetApp Inc                                                       | USD | 48      | 3 667                  | 0,01                |
| Netflix Inc                                                      | USD | 10      | 4 405                  | 0,02                |
| Neurocrine Biosciences Inc                                       | USD | 50      | 4 715                  | 0,02                |
| New Fortress Energy Inc                                          | USD | 110     | 2 946                  | 0,01                |
| New Relic Inc                                                    | USD | 72      | 4 712                  | 0,02                |
| Newmont Corp                                                     | USD | 221     | 9 428                  | 0,04                |
| Nexstar Media Group Inc                                          | USD | 43      | 7 162                  | 0,03                |
| NextEra Energy Inc                                               | USD | 66      | 4 897                  | 0,02                |
| NiSource Inc                                                     | USD | 301     | 8 232                  | 0,03                |
| NOV Inc                                                          | USD | 286     | 4 587                  | 0,02                |
| NRG Energy Inc                                                   | USD | 105     | 3 926                  | 0,02                |
| Nutanix Inc                                                      | USD | 164     | 4 600                  | 0,02                |
| NVIDIA Corp                                                      | USD | 87      | 36 803                 | 0,14                |
| NVR Inc                                                          | USD | 1       | 6 351                  | 0,02                |
| OGE Energy Corp                                                  | USD | 164     | 5 889                  | 0,02                |
| Okta Inc                                                         | USD | 48      | 3 329                  | 0,01                |
| Olaplex Holdings Inc                                             | USD | 1 798   | 6 689                  | 0,03                |
| Old Dominion Freight Line Inc                                    | USD | 15      | 5 546                  | 0,02                |
| Olin Corp                                                        | USD | 215     | 11 049                 | 0,04                |
| Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc                              | USD | 38      | 2 201                  | 0,01                |
| Omnicom Group Inc                                                | USD | 24      | 2 284                  | 0,01                |
| OneMain Holdings Inc                                             | USD | 91      | 3 976                  | 0,02                |
| ONEOK Inc                                                        | USD | 79      | 4 876                  | 0,02                |
| Oracle Corp                                                      | USD | 21      | 2 501                  | 0,01                |
| O'Reilly Automotive Inc                                          | USD | 2       | 1 911                  | 0,01                |
| Organon & Co                                                     | USD | 230     | 4 786                  | 0,02                |
| Oshkosh Corp                                                     | USD | 59      | 5 109                  | 0,02                |
| Ovintiv Inc                                                      | USD | 317     | 12 068                 | 0,05                |
| Owens Corning                                                    | USD | 86      | 11 223                 | 0,04                |
| PACCAR Inc                                                       | USD | 226     | 18 905                 | 0,07                |

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                                  |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                                |     |         |                        |                     |
| <b>États-Unis – 20,15 % (31 décembre 2022 : 39,94 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| PacWest Bancorp                                                  | USD | 319     | 2 600                  | 0,01                |
| Palantir Technologies Inc                                        | USD | 383     | 5 871                  | 0,02                |
| Palo Alto Networks Inc                                           | USD | 53      | 13 542                 | 0,05                |
| Paychex Inc                                                      | USD | 254     | 28 415                 | 0,11                |
| Paycor HCM Inc                                                   | USD | 201     | 4 758                  | 0,02                |
| PDC Energy Inc                                                   | USD | 53      | 3 770                  | 0,01                |
| Pegasystems Inc                                                  | USD | 109     | 5 374                  | 0,02                |
| Penske Automotive Group Inc                                      | USD | 24      | 3 999                  | 0,02                |
| Penumbra Inc                                                     | USD | 18      | 6 193                  | 0,02                |
| PepsiCo Inc                                                      | USD | 32      | 5 927                  | 0,02                |
| Performance Food Group Co                                        | USD | 118     | 7 108                  | 0,03                |
| Pfizer Inc                                                       | USD | 345     | 12 655                 | 0,05                |
| PG&E Corp                                                        | USD | 189     | 3 266                  | 0,01                |
| Philip Morris International Inc                                  | USD | 435     | 42 465                 | 0,16                |
| Phillips 66                                                      | USD | 32      | 3 052                  | 0,01                |
| Pilgrim's Pride Corp                                             | USD | 146     | 3 138                  | 0,01                |
| Pinnacle West Capital Corp                                       | USD | 76      | 6 191                  | 0,02                |
| Pinterest Inc                                                    | USD | 123     | 3 363                  | 0,01                |
| Plug Power Inc                                                   | USD | 277     | 2 878                  | 0,01                |
| Post Holdings Inc                                                | USD | 55      | 4 766                  | 0,02                |
| PPL Corp                                                         | USD | 217     | 5 742                  | 0,02                |
| Premier Inc                                                      | USD | 181     | 5 006                  | 0,02                |
| Primerica Inc                                                    | USD | 12      | 2 373                  | 0,01                |
| Procter & Gamble Co                                              | USD | 39      | 5 918                  | 0,02                |
| PTC Inc                                                          | USD | 39      | 5 550                  | 0,02                |
| Public Service Enterprise Group Inc                              | USD | 180     | 11 270                 | 0,04                |
| PulteGroup Inc                                                   | USD | 118     | 9 166                  | 0,03                |
| QUALCOMM Inc                                                     | USD | 25      | 2 976                  | 0,01                |
| Quanta Services Inc                                              | USD | 42      | 8 251                  | 0,03                |
| Quest Diagnostics Inc                                            | USD | 76      | 10 683                 | 0,04                |
| QuidelOrtho Corp                                                 | USD | 36      | 2 983                  | 0,01                |
| Regeneron Pharmaceuticals Inc                                    | USD | 8       | 5 748                  | 0,02                |
| Regions Financial Corp                                           | USD | 265     | 4 722                  | 0,02                |
| Reliance Steel & Aluminum Co                                     | USD | 14      | 3 802                  | 0,01                |
| Republic Services Inc                                            | USD | 44      | 6 739                  | 0,03                |
| Revvity Inc                                                      | USD | 304     | 36 112                 | 0,14                |
| Reynolds Consumer Products Inc                                   | USD | 211     | 5 961                  | 0,02                |
| RingCentral Inc                                                  | USD | 179     | 5 859                  | 0,02                |
| Robert Half International Inc                                    | USD | 299     | 22 491                 | 0,09                |
| Robinhood Markets Inc                                            | USD | 572     | 5 709                  | 0,02                |
| Rocket Cos Inc                                                   | USD | 546     | 4 892                  | 0,02                |
| Rockwell Automation Inc                                          | USD | 8       | 2 636                  | 0,01                |
| Roper Technologies Inc                                           | USD | 135     | 64 908                 | 0,25                |
| Ross Stores Inc                                                  | USD | 21      | 2 355                  | 0,01                |
| Royalty Pharma PLC                                               | USD | 301     | 9 253                  | 0,04                |
| RXO Inc                                                          | USD | 255     | 5 781                  | 0,02                |
| Ryder System Inc                                                 | USD | 94      | 7 970                  | 0,03                |
| Salesforce Inc                                                   | USD | 26      | 5 493                  | 0,02                |
| Sarepta Therapeutics Inc                                         | USD | 41      | 4 695                  | 0,02                |
| Schneider National Inc                                           | USD | 193     | 5 543                  | 0,02                |
| Seaboard Corp                                                    | USD | 2       | 7 121                  | 0,03                |
| Seagen Inc                                                       | USD | 16      | 3 079                  | 0,01                |



## LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |  |
|--------------------------------|-----------------|--|--|
|--------------------------------|-----------------|--|--|

|                                                                  |     | Actions | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------------|---------------------|
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                                |     |         |                        |                     |
| <b>États-Unis – 20,15 % (31 décembre 2022 : 39,94 %) (suite)</b> |     |         |                        |                     |
| Sealed Air Corp                                                  | USD | 115     | 4 600                  | 0,02                |
| Sempra Energy                                                    | USD | 40      | 5 824                  | 0,02                |
| SentinelOne Inc                                                  | USD | 225     | 3 397                  | 0,01                |
| ServiceNow Inc                                                   | USD | 143     | 80 362                 | 0,30                |
| Sherwin-Williams Co                                              | USD | 38      | 10 090                 | 0,04                |
| Shift4 Payments Inc                                              | USD | 102     | 6 927                  | 0,03                |
| SiteOne Landscape Supply Inc                                     | USD | 36      | 6 025                  | 0,02                |
| Skechers USA Inc                                                 | USD | 42      | 2 212                  | 0,01                |
| SLM Corp                                                         | USD | 283     | 4 619                  | 0,02                |
| Snowflake Inc                                                    | USD | 23      | 4 048                  | 0,02                |
| SoFi Technologies Inc                                            | USD | 547     | 4 562                  | 0,02                |
| Southern Co                                                      | USD | 85      | 5 971                  | 0,02                |
| Southwestern Energy Co                                           | USD | 1 049   | 6 304                  | 0,02                |
| Starbucks Corp                                                   | USD | 177     | 17 534                 | 0,07                |
| State Street Corp                                                | USD | 67      | 4 903                  | 0,02                |
| Steel Dynamics Inc                                               | USD | 29      | 3 159                  | 0,01                |
| Sunrun Inc                                                       | USD | 251     | 4 483                  | 0,02                |
| Synchrony Financial                                              | USD | 280     | 9 498                  | 0,04                |
| Syneos Health Inc                                                | USD | 93      | 3 919                  | 0,02                |
| Synovus Financial Corp                                           | USD | 105     | 3 176                  | 0,01                |
| Sysco Corp                                                       | USD | 244     | 18 105                 | 0,07                |
| Tandem Diabetes Care Inc                                         | USD | 79      | 1 939                  | 0,01                |
| Tapestry Inc                                                     | USD | 82      | 3 510                  | 0,01                |
| Targa Resources Corp                                             | USD | 908     | 69 099                 | 0,26                |
| TD SYNEX Corp                                                    | USD | 35      | 3 290                  | 0,01                |
| Teladoc Health Inc                                               | USD | 193     | 4 887                  | 0,02                |
| Tempur Sealy International Inc                                   | USD | 57      | 2 284                  | 0,01                |
| Tenet Healthcare Corp                                            | USD | 58      | 4 720                  | 0,02                |
| Tesla Inc                                                        | USD | 35      | 9 162                  | 0,03                |
| Texas Instruments Inc                                            | USD | 416     | 74 888                 | 0,28                |
| Texas Pacific Land Corp                                          | USD | 3       | 3 950                  | 0,02                |
| Thermo Fisher Scientific Inc                                     | USD | 68      | 35 479                 | 0,13                |
| Toast Inc                                                        | USD | 195     | 4 401                  | 0,02                |
| Toll Brothers Inc                                                | USD | 115     | 9 093                  | 0,03                |
| Tractor Supply Co                                                | USD | 10      | 2 211                  | 0,01                |
| Trade Desk Inc                                                   | USD | 31      | 2 394                  | 0,01                |
| Travel + Leisure Co                                              | USD | 140     | 5 648                  | 0,02                |
| Travelers Cos Inc                                                | USD | 35      | 6 078                  | 0,02                |
| Trimble Inc                                                      | USD | 94      | 4 976                  | 0,02                |
| Twilio Inc                                                       | USD | 53      | 3 372                  | 0,01                |
| Tyson Foods Inc                                                  | USD | 101     | 5 155                  | 0,02                |
| Uber Technologies Inc                                            | USD | 152     | 6 562                  | 0,02                |
| UGI Corp                                                         | USD | 206     | 5 556                  | 0,02                |
| U-Haul Holding Co                                                | USD | 92      | 5 089                  | 0,02                |
| U-Haul Holding Co                                                | USD | 134     | 6 790                  | 0,03                |
| UiPath Inc                                                       | USD | 204     | 3 380                  | 0,01                |
| Ulta Beauty Inc                                                  | USD | 14      | 6 588                  | 0,03                |
| Ultragenyx Pharmaceutical Inc                                    | USD | 85      | 3 921                  | 0,02                |
| Union Pacific Corp                                               | USD | 26      | 5 320                  | 0,02                |
| United Airlines Holdings Inc                                     | USD | 77      | 4 225                  | 0,02                |
| United Parcel Service Inc                                        | USD | 36      | 6 453                  | 0,02                |
| United Rentals Inc                                               | USD | 32      | 14 252                 | 0,05                |

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

| Calendrier des investissements                                   |     | Au 30 juin 2023 |                        |                     |
|------------------------------------------------------------------|-----|-----------------|------------------------|---------------------|
|                                                                  |     | ACTIONS         | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
| <b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>                                |     |                 |                        |                     |
| <b>États-Unis – 20,15 % (31 décembre 2022 : 39,94 %) (suite)</b> |     |                 |                        |                     |
| United States Steel Corp                                         | USD | 130             | 3 251                  | 0,01                |
| United Therapeutics Corp                                         | USD | 37              | 8 168                  | 0,03                |
| UnitedHealth Group Inc                                           | USD | 68              | 32 684                 | 0,12                |
| Unity Software Inc                                               | USD | 111             | 4 820                  | 0,02                |
| Universal Health Services Inc                                    | USD | 41              | 6 469                  | 0,02                |
| Unum Group                                                       | USD | 376             | 17 935                 | 0,07                |
| UWM Holdings Corp                                                | USD | 1 410           | 7 896                  | 0,03                |
| Valero Energy Corp                                               | USD | 105             | 12 317                 | 0,05                |
| Verisk Analytics Inc                                             | USD | 26              | 5 877                  | 0,02                |
| Verizon Communications Inc                                       | USD | 369             | 13 723                 | 0,05                |
| Vertex Pharmaceuticals Inc                                       | USD | 22              | 7 742                  | 0,03                |
| Vertiv Holdings Co                                               | USD | 243             | 6 019                  | 0,02                |
| Viatis Inc                                                       | USD | 1 733           | 17 295                 | 0,07                |
| Victoria's Secret & Co                                           | USD | 210             | 3 660                  | 0,01                |
| Visa Inc                                                         | USD | 32              | 7 599                  | 0,03                |
| Vistra Corp                                                      | USD | 467             | 12 259                 | 0,05                |
| Vontier Corp                                                     | USD | 125             | 4 026                  | 0,02                |
| Walgreens Boots Alliance Inc                                     | USD | 566             | 16 125                 | 0,06                |
| Walmart Inc                                                      | USD | 41              | 6 444                  | 0,02                |
| Waste Management Inc                                             | USD | 166             | 28 788                 | 0,11                |
| Waters Corp                                                      | USD | 168             | 44 779                 | 0,17                |
| Watsco Inc                                                       | USD | 7               | 2 670                  | 0,01                |
| WEC Energy Group Inc                                             | USD | 63              | 5 559                  | 0,02                |
| Wendy's Co                                                       | USD | 94              | 2 044                  | 0,01                |
| WESCO International Inc                                          | USD | 36              | 6 446                  | 0,02                |
| Western Alliance Bancorp                                         | USD | 238             | 8 680                  | 0,03                |
| Whirlpool Corp                                                   | USD | 191             | 28 419                 | 0,11                |
| White Mountains Insurance Group Ltd                              | USD | 4               | 5 556                  | 0,02                |
| Williams-Sonoma Inc                                              | USD | 82              | 10 261                 | 0,04                |
| WillScot Mobile Mini Holdings Corp                               | USD | 111             | 5 305                  | 0,02                |
| Workday Inc                                                      | USD | 25              | 5 647                  | 0,02                |
| World Wrestling Entertainment Inc                                | USD | 80              | 8 678                  | 0,03                |
| WW Grainger Inc                                                  | USD | 10              | 7 886                  | 0,03                |
| Wynn Resorts Ltd                                                 | USD | 166             | 17 531                 | 0,07                |
| Xcel Energy Inc                                                  | USD | 163             | 10 134                 | 0,04                |
| XPO Inc                                                          | USD | 44              | 2 596                  | 0,01                |
| Xylem Inc                                                        | USD | 48              | 5 406                  | 0,02                |
| Yum! Brands Inc                                                  | USD | 45              | 6 235                  | 0,02                |
| Zebra Technologies Corp                                          | USD | 229             | 67 745                 | 0,26                |
| Zimmer Biomet Holdings Inc                                       | USD | 38              | 5 533                  | 0,02                |
| Zions Bancorp NA                                                 | USD | 111             | 2 981                  | 0,01                |
| Zoetis Inc                                                       | USD | 29              | 4 994                  | 0,02                |
| Zscaler Inc                                                      | USD | 28              | 4 096                  | 0,02                |
|                                                                  |     |                 | 5 333 983              | 20,15               |
| <b>Uruguay – 0,04 % (31 décembre 2022 : 0,08 %)</b>              |     |                 |                        |                     |
| MercadoLibre Inc                                                 | USD | 10              | 11 846                 | 0,04                |
|                                                                  |     |                 | 11 846                 | 0,04                |

**NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC**

**LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)**

| <b>Calendrier des investissements</b> | <b>Au 30 juin 2023</b> |
|---------------------------------------|------------------------|
|---------------------------------------|------------------------|

|                                     | <b>Juste valeur<br/>USD</b> | <b>% de l'actif<br/>net</b> |
|-------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>TOTAL DES ACTIONS ORDINAIRES</b> | <b>7 460 072</b>            | <b>28,18</b>                |

**TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR  
PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS  
INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS  
(Coût : 19 411 705 USD)**

|                   |              |
|-------------------|--------------|
| <b>19 642 972</b> | <b>74,20</b> |
|-------------------|--------------|

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS - 0,03 % (31 décembre 2022 : 0,20 %)**

**Contrats de change à terme en cours - (0,26 %) (31 décembre 2022 : 0,15 %)**

| <b>Échéance</b> | <b>Montant acheté</b> | <b>Montant vendu</b> | <b>Contrepartie</b>     | <b>Plus-value/<br/>(moins-value)<br/>latente<br/>USD</b> | <b>% de l'actif<br/>net</b> |
|-----------------|-----------------------|----------------------|-------------------------|----------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 20/09/23        | 420 089 USD           | 560 000 CAD          | Bank of America         | (3 626)                                                  | (0,01 %)                    |
| 20/09/23        | 560 000 CAD           | 424 573 USD          | Bank of America         | (858)                                                    | (0,00 %)                    |
| 20/09/23        | 274 000 CAD           | 207 738 USD          | Bank of America         | (420)                                                    | (0,00 %)                    |
| 20/09/23        | 109 000 GBP           | 138 777 USD          | Bank of America         | (172)                                                    | (0,00 %)                    |
| 20/09/23        | 5 636 USD             | 5 000 CHF            | Bank of America         | 1                                                        | 0,00 %                      |
| 20/09/23        | 5 100 USD             | 4 000 GBP            | Bank of America         | 14                                                       | 0,00 %                      |
| 20/09/23        | 9 000 CHF             | 10 116 USD           | Bank of America         | 27                                                       | 0,00 %                      |
| 20/09/23        | 6 000 GBP             | 7 585 USD            | Bank of America         | 45                                                       | 0,00 %                      |
| 20/09/23        | 130 000 CHF           | 145 999 USD          | Bank of America         | 516                                                      | 0,00 %                      |
| 20/09/23        | 152 000 CHF           | 169 772 USD          | Bank of America         | 1 537                                                    | 0,01 %                      |
| 20/09/23        | 131 000 GBP           | 163 792 USD          | Bank of America         | 2 789                                                    | 0,01 %                      |
| 20/09/23        | 597 769 USD           | 2 186 000 ILS        | Bank of America         | 6 985                                                    | 0,03 %                      |
| 20/09/23        | 292 174 USD           | 1 055 000 ILS        | Bank of America         | 7 052                                                    | 0,03 %                      |
| 20/09/23        | 17 564 000 TRY        | 663 336 USD          | Barclays Bank PLC       | (13 972)                                                 | (0,05 %)                    |
| 20/09/23        | 1 198 000 TRY         | 48 012 USD           | Barclays Bank PLC       | (3 720)                                                  | (0,02 %)                    |
| 20/09/23        | 936 000 TRY           | 36 203 USD           | Barclays Bank PLC       | (1 598)                                                  | (0,01 %)                    |
| 20/09/23        | 1 210 000 PLN         | 288 691 USD          | Barclays Bank PLC       | 7 975                                                    | 0,03 %                      |
| 31/07/23        | 22 846 317 EUR        | 25 054 597 USD       | Brown Brothers Harriman | (94 537)                                                 | (0,36 %)                    |
| 31/07/23        | 397 747 EUR           | 436 193 USD          | Brown Brothers Harriman | (1 646)                                                  | (0,01 %)                    |
| 31/07/23        | 892 702 EUR           | 976 214 USD          | Brown Brothers Harriman | (919)                                                    | (0,00 %)                    |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

## Contrats de change à terme en cours - (0,26 %) (31 décembre 2022 : 0,15 %) (suite)

| Échéance | Montant acheté | Montant vendu  | Contrepartie            | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente<br>USD | % de l'actif<br>net |
|----------|----------------|----------------|-------------------------|------------------------------------------------|---------------------|
| 31/07/23 | 13 353 EUR     | 14 602 USD     | Brown Brothers Harriman | (14)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 216 850 USD    | 2 365 000 NOK  | Citibank NA             | (4 504)                                        | (0,02 %)            |
| 20/09/23 | 361 000 AUD    | 244 309 USD    | Citibank NA             | (3 482)                                        | (0,01 %)            |
| 20/09/23 | 275 000 AUD    | 186 108 USD    | Citibank NA             | (2 652)                                        | (0,01 %)            |
| 20/09/23 | 633 000 AUD    | 424 429 USD    | Citibank NA             | (2 148)                                        | (0,01 %)            |
| 20/09/23 | 207 418 USD    | 342 000 NZD    | Citibank NA             | (2 040)                                        | (0,01 %)            |
| 20/09/23 | 256 324 USD    | 2 767 000 SEK  | Citibank NA             | (807)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 203 000 AUD    | 136 112 USD    | Citibank NA             | (689)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 68 794 USD     | 104 000 AUD    | Citibank NA             | (585)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 1 418 000 SEK  | 132 292 USD    | Citibank NA             | (520)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 66 251 USD     | 100 000 AUD    | Citibank NA             | (460)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 12 000 NZD     | 7 440 USD      | Citibank NA             | (90)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 2 646 USD      | 4 000 AUD      | Citibank NA             | (23)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 128 187 USD    | 1 379 000 SEK  | Citibank NA             | 39                                             | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 23 000 NZD     | 13 969 USD     | Citibank NA             | 117                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 13 980 USD     | 1 959 000 JPY  | Citibank NA             | 259                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 1 288 000 NOK  | 120 014 USD    | Citibank NA             | 538                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 42 769 USD     | 63 000 AUD     | Citibank NA             | 741                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 184 389 USD    | 275 000 AUD    | Citibank NA             | 933                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 92 271 USD     | 136 000 AUD    | Citibank NA             | 1 544                                          | 0,01 %              |
| 20/09/23 | 256 250 USD    | 35 242 000 JPY | Citibank NA             | 9 418                                          | 0,04 %              |
| 20/09/23 | 435 958 USD    | 633 000 AUD    | Citibank NA             | 13 677                                         | 0,05 %              |
| 20/09/23 | 19 963 000 MXN | 1 129 207 USD  | Citibank NA             | 17 421                                         | 0,07 %              |
| 20/09/23 | 290 760 USD    | 3 171 000 NOK  | HSBC Bank               | (6 033)                                        | (0,02 %)            |
| 20/09/23 | 443 547 USD    | 398 000 CHF    | HSBC Bank               | (5 012)                                        | (0,02 %)            |
| 20/09/23 | 296 863 USD    | 275 000 EUR    | HSBC Bank               | (4 343)                                        | (0,02 %)            |

**NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC**

**LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)**

**Calendrier des investissements**

**Au 30 juin 2023**

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)**

**Contrats de change à terme en cours - (0,26 %) (31 décembre 2022 : 0,15 %) (suite)**

| Échéance | Montant acheté | Montant vendu | Contrepartie | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente<br>USD | % de l'actif<br>net |
|----------|----------------|---------------|--------------|------------------------------------------------|---------------------|
| 20/09/23 | 206 118 USD    | 165 000 GBP   | HSBC Bank    | (3 698)                                        | (0,02 %)            |
| 20/09/23 | 68 009 USD     | 63 000 EUR    | HSBC Bank    | (995)                                          | (0,01 %)            |
| 20/09/23 | 275 000 EUR    | 302 106 USD   | HSBC Bank    | (899)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 318 000 EUR    | 348 861 USD   | HSBC Bank    | (556)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 112 000 EUR    | 123 039 USD   | HSBC Bank    | (366)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 41 000 EUR     | 45 230 USD    | HSBC Bank    | (323)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 31 000 NZD     | 19 219 USD    | HSBC Bank    | (233)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 124 000 CNH    | 17 373 USD    | HSBC Bank    | (215)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 54 000 CNH     | 7 561 USD     | HSBC Bank    | (89)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 23 377 USD     | 31 000 CAD    | HSBC Bank    | (79)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 63 000 EUR     | 69 074 USD    | HSBC Bank    | (70)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 59 000 EUR     | 64 688 USD    | HSBC Bank    | (66)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 23 000 GBP     | 29 305 USD    | HSBC Bank    | (58)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 298 000 CNH    | 41 292 USD    | HSBC Bank    | (58)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 8 000 GBP      | 10 203 USD    | HSBC Bank    | (30)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 55 211 USD     | 73 000 CAD    | HSBC Bank    | (23)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 45 379 USD     | 60 000 CAD    | HSBC Bank    | (19)                                           | (0,00 %)            |
| 20/09/23 | 6 619 USD      | 6 000 EUR     | HSBC Bank    | 48                                             | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 9 000 EUR      | 9 716 USD     | HSBC Bank    | 142                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 38 000 EUR     | 41 449 USD    | HSBC Bank    | 172                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 122 852 USD    | 112 000 EUR   | HSBC Bank    | 178                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 20 000 GBP     | 25 199 USD    | HSBC Bank    | 233                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 42 608 USD     | 56 000 CAD    | HSBC Bank    | 236                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 303 839 USD    | 277 000 EUR   | HSBC Bank    | 441                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 60 000 NZD     | 36 296 USD    | HSBC Bank    | 451                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23 | 73 000 CAD     | 54 738 USD    | HSBC Bank    | 497                                            | 0,00 %              |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

## Contrats de change à terme en cours - (0,26 %) (31 décembre 2022 : 0,15 %) (suite)

| Échéance                                                               | Montant acheté  | Montant vendu   | Contrepartie           | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente<br>USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------------|-----------------|-----------------|------------------------|------------------------------------------------|---------------------|
| 20/09/23                                                               | 157 000 NZD     | 95 205 USD      | HSBC Bank              | 950                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23                                                               | 592 114 USD     | 4 192 000 CNH   | HSBC Bank              | 12 071                                         | 0,05 %              |
| 20/09/23                                                               | 102 027 000 JPY | 744 178 USD     | Morgan Stanley Capital | (29 589)                                       | (0,11 %)            |
| 20/09/23                                                               | 188 270 000 CLP | 234 970 USD     | Morgan Stanley Capital | (2 492)                                        | (0,01 %)            |
| 20/09/23                                                               | 4 783 000 JPY   | 33 932 USD      | Morgan Stanley Capital | (432)                                          | (0,00 %)            |
| 20/09/23                                                               | 229 160 USD     | 981 951 000 COP | UBS Securities LLC     | (1 049)                                        | (0,01 %)            |
| 20/09/23                                                               | 39 998 USD      | 1 395 000 THB   | UBS Securities LLC     | 349                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23                                                               | 418 816 USD     | 329 000 GBP     | UBS Securities LLC     | 457                                            | 0,00 %              |
| 20/09/23                                                               | 981 951 000 COP | 229 147 USD     | UBS Securities LLC     | 1 062                                          | 0,01 %              |
| 20/09/23                                                               | 913 000 PEN     | 247 728 USD     | UBS Securities LLC     | 2 606                                          | 0,01 %              |
| 20/09/23                                                               | 6 393 000 CZK   | 289 847 USD     | UBS Securities LLC     | 2 725                                          | 0,01 %              |
| 20/09/23                                                               | 559 000 GBP     | 699 230 USD     | UBS Securities LLC     | 11 599                                         | 0,04 %              |
| 20/09/23                                                               | 1 084 790 USD   | 37 395 000 THB  | UBS Securities LLC     | 21 929                                         | 0,08 %              |
| Plus-value latente sur les contrats de change à terme en cours         |                 |                 |                        | 127 774                                        | 0,48 %              |
| Moins-value latente sur les contrats de change à terme en cours        |                 |                 |                        | (196 209)                                      | (0,74 %)            |
| <b>Perte latente nette sur les contrats de change à terme en cours</b> |                 |                 |                        | <b>(68 435)</b>                                | <b>(0,26 %)</b>     |

## Contrats à terme normalisés - 0,29 % (31 décembre 2022 : 0,05 %)

| Nombre de<br>contrats | Libellé                                    | Contrepartie | Engagement | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | % de l'actif<br>net |
|-----------------------|--------------------------------------------|--------------|------------|-----------------------------------------|---------------------|
| (8)                   | 90 Day bank bill June 2024<br>Futures      | JP Morgan    | 5 267 017  | 2 054                                   | 0,01 %              |
| (8)                   | 90 Day bank bill March 2024<br>Futures     | JP Morgan    | 5 277 827  | 13 762                                  | 0,05 %              |
| (8)                   | 90 Day bank bill September 2023<br>Futures | JP Morgan    | 5 265 861  | 128                                     | 0,00 %              |
| (20)                  | 3 Month Euribor December 2023<br>Futures   | JP Morgan    | 5 254 092  | 16 747                                  | 0,06 %              |
| (20)                  | 3 Month Euribor March 2024<br>Futures      | JP Morgan    | 5 261 075  | 22 093                                  | 0,08 %              |
| (10)                  | 3 Month Euribor September 2024<br>Futures  | JP Morgan    | 2 633 265  | 5 046                                   | 0,02 %              |
| (20)                  | 3 Month SOFR December 2023<br>Futures      | JP Morgan    | 4 754 000  | 22 000                                  | 0,08 %              |
| (22)                  | 3 Month SOFR June 2023<br>Futures          | JP Morgan    | 5 213 863  | 963                                     | 0,00 %              |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Contrats à terme normalisés – 0,29 % (31 décembre 2022 : 0,05 %)

(suite)

| Nombre de<br>contrats | Libellé                                                   | Contrepartie | Engagement | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | % de l'actif<br>net |
|-----------------------|-----------------------------------------------------------|--------------|------------|-----------------------------------------|---------------------|
| (20)                  | 3 Month SOFR March 2024<br>Futures                        | JP Morgan    | 4 771 375  | 27 125                                  | 0,10 %              |
| (21)                  | 3 Month SOFR September 2024<br>Futures                    | JP Morgan    | 5 037 638  | 17 063                                  | 0,06 %              |
| (46)                  | 10 Year Mini JGB September<br>2023 Futures                | JP Morgan    | 4 710 658  | (14 896)                                | (0,06 %)            |
| (205)                 | CBOE Volatility Index July 2023<br>Futures                | JP Morgan    | 3 395 798  | 318 543                                 | 1,20 %              |
| (23)                  | E-mini Russell 2000 Index<br>September 2023 Futures       | JP Morgan    | 2 163 083  | (26 173)                                | (0,10 %)            |
| (2)                   | E-mini S&P 500 September 2023<br>Futures                  | JP Morgan    | 448 675    | (150)                                   | (0,00 %)            |
| (1)                   | E-mini S&P MidCap 400<br>September 2023 Futures           | JP Morgan    | 264 400    | (10)                                    | (0,00 %)            |
| (4)                   | Euro Stoxx 50 September 2023<br>Futures                   | JP Morgan    | 191 492    | (1 702)                                 | (0,01 %)            |
| (2)                   | FTSE/MIB Index September 2023<br>Futures                  | JP Morgan    | 307 553    | (1 887)                                 | (0,01 %)            |
| 22                    | Micro DJIA CBOT September<br>2023 Futures                 | JP Morgan    | 380 951    | 122                                     | 0,00 %              |
| (7)                   | Micro E-mini Russell 2000 Index<br>September 2023 Futures | JP Morgan    | 66 026     | (604)                                   | (0,00 %)            |
| (127)                 | Micro E-mini S&P 500<br>September 2023 Futures            | JP Morgan    | 2 785 444  | (64 595)                                | (0,24 %)            |
| (28)                  | MSCI Emerging Markets Index<br>September 2023 Futures     | JP Morgan    | 1 409 390  | 12 330                                  | 0,05 %              |
| (3)                   | Nikkei 225 mini September 2023<br>Futures                 | JP Morgan    | 65 994     | (2 854)                                 | (0,01 %)            |
| 6                     | Australia 10 Year Bond<br>September 2023 Futures          | JP Morgan    | 466 886    | (2 906)                                 | (0,01 %)            |
| 6                     | Canada 10 Year Bond September<br>2023 Futures             | JP Morgan    | 560 529    | (4 942)                                 | (0,02 %)            |
| 190                   | CBOE Volatility Index August<br>2023 Futures              | JP Morgan    | 3 390 369  | (274 312)                               | (1,04 %)            |
| 3                     | Euro-BTP September 2023<br>Futures                        | JP Morgan    | 380 093    | (65)                                    | (0,00 %)            |
| 2                     | Euro-Bund September 2023<br>Futures                       | JP Morgan    | 294 810    | (2 989)                                 | (0,01 %)            |
| 3                     | Euro-OAT September 2023<br>Futures                        | JP Morgan    | 423 592    | (3 339)                                 | (0,01 %)            |
| 8                     | FTSE 100 Index September 2023<br>Futures                  | JP Morgan    | 762 651    | 4 380                                   | 0,02 %              |
| 9                     | FTSE/JSE Top 40 Index<br>September 2023 Futures           | JP Morgan    | 335 714    | 2 667                                   | 0,01 %              |
| 22                    | Micro DJIA CBOT September<br>2023 Futures                 | JP Morgan    | 380 951    | 122                                     | 0,00 %              |
| 1                     | Mini-DAX September 2023<br>Futures                        | JP Morgan    | 87 564     | 1 200                                   | 0,01 %              |
| 39                    | Nasdaq 100 Micro E-mini<br>September 2023 Futures         | JP Morgan    | 1 165 931  | 30 355                                  | 0,12 %              |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Contrats à terme normalisés – 0,29 % (31 décembre 2022 : 0,05 %)  
(suite)

| Nombre de<br>contrats                                           | Libellé                                    | Contrepartie | Engagement | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | % de l'actif<br>net |
|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------|------------|-----------------------------------------|---------------------|
| 1                                                               | Nikkei 225 (OSE) September<br>2023 Futures | JP Morgan    | 224 167    | 5 327                                   | 0,02 %              |
| 2                                                               | SGX Nifty 50 July 2023 Futures             | JP Morgan    | 75 356     | 1 760                                   | 0,01 %              |
| 19                                                              | US 10 Year Note September 2023<br>Futures  | JP Morgan    | 2 157 798  | (24 751)                                | (0,09 %)            |
| 7                                                               | WIG 20 Index September 2023<br>Futures     | JP Morgan    | 70 737     | (271)                                   | (0,00 %)            |
| Plus-value latente sur les contrats à terme normalisés          |                                            |              |            | 503 665                                 | 1,90 %              |
| Moins-value latente sur les contrats à terme normalisés         |                                            |              |            | (426 446)                               | (1,61 %)            |
| <b>Plus-value nette latente sur contrats à terme normalisés</b> |                                            |              |            | <b>77 219</b>                           | <b>0,29 %</b>       |

Indices de swap de défaillance de crédit compensés par une contrepartie centrale - 0,48 % (31 décembre 2022 : 0,06 %)

| Position                                                                                       | Contrepartie              | Indice sous-jacent                   | Taux   | Échéance   | Devise | Nominal   | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | % de<br>l'actif net |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|--------|------------|--------|-----------|-----------------------------------------|---------------------|
| VENTE                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | CDX.NA.HY 40                         | 5,00 % | 20/06/2028 | USD    | 1 400 000 | 38 762                                  | 0,15 %              |
| VENTE                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | CDX.NA.HY 40                         | 5,00 % | 20/06/2028 | USD    | 200 000   | 5 537                                   | 0,02 %              |
| VENTE                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | CDX.NA.HY 40                         | 5,00 % | 20/06/2028 | USD    | 700 000   | 19 381                                  | 0,07 %              |
| VENTE                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | CDX.NA.IG 40                         | 1,00 % | 20/06/2028 | USD    | 300 000   | 4 483                                   | 0,02 %              |
| VENTE                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | iTRAXX Europe<br>Crossover Series 39 | 5,00 % | 20/06/2028 | EUR    | 1 500 000 | 65 036                                  | 0,25 %              |
| VENTE                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | iTRAXX Europe<br>Crossover Series 39 | 5,00 % | 20/06/2028 | EUR    | 100 000   | 4 336                                   | 0,02 %              |
| VENTE                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | iTRAXX Europe<br>Crossover Series 39 | 5,00 % | 20/06/2028 | EUR    | 100 000   | 4 336                                   | 0,02 %              |
| VENTE                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | iTRAXX Europe<br>Series 39           | 1,00 % | 20/06/2028 | EUR    | 300 000   | 3 860                                   | 0,01 %              |
| VENTE                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | iTRAXX Europe<br>Series 39           | 1,00 % | 20/06/2028 | EUR    | 100 000   | 1 287                                   | 0,00 %              |
| ACHAT                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | CDX.NA.IG 40                         | 1,00 % | 20/06/2028 | USD    | 300 000   | (4 483)                                 | (0,02 %)            |
| ACHAT                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | CDX.NA.IG 40                         | 1,00 % | 20/06/2028 | USD    | 600 000   | (8 966)                                 | (0,03 %)            |
| ACHAT                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | iTRAXX Europe<br>Series 39           | 1,00 % | 20/06/2028 | EUR    | 500 000   | (6 434)                                 | (0,02 %)            |
| ACHAT                                                                                          | Morgan Stanley<br>Capital | iTRAXX Europe<br>Series 39           | 1,00 % | 20/06/2028 | EUR    | 100 000   | (1 287)                                 | 0,00 %              |
| Plus-value latente sur swaps de défaillance de crédit compensés par une contrepartie centrale  |                           |                                      |        |            |        |           | 147 018                                 | 0,56 %              |
| Moins-value latente sur swaps de défaillance de crédit compensés par une contrepartie centrale |                           |                                      |        |            |        |           | (21 170)                                | (0,08 %)            |

**Plus-value nette latente sur swaps de défaillance de crédit compensés par une  
contrepartie centrale****125 848 0,48 %**



| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |  |
|--------------------------------|-----------------|--|
|--------------------------------|-----------------|--|

|                                                                                                                              | Juste valeur<br>USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|
| Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat                                      | 20 421 429          | 77,14               |
| Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat                                       | (643 825)           | (2,43)              |
| <b>TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS</b> | <b>19 777 604</b>   | <b>74,71</b>        |
| Avoirs nets en banque                                                                                                        | 5 605 965           | 21,18               |
| Autres actifs                                                                                                                | 1 575 186           | 5,95                |
| Moins autres passifs                                                                                                         | (486 639)           | (1,84)              |
| <b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D' ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES</b>                                           | <b>26 472 116</b>   | <b>100,00</b>       |

#### LES DIX PREMIÈRES PARTICIPATIONS SECTORIELLES AU 30 JUIN 2023 EN POURCENTAGE DE L'ACTIF NET

|                           |         |
|---------------------------|---------|
| Titres souverains         | 32,89 % |
| Sociétés d'investissement | 2,99 %  |
| Logiciel                  | 2,98 %  |
| Santé                     | 2,39 %  |
| Activités bancaires       | 2,33 %  |
| Produits pharmaceutiques  | 2,17 %  |
| Gazoducs                  | 1,97 %  |
| Internet                  | 1,91 %  |
| Semi-conducteurs          | 1,84 %  |
| Distributeurs             | 1,50 %  |

- (i) Titres exempts d'enregistrement en vertu de la Rule 144A (i) de la Loi américaine sur les valeurs mobilières Securities Act de 1933. Ces titres peuvent être revendus dans le cadre d'opérations exemptes d'enregistrement, normalement à des acheteurs institutionnels qualifiés.
- (ii) Titres émis par des émetteurs non américains ou non canadiens.
- (iii) Indique un titre à taux variable. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2023.
- \* Titres non cotés.

Autres informations :

Sauf indication contraire, tous les titres à long terme mentionnés ci-dessus sont négociés sur des marchés réglementés.

#### Abréviations

|       |                   |
|-------|-------------------|
| AUD : | Dollar australien |
| BRL:  | Réal brésilien    |
| CAD : | Dollar canadien   |
| CHF : | Franc suisse      |
| CLP : | Peso chilien      |
| CNH : | Yuan chinois      |
| COP : | Peso colombien    |

**Calendrier des investissements****Au 30 juin 2023**

## Abréviations (suite)

|       |                          |
|-------|--------------------------|
| CZK : | Couronne tchèque         |
| DKK : | Couronne danoise         |
| EUR : | Euro                     |
| GBP : | Livre sterling           |
| HKD : | Dollar de Hong Kong      |
| IDR : | Roupie indonésienne      |
| ILS : | Nouveau Shekel Israélien |
| INR : | Roupie indienne          |
| JPY : | Yen japonais             |
| KRW : | Won coréen               |
| MXN : | Peso mexicain            |
| MYR : | Ringgit malais           |
| NOK : | Couronne norvégienne     |
| NZD : | Dollar néo-zélandais     |
| PEN : | Sol péruvien             |
| PLN : | Zloty polonais           |
| SAR : | Riyal saoudien           |
| SEK : | Couronne suédoise        |
| THB : | Baht thaïlandais         |
| TRY : | Livre turque             |
| TWD : | Nouveau dollar de Taïwan |
| USD : | Dollar américain         |
| UYU : | Peso uruguayen           |
| ZAR : | Rand sud-africain        |

**Analyse de l'actif total****% de  
Total de l'actif**

|                                                                                                                                        |               |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle ou échangés sur un marché réglementé                 | 57,89         |
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire autres que ceux admis à une cote officielle ou négociés sur un marché réglementé | 14,97         |
| Instruments financiers dérivés                                                                                                         | 0,50          |
| Actif circulant                                                                                                                        | 26,64         |
|                                                                                                                                        | <u>100,00</u> |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                                           |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME –</b>                            |     |                    |                        |                     |
| <b>93,89 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 94,69 %)</b>                                |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 93,89 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 94,69 %)</b> |     |                    |                        |                     |
| <b>Australie - 0,26 % (31 décembre 2022 : 0,27 %)</b>                                     |     |                    |                        |                     |
| CIMIC Finance Ltd, 1,500 %, 28/05/29 EMTN (i)                                             | EUR | 100 000            | 77 803                 | 0,26                |
|                                                                                           |     |                    | 77 803                 | 0,26                |
| <b>Autriche - 2,12 % (31 décembre 2022 : 3,02 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| ams-OSRAM AG, 6,000 %, 31/07/25 (i)                                                       | EUR | 100 000            | 89 000                 | 0,30                |
| BAWAG Group AG, 2,375 %, 26/03/29 EMTN (i) (ii)                                           | EUR | 200 000            | 184 476                | 0,61                |
| Erste Group Bank AG, 1,625 %, 08/09/31 EMTN (i) (ii)                                      | EUR | 200 000            | 176 096                | 0,58                |
| OMV AG, 6,250 % (i) (ii) (iii)                                                            | EUR | 100 000            | 102 476                | 0,34                |
| Sappi Papier Holding GmbH, 3,625 %, 15/03/28 (i)                                          | EUR | 100 000            | 87 630                 | 0,29                |
|                                                                                           |     |                    | 639 678                | 2,12                |
| <b>Belgique - 0,61 % (31 décembre 2022 : 1,30 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| KBC Group NV, 0,500 %, 03/12/29 EMTN (i) (ii)                                             | EUR | 100 000            | 92 589                 | 0,31                |
| Solvay SA, 2,500 % (i) (ii) (iii)                                                         | EUR | 100 000            | 91 750                 | 0,30                |
|                                                                                           |     |                    | 184 339                | 0,61                |
| <b>Bermudes - 0,33 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Athora Holding Ltd, 6,625 %, 16/06/28 (i)                                                 | EUR | 100 000            | 99 051                 | 0,33                |
|                                                                                           |     |                    | 99 051                 | 0,33                |
| <b>Îles Vierges britanniques - 0,62 % (31 décembre 2022 : 0,68 %)</b>                     |     |                    |                        |                     |
| Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd, 1,000 %, 12/12/24 (i)                         | EUR | 200 000            | 188 404                | 0,62                |
|                                                                                           |     |                    | 188 404                | 0,62                |
| <b>Îles Caïmans - 0,60 % (31 décembre 2022 : 0,32 %)</b>                                  |     |                    |                        |                     |
| UPCB Finance VII Ltd, 3,625 %, 15/06/29 (i)                                               | EUR | 210 000            | 179 619                | 0,60                |
|                                                                                           |     |                    | 179 619                | 0,60                |
| <b>République tchèque - 0,31 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                            |     |                    |                        |                     |
| Allwyn International AS, 3,875 %, 15/02/27 (i)                                            | EUR | 100 000            | 93 598                 | 0,31                |
|                                                                                           |     |                    | 93 598                 | 0,31                |
| <b>Danemark - 0,97 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Nykredit Realkredit AS, 5,500 %, 29/12/32 (i) (ii)                                        | EUR | 200 000            | 195 659                | 0,65                |
| TDC Net A/S, 5,618 %, 06/02/30 EMTN (i)                                                   | EUR | 100 000            | 98 039                 | 0,32                |
|                                                                                           |     |                    | 293 698                | 0,97                |
| <b>Finlande - 1,34 % (31 décembre 2022 : 3,13 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 0,875 %, 17/09/29 EMTN (i)                        | EUR | 100 000            | 67 976                 | 0,23                |
| Citycon OYJ, 3,625 % (i) (ii) (iii)                                                       | EUR | 255 000            | 131 356                | 0,44                |
| Sampo OYJ, 3,375 %, 23/05/49 (i) (ii)                                                     | EUR | 100 000            | 88 823                 | 0,29                |
| SBB Treasury OYJ, 1,125 %, 26/11/29 EMTN (i)                                              | EUR | 200 000            | 115 596                | 0,38                |
|                                                                                           |     |                    | 403 751                | 1,34                |
| <b>France - 19,63 % (31 décembre 2022 : 18,30 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Accor SA, 2,375 %, 29/11/28 (i)                                                           | EUR | 300 000            | 269 023                | 0,89                |
| Atos SE, 1,000 %, 12/11/29 (i)                                                            | EUR | 100 000            | 64 638                 | 0,21                |
| Atos SE, 2,500 %, 07/11/28 (i)                                                            | EUR | 100 000            | 73 565                 | 0,24                |
| AXA SA, 3,941 % EMTN (i) (ii) (iii)                                                       | EUR | 100 000            | 97 349                 | 0,32                |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 1,875 %, 18/06/29 EMTN (i)                         | EUR | 100 000            | 84 555                 | 0,28                |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 3,875 %, 16/06/32 (i) (ii)                         | EUR | 200 000            | 186 987                | 0,62                |
| BNP Paribas SA, 2,500 %, 31/03/32 EMTN (i) (ii)                                           | EUR | 200 000            | 177 802                | 0,59                |
| CNP Assurances, 1,250 %, 27/01/29 (i)                                                     | EUR | 100 000            | 82 587                 | 0,27                |
| CNP Assurances, 5,250 %, 18/07/53 EMTN (i) (ii)                                           | EUR | 100 000            | 95 636                 | 0,32                |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|  | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--|--------------------|------------------------|---------------------|
|--|--------------------|------------------------|---------------------|

OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME  
(suite)

## OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)

## France - 19,63 % (31 décembre 2022 : 18,30 %) (suite)

|                                                                                                                 |     |         |           |       |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|---------|-----------|-------|
| Crédit Agricole Assurances SA, 2,000 %, 17/07/30 (i)                                                            | EUR | 100 000 | 80 701    | 0,27  |
| Crown European Holdings SA 2,875 %, 01/02/26 (i)                                                                | EUR | 100 000 | 96 025    | 0,32  |
| Électricité de France SA, 2,625 % (i) (ii) (iii)                                                                | EUR | 400 000 | 322 000   | 1,07  |
| Électricité de France SA, 5,000 % EMTN (i) (ii) (iii)                                                           | EUR | 400 000 | 376 500   | 1,25  |
| Elis SA, 2,875 %, 15/02/26 EMTN (i)                                                                             | EUR | 100 000 | 95 208    | 0,31  |
| ELO SACA, 4,875 %, 08/12/28 EMTN (i)                                                                            | EUR | 100 000 | 95 848    | 0,32  |
| Forvia, 2,375 %, 15/06/29 (i)                                                                                   | EUR | 100 000 | 81 652    | 0,27  |
| Forvia, 2,750 %, 15/02/27 (i)                                                                                   | EUR | 300 000 | 271 347   | 0,90  |
| Forvia, 7,250 %, 15/06/26 (i)                                                                                   | EUR | 200 000 | 207 750   | 0,69  |
| Iliad Holding SASU, 5,625 %, 15/10/28 (i)                                                                       | EUR | 100 000 | 92 500    | 0,31  |
| iliad SA, 2,375 %, 17/06/26 (i)                                                                                 | EUR | 300 000 | 277 127   | 0,92  |
| La Poste SA, 0,625 %, 21/10/26 EMTN (i)                                                                         | EUR | 100 000 | 90 035    | 0,30  |
| La Poste SA, 3,125 % (i) (ii) (iii)                                                                             | EUR | 100 000 | 92 500    | 0,31  |
| Loxam SAS, 2,875 %, 15/04/26 (i)                                                                                | EUR | 100 000 | 92 528    | 0,31  |
| Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France<br>et Des Cadres et Sal, 2,125 %, 21/06/52 (i) (ii) | EUR | 100 000 | 68 835    | 0,23  |
| Nexans SA, 5,500 %, 05/04/28 (i)                                                                                | EUR | 100 000 | 102 505   | 0,34  |
| Orano SA, 5,375 %, 15/05/27 EMTN (i)                                                                            | EUR | 100 000 | 102 340   | 0,34  |
| RCI Banque SA, 2,625 %, 18/02/30 (i) (ii)                                                                       | EUR | 200 000 | 185 615   | 0,62  |
| RCI Banque SA, 4,500 %, 06/04/27 EMTN (i)                                                                       | EUR | 200 000 | 196 459   | 0,65  |
| Renault SA, 2,000 %, 28/09/26 EMTN (i)                                                                          | EUR | 300 000 | 272 239   | 0,90  |
| Renault SA, 2,500 %, 02/06/27 EMTN (i)                                                                          | EUR | 100 000 | 90 244    | 0,30  |
| Rexel SA, 2,125 %, 15/12/28 (i)                                                                                 | EUR | 100 000 | 87 463    | 0,29  |
| SCOR SE, 3,250 %, 05/06/47 (i) (ii)                                                                             | EUR | 100 000 | 90 750    | 0,30  |
| Séché Environnement SA, 2,250 %, 15/11/28 (i)                                                                   | EUR | 100 000 | 86 179    | 0,29  |
| Société Générale SA, 0,625 %, 02/12/27 (i) (ii)                                                                 | EUR | 100 000 | 86 605    | 0,29  |
| Société Générale SA, 5,625 %, 02/06/33 EMTN (i)                                                                 | EUR | 100 000 | 98 892    | 0,33  |
| Solvay Finance SACA, 5,425 % (i) (ii) (iii)                                                                     | EUR | 200 000 | 199 500   | 0,66  |
| Tereos Finance Groupe I SA, 4,750 %, 30/04/27 (i)                                                               | EUR | 210 000 | 198 765   | 0,66  |
| Tereos Finance Groupe I SA, 7,500 %, 30/10/25 (i)                                                               | EUR | 100 000 | 102 167   | 0,34  |
| TotalEnergies SE, 2,000 % (i) (ii) (iii)                                                                        | EUR | 100 000 | 87 052    | 0,29  |
| Valeo, 1,000 %, 03/08/28 EMTN (i)                                                                               | EUR | 300 000 | 242 800   | 0,81  |
| Vallourec SA, 8,500 %, 30/06/26 (i)                                                                             | EUR | 210 000 | 209 803   | 0,70  |
|                                                                                                                 |     |         | 5 912 076 | 19,63 |

## Allemagne - 11,90 % (31 décembre 2022 : 10,64 %)

|                                                                            |     |         |         |      |
|----------------------------------------------------------------------------|-----|---------|---------|------|
| Allianz SE, 4,597 %, 07/09/38 EMTN (i) (ii)                                | EUR | 100 000 | 97 193  | 0,32 |
| Allianz SE, 5,824 %, 25/07/53 (i) (ii)                                     | EUR | 100 000 | 102 851 | 0,34 |
| Bayer AG, 3,125 %, 12/11/79 (i) (ii)                                       | EUR | 200 000 | 173 000 | 0,57 |
| Bayer AG, 3,750 %, 01/07/74 (i) (ii)                                       | EUR | 100 000 | 97 079  | 0,32 |
| Bayer AG, 5,375 %, 25/03/82 (i) (ii)                                       | EUR | 100 000 | 92 500  | 0,31 |
| Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,500 %, 23/04/75 EMTN (i) (ii)                  | EUR | 200 000 | 182 250 | 0,60 |
| Deutsche Bank AG, 5,625 %, 19/05/31 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 100 000 | 95 236  | 0,32 |
| Deutsche Lufthansa AG, 2,875 %, 16/05/27 EMTN (i)                          | EUR | 700 000 | 643 153 | 2,14 |
| Deutsche Lufthansa AG, 3,500 %, 14/07/29 EMTN (i)                          | EUR | 100 000 | 90 473  | 0,30 |
| Gruenthal GmbH, 4,125 %, 15/05/28 (i)                                      | EUR | 100 000 | 92 531  | 0,31 |
| HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, Zero Coupon Bond,<br>01/11/24 EMTN (i) | EUR | 100 000 | 93 970  | 0,31 |
| IHO Verwaltungs GmbH, 8,750 %, 15/05/28 (i)                                | EUR | 200 000 | 206 144 | 0,68 |
| Infineon Technologies AG, 2,875 % EMTN (i) (ii) (iii)                      | EUR | 200 000 | 189 924 | 0,63 |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                          |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b> |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                              |     |                    |                        |                     |
| <b>Allemagne - 11,90 % (31 décembre 2022 : 10,64 %) (suite)</b>          |     |                    |                        |                     |
| Mahle GmbH, 2,375 %, 14/05/28 EMTN (i)                                   | EUR | 100 000            | 75 294                 | 0,25                |
| Novelis Sheet Ingot GmbH, 3,375 %, 15/04/29 EMTN (i)                     | EUR | 100 000            | 87 557                 | 0,29                |
| Schaeffler AG, 2,750 %, 12/10/25 EMTN (i)                                | EUR | 100 000            | 95 648                 | 0,32                |
| Schaeffler AG, 3,375 %, 12/10/28 EMTN (i)                                | EUR | 300 000            | 273 000                | 0,91                |
| Talanx AG, 2,250 %, 05/12/47 EMTN (i) (ii)                               | EUR | 200 000            | 174 080                | 0,58                |
| thyssenkrupp AG, 2,875 %, 22/02/24 EMTN (i)                              | EUR | 200 000            | 197 489                | 0,66                |
| ZF Finance GmbH 2,000 %, 06/05/27 EMTN (i)                               | EUR | 300 000            | 260 625                | 0,86                |
| ZF Finance GmbH, 2,250 %, 03/05/28 EMTN (i)                              | EUR | 100 000            | 84 075                 | 0,28                |
| ZF Finance GmbH, 2,750 %, 25/05/27 EMTN (i)                              | EUR | 100 000            | 88 995                 | 0,30                |
| ZF Finance GmbH, 3,750 %, 21/09/28 EMTN (i)                              | EUR | 100 000            | 89 778                 | 0,30                |
|                                                                          |     |                    | 3 582 845              | 11,90               |
| <b>Irlande - 1,56 % (31 décembre 2022 : 1,34 %)</b>                      |     |                    |                        |                     |
| AIB Group PLC, 1,875 %, 19/11/29 EMTN (i) (ii)                           | EUR | 200 000            | 187 940                | 0,63                |
| AIB Group PLC, 2,875 %, 30/05/31 EMTN (i) (ii)                           | EUR | 100 000            | 90 595                 | 0,30                |
| James Hardie International Finance DAC, 3,625 %, 01/10/26 (i)            | EUR | 200 000            | 190 500                | 0,63                |
|                                                                          |     |                    | 469 035                | 1,56                |
| <b>Île de Man - 0,79 % (31 décembre 2022 : 0,14 %)</b>                   |     |                    |                        |                     |
| Playtech PLC, 3,750 %, 12/10/23 (i)                                      | EUR | 37 736             | 37 696                 | 0,13                |
| Playtech PLC, 5,875 %, 28/06/28 (i)                                      | EUR | 200 000            | 199 090                | 0,66                |
|                                                                          |     |                    | 236 786                | 0,79                |
| <b>Italie – 6,13 % (31 décembre 2022 : 6,75 %)</b>                       |     |                    |                        |                     |
| Azzurra Aeroporti SpA, 2,625 %, 30/05/27 (i)                             | EUR | 200 000            | 179 211                | 0,59                |
| Enel SpA, 1,375 % (i) (ii) (iii)                                         | EUR | 100 000            | 81 250                 | 0,27                |
| Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA, 2,125 %, 28/11/24 (i)         | EUR | 200 000            | 176 324                | 0,58                |
| Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,625 %, 21/10/28 (i)              | EUR | 100 000            | 87 615                 | 0,29                |
| Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,750 %, 19/04/31 EMTN (i)         | EUR | 120 000            | 100 951                | 0,33                |
| Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,875 %, 08/07/26 (i)              | EUR | 100 000            | 92 673                 | 0,31                |
| Lottomatica SpA, 7,125 %, 01/06/28 (i)                                   | EUR | 100 000            | 102 262                | 0,34                |
| Lottomatica SpA, 9,750 %, 30/09/27 (i)                                   | EUR | 100 000            | 107 875                | 0,36                |
| Mundys SpA, 1,875 %, 12/02/28 (i)                                        | EUR | 220 000            | 187 726                | 0,62                |
| Poste Italiane SpA, 2,625 % (i) (ii) (iii)                               | EUR | 230 000            | 174 225                | 0,58                |
| Terna - Rete Elettrica Nazionale, 2,375 % (i) (ii) (iii)                 | EUR | 210 000            | 178 763                | 0,59                |
| UniCredit SpA, 2,000 %, 23/09/29 EMTN (i) (ii)                           | EUR | 200 000            | 188 491                | 0,63                |
| Webuild SpA, 3,875 %, 28/07/26 (i)                                       | EUR | 100 000            | 92 011                 | 0,31                |
| Webuild SpA, 5,875 %, 15/12/25 (i)                                       | EUR | 100 000            | 98 264                 | 0,33                |
|                                                                          |     |                    | 1 847 641              | 6,13                |
| <b>Luxembourg - 2,99 % (31 décembre 2022 : 3,01 %)</b>                   |     |                    |                        |                     |
| Aroundtown SA, 2,875 % EMTN (i) (ii) (iii)                               | EUR | 100 000            | 34 000                 | 0,11                |
| CPI Property Group SA, 4,875 % (i) (ii) (iii)                            | EUR | 235 000            | 81 851                 | 0,27                |
| Dana Financing Luxembourg Sarl, 3,000 %, 15/07/29 (i)                    | EUR | 100 000            | 80 968                 | 0,27                |
| Euroclear Investments SA, 2,625 %, 11/04/48 (i) (ii)                     | EUR | 100 000            | 89 894                 | 0,30                |
| Logicor Financing Sarl, 2,250 %, 13/05/25 EMTN (i)                       | EUR | 100 000            | 92 892                 | 0,31                |
| SELP Finance Sarl, 3,750 %, 10/08/27 EMTN (i)                            | EUR | 100 000            | 93 513                 | 0,31                |
| SES SA, 5,625 % (i) (ii) (iii)                                           | EUR | 225 000            | 222 525                | 0,74                |
| Stena International SA, 7,250 %, 15/02/28 (i)                            | EUR | 200 000            | 204 294                | 0,68                |
|                                                                          |     |                    | 899 937                | 2,99                |
| <b>Pays-Bas – 15,27 % (31 décembre 2022 : 17,07 %)</b>                   |     |                    |                        |                     |
| Abertis Infraestructuras Finance BV, 3,248 % (i) (ii) (iii)              | EUR | 400 000            | 358 580                | 1,19                |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                                                |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                       |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                    |     |                    |                        |                     |
| <b>Pays-Bas – 15,27 % (31 décembre 2022 : 17,07 %) (suite)</b>                                 |     |                    |                        |                     |
| ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, 22/02/33 EMTN (i) (ii)                                              | EUR | 100 000            | 97 797                 | 0,32                |
| Achmea BV, 2,500 %, 24/09/39 EMTN (i) (ii)                                                     | EUR | 100 000            | 79 746                 | 0,27                |
| Ashland Services BV, 2,000 %, 30/01/28 (i)                                                     | EUR | 140 000            | 118 334                | 0,39                |
| ASR Nederland NV, 3,375 %, 02/05/49 (i) (ii)                                                   | EUR | 200 000            | 173 348                | 0,58                |
| Citycon Treasury BV, 1,625 %, 12/03/28 EMTN (i)                                                | EUR | 100 000            | 72 613                 | 0,24                |
| ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 % (i) (ii) (iii)                                  | EUR | 170 000            | 162 180                | 0,54                |
| ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft<br>AG, 3,375 %, 29/09/47 (i) (ii) | EUR | 100 000            | 89 992                 | 0,30                |
| ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group, 4,500 %<br>EMTN (i) (ii) (iii)                | EUR | 200 000            | 190 020                | 0,63                |
| Heimstaden Bostad Treasury BV, 1,625 %, 13/10/31 EMTN (i)                                      | EUR | 100 000            | 58 000                 | 0,19                |
| ING Groep NV, 1,625 %, 26/09/29 EMTN (i) (ii)                                                  | EUR | 100 000            | 94 460                 | 0,31                |
| NN Group NV, 5,250 %, 01/03/43 EMTN (i) (ii)                                                   | EUR | 100 000            | 95 243                 | 0,32                |
| OI European Group BV, 6,250 %, 15/05/28 (i)                                                    | EUR | 115 000            | 117 691                | 0,39                |
| PPF Telecom Group BV, 2,125 %, 31/01/25 EMTN (i)                                               | EUR | 300 000            | 287 440                | 0,95                |
| PPF Telecom Group BV, 3,500 %, 20/05/24 EMTN (i)                                               | EUR | 100 000            | 99 787                 | 0,33                |
| Saipem Finance International BV, 3,375 %, 15/07/26 EMTN (i)                                    | EUR | 200 000            | 189 622                | 0,63                |
| Telefonica Europe BV, 3,000 % (i) (ii) (iii)                                                   | EUR | 100 000            | 98 841                 | 0,33                |
| Telefonica Europe BV, 3,875 % (i) (ii) (iii)                                                   | EUR | 800 000            | 738 560                | 2,45                |
| TenneT Holding BV, 2,374 % (i) (ii) (iii)                                                      | EUR | 200 000            | 187 777                | 0,62                |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,625 %, 15/10/28 (i)                           | EUR | 270 000            | 208 237                | 0,69                |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,875 %, 31/03/27 (i)                           | EUR | 250 000            | 212 485                | 0,71                |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4,375 %, 09/05/30 (i)                           | EUR | 200 000            | 170 316                | 0,57                |
| Viterra Finance BV, 0,375 %, 24/09/25 EMTN (i)                                                 | EUR | 100 000            | 91 149                 | 0,30                |
| Wabtec Transportation Netherlands BV, 1,250 %, 03/12/27 (i)                                    | EUR | 100 000            | 86 756                 | 0,29                |
| Wintershall Dea Finance 2 BV, 2,499 % (i) (ii) (iii)                                           | EUR | 400 000            | 339 383                | 1,13                |
| ZF Europe Finance BV, 2,000 %, 23/02/26 (i)                                                    | EUR | 200 000            | 181 750                | 0,60                |
|                                                                                                |     |                    | 4 600 107              | 15,27               |
| <b>Norvège - 0,64 % (31 décembre 2022 : 0,68 %)</b>                                            |     |                    |                        |                     |
| Adevinta ASA, 3,000 %, 15/11/27 (i)                                                            | EUR | 100 000            | 92 782                 | 0,31                |
| Var Energi ASA, 5,500 %, 04/05/29 EMTN (i)                                                     | EUR | 100 000            | 99 639                 | 0,33                |
|                                                                                                |     |                    | 192 421                | 0,64                |
| <b>Portugal - 1,82 % (31 décembre 2022 : 1,63 %)</b>                                           |     |                    |                        |                     |
| EDP - Energias de Portugal SA, 1,700 %, 20/07/80 (i) (ii)                                      | EUR | 600 000            | 547 350                | 1,82                |
|                                                                                                |     |                    | 547 350                | 1,82                |
| <b>Espagne - 5,62 % (31 décembre 2022 : 5,05 %)</b>                                            |     |                    |                        |                     |
| ACS Actividades de Construcción y Servicios SA, 1,375 %, 17/06/25 EMTN (i)                     | EUR | 100 000            | 93 590                 | 0,31                |
| Banco de Sabadell SA, 5,375 %, 12/12/28 EMTN (i) (ii)                                          | EUR | 100 000            | 99 625                 | 0,33                |
| Banco Santander SA, 5,750 %, 23/08/33 EMTN (i) (ii)                                            | EUR | 100 000            | 99 416                 | 0,33                |
| CaixaBank SA, 3,750 %, 15/02/29 EMTN (i) (ii)                                                  | EUR | 100 000            | 98 488                 | 0,33                |
| Cellnex Finance Co S.A., 0,750 %, 15/11/26 EMTN (i)                                            | EUR | 100 000            | 88 111                 | 0,29                |
| Cellnex Finance Co S.A., 1,250 %, 15/01/29 EMTN (i)                                            | EUR | 100 000            | 82 837                 | 0,28                |
| Cellnex Finance Co S.A., 2,250 %, 12/04/26 EMTN (i)                                            | EUR | 100 000            | 93 584                 | 0,31                |
| Cellnex Telecom SA, 1,875 %, 26/06/29 (i)                                                      | EUR | 700 000            | 590 773                | 1,96                |
| Food Service Project SA, 5,500 %, 21/01/27 (i)                                                 | EUR | 100 000            | 94 819                 | 0,31                |

**NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC**
**LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND (suite)**

| <b>Calendrier des investissements</b>                                       |     | <b>Au 30 juin 2023</b> |                            |                         |
|-----------------------------------------------------------------------------|-----|------------------------|----------------------------|-------------------------|
|                                                                             |     | <b>Valeur nominale</b> | <b>Juste valeur en EUR</b> | <b>% de l'actif net</b> |
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)</b>        |     |                        |                            |                         |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                 |     |                        |                            |                         |
| <b>Espagne - 5,62 % (31 décembre 2022 : 5,05 %) (suite)</b>                 |     |                        |                            |                         |
| International Consolidated Airlines Group SA, 3,750 %, 25/03/29 (i)         | EUR | 200 000                | 174 250                    | 0,58                    |
| Mapfre SA, 2,875 %, 13/04/30 (i)                                            | EUR | 100 000                | 86 037                     | 0,29                    |
| Mapfre SA, 4,125 %, 07/09/48 (i) (ii)                                       | EUR | 100 000                | 91 389                     | 0,30                    |
|                                                                             |     |                        | <b>1 692 919</b>           | <b>5,62</b>             |
| <b>Titres supranationaux - 0,59 % (31 décembre 2022 : 0,61 %)</b>           |     |                        |                            |                         |
| Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA Inc, 2,125 %, 15/08/26 (i) | EUR | 200 000                | 177 520                    | 0,59                    |
|                                                                             |     |                        | <b>177 520</b>             | <b>0,59</b>             |
| <b>Suède - 2,63 % (31 décembre 2022 : 2,40 %)</b>                           |     |                        |                            |                         |
| Akelius Residential Property AB, 1,750 %, 07/02/25 EMTN (i)                 | EUR | 100 000                | 93 331                     | 0,31                    |
| Castellum AB, 3,125 % (i) (ii) (iii)                                        | EUR | 100 000                | 70 554                     | 0,24                    |
| Dometic Group AB, 2,000 %, 29/09/28 EMTN (i)                                | EUR | 100 000                | 80 178                     | 0,27                    |
| Heimstaden AB 4,250 %, 09/03/26 (i)                                         | EUR | 100 000                | 53 744                     | 0,18                    |
| Heimstaden Bostad AB, 2,625 % (i) (ii) (iii)                                | EUR | 105 000                | 48 636                     | 0,16                    |
| Heimstaden Bostad AB, 3,375 % (i) (ii) (iii)                                | EUR | 200 000                | 99 500                     | 0,33                    |
| Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 1,000 %, 12/08/27 EMTN (i)             | EUR | 100 000                | 64 304                     | 0,21                    |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1,375 %, 31/10/28 (i) (ii)                | EUR | 100 000                | 98 600                     | 0,33                    |
| Swedbank AB, 3,625 %, 23/08/32 EMTN (i) (ii)                                | EUR | 100 000                | 91 551                     | 0,30                    |
| Volvo Car AB, 2,500 %, 07/10/27 EMTN (i)                                    | EUR | 100 000                | 90 364                     | 0,30                    |
|                                                                             |     |                        | <b>790 762</b>             | <b>2,63</b>             |
| <b>Royaume-Uni - 7,87 % (31 décembre 2022 : 8,11 %)</b>                     |     |                        |                            |                         |
| BP Capital Markets PLC, 3,250 % (i) (ii) (iii)                              | EUR | 100 000                | 92 037                     | 0,30                    |
| HSBC Holdings PLC, 6,364 %, 16/11/32 (i) (ii)                               | EUR | 100 000                | 101 724                    | 0,34                    |
| INEOS Quattro Finance 2 PLC, 2,500 %, 15/01/26 (i)                          | EUR | 330 000                | 294 842                    | 0,98                    |
| International Game Technology PLC, 3,500 %, 15/06/26 (i)                    | EUR | 200 000                | 192 750                    | 0,64                    |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC, 2,200 %, 15/01/24 (i)                     | EUR | 100 000                | 98 121                     | 0,32                    |
| Lloyds Banking Group PLC, 1,750 %, 07/09/28 EMTN (i) (ii)                   | EUR | 100 000                | 99 125                     | 0,33                    |
| NGG Finance PLC, 2,125 %, 05/09/82 (i) (ii)                                 | EUR | 200 000                | 171 750                    | 0,57                    |
| Nomad Foods Bondco PLC, 2,500 %, 24/06/28 (i)                               | EUR | 150 000                | 131 505                    | 0,44                    |
| PEU Fin PLC, 7,250 %, 01/07/28 (i)                                          | EUR | 100 000                | 100 159                    | 0,33                    |
| Rolls-Royce PLC, 1,625 %, 09/05/28 EMTN (i)                                 | EUR | 250 000                | 211 255                    | 0,70                    |
| Standard Chartered PLC, 2,500 %, 09/09/30 (i) (ii)                          | EUR | 200 000                | 185 508                    | 0,62                    |
| Vmed O2 UK Financing I PLC, 3,250 %, 31/01/31 (i)                           | EUR | 300 000                | 246 060                    | 0,82                    |
| Vodafone Group PLC, 2,625 %, 27/08/80 (i) (ii)                              | EUR | 495 000                | 445 437                    | 1,48                    |
|                                                                             |     |                        | <b>2 370 273</b>           | <b>7,87</b>             |
| <b>États-Unis - 9,29 % (31 décembre 2022 : 9,56 %)</b>                      |     |                        |                            |                         |
| Avantor Funding Inc, 2,625 %, 01/11/25                                      | EUR | 100 000                | 95 806                     | 0,32                    |
| Avantor Funding Inc, 3,875 %, 15/07/28                                      | EUR | 200 000                | 182 880                    | 0,61                    |
| Ball Corp, 1,500 %, 15/03/27                                                | EUR | 100 000                | 89 267                     | 0,30                    |
| Belden Inc, 3,375 %, 15/07/27                                               | EUR | 100 000                | 93 098                     | 0,31                    |
| Belden Inc, 3,875 %, 15/03/28                                               | EUR | 100 000                | 93 625                     | 0,31                    |
| Emerald Debt Merger Sub LLC, 6,375 %, 15/12/30 *                            | EUR | 200 000                | 199 783                    | 0,66                    |
| Ford Motor Credit Co LLC, 1,744 %, 19/07/24 EMTN                            | EUR | 195 000                | 188 397                    | 0,63                    |
| Ford Motor Credit Co LLC, 3,250 %, 15/09/25 EMTN                            | EUR | 300 000                | 287 632                    | 0,96                    |
| Ford Motor Credit Co LLC, 6,125 %, 15/05/28                                 | EUR | 135 000                | 138 635                    | 0,46                    |
| General Motors Financial Co, Inc., 4,500 %, 22/11/27 EMTN                   | EUR | 100 000                | 99 156                     | 0,33                    |
| IQVIA Inc, 2,250 %, 15/01/28                                                | EUR | 400 000                | 352 380                    | 1,17                    |

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |
|--------------------------------|-----------------|
|--------------------------------|-----------------|

|  | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--|--------------------|------------------------|---------------------|
|--|--------------------|------------------------|---------------------|

# **OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)**

## **OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)**

### **États-Unis – 9,29 % (31 décembre 2022 : 9,56 %) (suite)**

|                                                                   |     |         |                  |             |
|-------------------------------------------------------------------|-----|---------|------------------|-------------|
| IQVIA Inc, 2,875 %, 15/06/28                                      | EUR | 200 000 | 179 750          | 0,60        |
| Levi Strauss & Co, 3,375 %, 15/03/27                              | EUR | 100 000 | 94 520           | 0,31        |
| MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, 0,993 %, 15/10/26  | EUR | 110 000 | 82 676           | 0,27        |
| Netflix Inc, 4,625 %, 15/05/29                                    | EUR | 100 000 | 101 093          | 0,34        |
| Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 2,875 %, 30/04/28 | EUR | 300 000 | 260 202          | 0,86        |
| Standard Industries Inc, 2,250 %, 21/11/26                        | EUR | 100 000 | 88 647           | 0,29        |
| WMG Acquisition Corp, 2,250 %, 15/08/31                           | EUR | 215 000 | 170 011          | 0,56        |
|                                                                   |     |         | <u>2 797 558</u> | <u>9,29</u> |

|                                               |  |                   |              |
|-----------------------------------------------|--|-------------------|--------------|
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES</b> |  | <b>28 277 171</b> | <b>93,89</b> |
|-----------------------------------------------|--|-------------------|--------------|

|                                                                            |  |                   |              |
|----------------------------------------------------------------------------|--|-------------------|--------------|
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES OBLIGATIONS À MOYEN TERME</b> |  | <b>28 277 171</b> | <b>93,89</b> |
|----------------------------------------------------------------------------|--|-------------------|--------------|

**TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR  
PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS  
INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS  
(Coût : 28 933 025 EUR)**

|                   |              |
|-------------------|--------------|
| <b>28 277 171</b> | <b>93,89</b> |
|-------------------|--------------|

## **INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS - (0,02 %) (31 décembre 2022 : (0,09 %))**

### **Contrats de change à terme en cours - 0,00 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)**

| Date<br>d'échéance                                                 | Montant acheté | Montant vendu | Contrepartie            | Plus-value/<br>(Moins-value)<br>latente<br>USD | % de<br>l'actif net |
|--------------------------------------------------------------------|----------------|---------------|-------------------------|------------------------------------------------|---------------------|
| 31/07/23                                                           | 2 840 CHF      | 2 900 EUR     | Brown Brothers Harriman | 14                                             | 0,00 %              |
| 31/07/23                                                           | 2 854 CHF      | 2 914 EUR     | Brown Brothers Harriman | 14                                             | 0,00 %              |
| 31/07/23                                                           | 2 902 CHF      | 2 963 EUR     | Brown Brothers Harriman | 15                                             | 0,00 %              |
| Plus-value latente sur les contrats de change à terme en cours     |                |               |                         | <u>43</u>                                      | <u>0,00 %</u>       |
| <b>Gain latent net sur les contrats de change à terme en cours</b> |                |               |                         | <b>43</b>                                      | <b>0,00 %</b>       |



## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Contrats à terme normalisés - (0,02) % (31 décembre 2022 : (0,09 %))

| Nombre de<br>contrats                                                | Libellé                               | Contrepartie | Engagement | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | % de l'actif<br>net |
|----------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|--------------|------------|-----------------------------------------|---------------------|
| (12)                                                                 | Euro-Bobl September 2023<br>Futures   | JP Morgan    | 1 406 160  | 17 640                                  | 0,06 %              |
| 3                                                                    | Euro-Bund September 2023<br>Futures   | JP Morgan    | 402 630    | (1 410)                                 | (0,00 %)            |
| 28                                                                   | Euro-Schatz September 2023<br>Futures | JP Morgan    | 2 958 480  | (22 680)                                | (0,08 %)            |
| Plus-value latente sur les contrats à terme normalisés               |                                       |              |            | 17 640                                  | 0,06 %              |
| Moins-value latente sur les contrats à terme normalisés              |                                       |              |            | (24 090)                                | (0,08 %)            |
| <b>Moins-value nette latente sur les contrats à terme normalisés</b> |                                       |              |            | <b>(6 450)</b>                          | <b>(0,02 %)</b>     |

|                                                                                                                                      | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|---------------------|
| <b>Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat</b>                                       | <b>28 294 854</b>      | <b>93,95</b>        |
| <b>Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat</b>                                        | <b>(24 090)</b>        | <b>(0,08)</b>       |
| <b>TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE<br/>VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT<br/>ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS</b> | <b>28 270 764</b>      | <b>93,87</b>        |
| Avoirs nets en banque                                                                                                                | 1 464 597              | 4,86                |
| Autres actifs                                                                                                                        | 854 709                | 2,84                |
| Moins autres passifs                                                                                                                 | (472 707)              | (1,57)              |
| <b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS<br/>PARTICIPANTES REMBOURSABLES</b>                                                | <b>30 117 363</b>      | <b>100,00</b>       |

## LES DIX PREMIÈRES PARTICIPATIONS SECTORIELLES AU 30 JUIN 2023 EN POURCENTAGE DE L'ACTIF NET

|                            |         |
|----------------------------|---------|
| Automobile                 | 12,91 % |
| Activités bancaires        | 9,97 %  |
| Télécommunications         | 7,73 %  |
| Ingénierie et construction | 7,13 %  |
| Assurance                  | 6,25 %  |
| Électricité                | 6,19 %  |
| Produits pharmaceutiques   | 4,34 %  |
| Immobilier                 | 3,91 %  |
| Airlines                   | 3,01 %  |
| Loisirs                    | 3,00 %  |

- (i) Titres émis par des émetteurs non américains ou non canadiens.
- (ii) Indique un titre à taux variable. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2023.
- (iii) Obligations perpétuelles.
- \* Titres non cotés.

Autres informations :

Sauf indication contraire, tous les titres à long terme mentionnés ci-dessus sont négociés sur des marchés réglementés.

#### Abréviations

CHF : Franc suisse  
 EUR : Euro

#### Analyse de l'actif total

% de  
l'actif total

|                                                                                                                                        |               |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle ou échangés sur un marché réglementé                 | 91,14         |
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire autres que ceux admis à une cote officielle ou négociés sur un marché réglementé | 1,30          |
| Instruments financiers dérivés                                                                                                         | (0,02)        |
| Actif circulant                                                                                                                        | 7,58          |
|                                                                                                                                        | <u>100,00</u> |

|                                                                                           |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME –</b>                            |     |                    |                        |                     |
| <b>96,92 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 97,92 %)</b>                                |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 96,92 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 97,92 %)</b> |     |                    |                        |                     |
| <b>Australie - 0,10 % (31 décembre 2022 : 0,10 %)</b>                                     |     |                    |                        |                     |
| CIMIC Finance Ltd, 1,500 %, 28/05/29 EMTN (i)                                             | EUR | 140 000            | 108 924                | 0,10                |
|                                                                                           |     |                    | 108 924                | 0,10                |
| <b>Autriche - 1,20 % (31 décembre 2022 : 1,12 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| BAWAG Group AG, 2,375 %, 26/03/29 EMTN (i) (ii)                                           | EUR | 400 000            | 368 952                | 0,33                |
| BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische                            |     |                    |                        |                     |
| Postsparkasse AG, 4,125 %, 18/01/27 EMTN (i)                                              | EUR | 300 000            | 293 734                | 0,27                |
| Erste Group Bank AG, 1,625 %, 08/09/31 EMTN (i) (ii)                                      | EUR | 300 000            | 264 144                | 0,24                |
| Erste Group Bank AG, 4,250 %, 30/05/30 EMTN (i) (ii)                                      | EUR | 400 000            | 397 136                | 0,36                |
|                                                                                           |     |                    | 1 323 966              | 1,20                |
| <b>Belgique - 3,27 % (31 décembre 2022 : 3,28 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,700 %, 02/04/40 EMTN (i)                                    | EUR | 400 000            | 379 828                | 0,34                |
| Argenta Spaarbank NV, 1,000 %, 06/02/24 EMTN (i)                                          | EUR | 600 000            | 588 150                | 0,53                |
| Belfius Bank SA, 3,125 %, 11/05/26 (i)                                                    | EUR | 100 000            | 95 226                 | 0,09                |
| Belfius Bank SA, 3,875 %, 12/06/28 EMTN (i)                                               | EUR | 400 000            | 396 254                | 0,36                |
| Euroclear Bank SA, 3,625 %, 13/10/27 EMTN (i)                                             | EUR | 305 000            | 302 130                | 0,27                |
| FLUVIUS System Operator CVBA, 0,250 %, 14/06/28 EMTN (i)                                  | EUR | 600 000            | 504 600                | 0,46                |
| KBC Group NV, 0,750 %, 21/01/28 EMTN (i) (ii)                                             | EUR | 400 000            | 349 651                | 0,32                |
| KBC Group NV, 1,625 %, 18/09/29 EMTN (i) (ii)                                             | EUR | 100 000            | 94 872                 | 0,09                |
| KBC Group NV, 4,375 %, 19/04/30 EMTN (i) (ii)                                             | EUR | 200 000            | 198 133                | 0,18                |
| KBC Group NV, 4,500 %, 06/06/26 EMTN (i) (ii)                                             | EUR | 400 000            | 397 673                | 0,36                |
| Proximus SADP, 4,000 %, 08/03/30 EMTN (i)                                                 | EUR | 300 000            | 302 097                | 0,27                |
|                                                                                           |     |                    | 3 608 614              | 3,27                |
| <b>Bermudes - 0,18 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Athora Holding Ltd, 6,625 %, 16/06/28 (i)                                                 | EUR | 200 000            | 198 102                | 0,18                |
|                                                                                           |     |                    | 198 102                | 0,18                |
| <b>Îles Vierges britanniques - 0,25 % (31 décembre 2022 : 0,27 %)</b>                     |     |                    |                        |                     |
| Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd, 1,000 %, 12/12/24 (i)                         | EUR | 300 000            | 282 607                | 0,25                |
|                                                                                           |     |                    | 282 607                | 0,25                |
| <b>Canada - 0,65 % (31 décembre 2022 : 1,46 %)</b>                                        |     |                    |                        |                     |
| Great-West Lifeco Inc, 4,700 %, 16/11/29                                                  | EUR | 220 000            | 225 291                | 0,20                |
| Mercedes-Benz Finance Canada Inc, 3,000 %, 23/02/27 EMTN                                  | EUR | 510 000            | 496 042                | 0,45                |
|                                                                                           |     |                    | 721 333                | 0,65                |
| <b>Îles Caïmans - 0,26 % (31 décembre 2022 : 0,28 %)</b>                                  |     |                    |                        |                     |
| CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd 0,750 % 02/11/29 (i)                                   | EUR | 360 000            | 289 415                | 0,26                |
|                                                                                           |     |                    | 289 415                | 0,26                |
| <b>Danemark - 1,19 % (31 décembre 2022 : 1,05 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Carlsberg Breweries AS, 3,500 %, 26/11/26 EMTN (i)                                        | EUR | 320 000            | 316 355                | 0,29                |
| Jyske Bank A/S, 0,250 %, 17/02/28 EMTN (i) (ii)                                           | EUR | 175 000            | 148 917                | 0,13                |
| Nykredit Realkredit AS, 0,750 %, 20/01/27 EMTN (i)                                        | EUR | 460 000            | 400 355                | 0,36                |
| Nykredit Realkredit AS, 5,500 %, 29/12/32 (i) (ii)                                        | EUR | 200 000            | 195 659                | 0,18                |
| Orsted AS, 3,750 %, 01/03/30 EMTN (i)                                                     | EUR | 250 000            | 249 402                | 0,23                |
|                                                                                           |     |                    | 1 310 688              | 1,19                |
| <b>Finlande - 1,55 % (31 décembre 2022 : 0,28 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 0,875 %, 17/09/29 EMTN                            |     |                    |                        |                     |
| (i)                                                                                       | EUR | 295 000            | 200 530                | 0,18                |
| Fortum OYJ, 4,500 %, 26/05/33 EMTN (i)                                                    | EUR | 270 000            | 272 600                | 0,25                |
| Nokia OYJ, 3,125 %, 15/05/28 EMTN (i)                                                     | EUR | 200 000            | 188 305                | 0,17                |

|                                                                          |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b> |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                              |     |                    |                        |                     |
| <b>Finlande - 1,55 % (31 décembre 2022 : 0,28 %) (suite)</b>             |     |                    |                        |                     |
| Nordea Bank Abp, 4,125 %, 05/05/28 EMTN (i)                              | EUR | 370 000            | 366 264                | 0,33                |
| Sampo OYJ, 3,375 %, 23/05/49 (i) (ii)                                    | EUR | 100 000            | 88 823                 | 0,08                |
| Stora Enso OYJ, 4,250 %, 01/09/29 EMTN (i)                               | EUR | 230 000            | 229 969                | 0,21                |
| Teollisuuden Voima OYJ, 4,750 %, 01/06/30 EMTN (i)                       | EUR | 145 000            | 144 910                | 0,13                |
| UPM-Kymmene OYJ, 0,500 %, 22/03/31 EMTN (i)                              | EUR | 280 000            | 215 569                | 0,20                |
|                                                                          |     |                    | 1 706 970              | 1,55                |
| <b>France - 16,48 % (31 décembre 2022 : 14,54 %)</b>                     |     |                    |                        |                     |
| Accor SA, 2,375 %, 29/11/28 (i)                                          | EUR | 300 000            | 269 023                | 0,24                |
| ALD SA, 4,250 %, 18/01/27 EMTN (i)                                       | EUR | 300 000            | 298 727                | 0,27                |
| APRR SA, 3,125 %, 24/01/30 EMTN (i)                                      | EUR | 300 000            | 291 454                | 0,26                |
| Arval Service Lease SA, 0,875 %, 17/02/25 EMTN (i)                       | EUR | 500 000            | 471 449                | 0,43                |
| Arval Service Lease SA, 4,125 %, 13/04/26 EMTN (i)                       | EUR | 300 000            | 296 928                | 0,27                |
| Arval Service Lease SA, 4,250 %, 11/11/25 EMTN (i)                       | EUR | 200 000            | 198 454                | 0,18                |
| Autoroutes du Sud de la France SA, 3,250 %, 19/01/33 EMTN (i)            | EUR | 300 000            | 288 496                | 0,26                |
| AXA SA, 1,875 %, 10/07/42 EMTN (i) (ii)                                  | EUR | 390 000            | 294 063                | 0,27                |
| AXA SA, 3,941 % EMTN (i) (ii) (iii)                                      | EUR | 100 000            | 97 349                 | 0,09                |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,250 %, 19/07/28 (i)             | EUR | 500 000            | 405 792                | 0,37                |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,625 %, 03/11/28 EMTN (i)        | EUR | 300 000            | 245 582                | 0,22                |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,750 %, 08/06/26 EMTN (i)        | EUR | 700 000            | 633 083                | 0,57                |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 1,375 %, 16/07/28 EMTN (i)        | EUR | 300 000            | 263 074                | 0,24                |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 1,875 %, 18/06/29 EMTN (i)        | EUR | 400 000            | 338 219                | 0,31                |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 4,125 %, 14/06/33 EMTN (i)        | EUR | 400 000            | 398 425                | 0,36                |
| Banque Stellantis France SACA, 0,625 %, 21/06/24 (i)                     | EUR | 100 000            | 96 548                 | 0,09                |
| Banque Stellantis France SACA, 3,875 %, 19/01/26 EMTN (i)                | EUR | 100 000            | 99 170                 | 0,09                |
| BNP Paribas SA, 0,250 %, 13/04/27 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 800 000            | 707 165                | 0,64                |
| BNP Paribas SA, 0,500 %, 19/01/30 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 100 000            | 80 130                 | 0,07                |
| BNP Paribas SA, 1,375 %, 28/05/29 EMTN (i)                               | EUR | 200 000            | 168 523                | 0,15                |
| BNP Paribas SA, 2,500 %, 31/03/32 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 300 000            | 266 703                | 0,24                |
| BNP Paribas SA, 3,875 %, 23/02/29 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 300 000            | 295 434                | 0,27                |
| Bouygues SA, 3,875 %, 17/07/31 (i)                                       | EUR | 500 000            | 494 800                | 0,45                |
| CNP Assurances, 1,250 %, 27/01/29 (i)                                    | EUR | 100 000            | 82 587                 | 0,08                |
| CNP Assurances, 5,250 %, 18/07/53 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 100 000            | 95 636                 | 0,09                |
| Coentreprise de Transport d'Électricité SA, 0,875 %, 29/09/24 (i)        | EUR | 300 000            | 287 595                | 0,26                |
| Coentreprise de Transport d'Électricité SA, 2,125 %, 29/07/32 (i)        | EUR | 300 000            | 257 043                | 0,23                |
| Crédit Agricole SA, 0,625 %, 12/01/28 (i) (ii)                           | EUR | 100 000            | 87 150                 | 0,08                |
| Crédit Agricole SA, 1,875 %, 22/04/27 (i) (ii)                           | EUR | 600 000            | 556 680                | 0,50                |
| Crédit Agricole SA, 3,375 %, 28/07/27 EMTN (i)                           | EUR | 200 000            | 194 762                | 0,18                |
| Crédit Agricole SA, 3,875 %, 20/04/31 EMTN (i)                           | EUR | 200 000            | 197 646                | 0,18                |
| Crédit Agricole SA, 4,250 %, 11/07/29 (i) (ii)                           | EUR | 300 000            | 298 029                | 0,27                |
| Crédit Mutuel Arkea SA, 4,250 %, 01/12/32 EMTN (i)                       | EUR | 200 000            | 200 579                | 0,18                |
| Électricité de France SA, 4,250 %, 25/01/32 EMTN (i)                     | EUR | 100 000            | 98 796                 | 0,09                |
| Électricité de France SA, 4,375 %, 12/10/29 EMTN (i)                     | EUR | 700 000            | 706 448                | 0,64                |
| Électricité de France SA, 4,625 %, 25/01/43 EMTN (i)                     | EUR | 100 000            | 95 635                 | 0,09                |
| Engie SA, 1,500 % (i) (ii) (iii)                                         | EUR | 300 000            | 245 233                | 0,22                |

|                                                                          |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b> |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                              |     |                    |                        |                     |
| <b>France - 16,48 % (31 décembre 2022 : 14,54 %) (suite)</b>             |     |                    |                        |                     |
| Engie SA, 4,000 %, 11/01/35 EMTN (i)                                     | EUR | 200 000            | 199 017                | 0,18                |
| Firmenich Productions Participations SAS, 1,750 %, 30/04/30 (i)          | EUR | 245 000            | 215 143                | 0,20                |
| Engie SA, 1,625 %, 14/03/30 EMTN (i)                                     | EUR | 400 000            | 340 874                | 0,31                |
| Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 2,500 %, 04/05/27 EMTN (i)  | EUR | 200 000            | 186 608                | 0,17                |
| La Banque Postale SA, 4,000 %, 03/05/28 EMTN (i)                         | EUR | 400 000            | 395 719                | 0,36                |
| L'Oréal SA, 2,875 %, 19/05/28 EMTN (i)                                   | EUR | 400 000            | 389 284                | 0,35                |
| Orange SA, 1,250 %, 07/07/27 EMTN (i)                                    | EUR | 500 000            | 456 638                | 0,41                |
| Orange SA, 5,375 % EMTN (i) (ii) (iii)                                   | EUR | 200 000            | 197 993                | 0,18                |
| Orano SA, 5,375 %, 15/05/27 EMTN (i)                                     | EUR | 200 000            | 204 680                | 0,19                |
| PSA Tresorerie GIE, 6,000 %, 19/09/33 (i)                                | EUR | 95 000             | 104 115                | 0,09                |
| RCI Banque SA, 4,500 %, 06/04/27 EMTN (i)                                | EUR | 325 000            | 319 245                | 0,29                |
| RTE Réseau de Transport d'Électricité SADIR, 3,750 %, 04/07/35 EMTN (i)  | EUR | 300 000            | 298 660                | 0,27                |
| Société Générale SA, 0,500 %, 12/06/29 (i) (ii)                          | EUR | 300 000            | 243 328                | 0,22                |
| Société Générale SA, 0,625 %, 02/12/27 (i) (ii)                          | EUR | 800 000            | 692 845                | 0,63                |
| Société Générale SA, 1,500 %, 30/05/25 EMTN (i) (ii)                     | EUR | 400 000            | 388 633                | 0,35                |
| Société Générale SA, 4,125 %, 02/06/27 (i)                               | EUR | 200 000            | 198 054                | 0,18                |
| Société Générale SA, 5,625 %, 02/06/33 EMTN (i)                          | EUR | 200 000            | 197 783                | 0,18                |
| Société Nationale SNCF SA, 1,000 %, 25/05/40 (i)                         | EUR | 300 000            | 197 498                | 0,18                |
| Suez SACA, 4,625 %, 03/11/28 EMTN (i)                                    | EUR | 600 000            | 612 841                | 0,56                |
| TotalEnergies Capital International SA, 0,696 %, 31/05/28 EMTN (i)       | EUR | 500 000            | 434 974                | 0,39                |
| TotalEnergies Capital International SA, 1,618 %, 18/05/40 EMTN (i)       | EUR | 200 000            | 144 586                | 0,13                |
| TotalEnergies SE, 1,750 % EMTN (i) (ii) (iii)                            | EUR | 110 000            | 106 300                | 0,10                |
| TotalEnergies SE, 2,000 % (i) (ii) (iii)                                 | EUR | 700 000            | 609 364                | 0,55                |
| Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0,750 %, 25/10/28 EMTN (i)                 | EUR | 300 000            | 242 039                | 0,22                |
| Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0,875 %, 29/03/32 EMTN (i)                 | EUR | 100 000            | 69 678                 | 0,06                |
| Verallia SA, 1,875 %, 10/11/31 (i)                                       | EUR | 200 000            | 160 727                | 0,15                |
| WPP Finance SA, 4,125 %, 30/05/28 EMTN (i)                               | EUR | 170 000            | 169 876                | 0,15                |
|                                                                          |     |                    | 18 178 912             | 16,48               |
| <b>Allemagne - 9,26 % (31 décembre 2022 : 8,27 %)</b>                    |     |                    |                        |                     |
| Allianz SE, 4,597 %, 07/09/38 EMTN (i) (ii)                              | EUR | 300 000            | 291 580                | 0,26                |
| Allianz SE, 5,824 %, 25/07/53 (i) (ii)                                   | EUR | 100 000            | 102 851                | 0,09                |
| Amprion GmbH, 0,625 %, 23/09/33 EMTN (i)                                 | EUR | 200 000            | 145 061                | 0,13                |
| Bayer AG, 4,250 %, 26/08/29 EMTN (i)                                     | EUR | 300 000            | 302 236                | 0,27                |
| Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,500 %, 29/05/29 (i)                          | EUR | 200 000            | 194 578                | 0,18                |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, 15/02/25 (i)          | EUR | 600 000            | 574 412                | 0,52                |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,000 %, 15/08/24 (i)          | EUR | 865 000            | 842 747                | 0,76                |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,000 %, 04/01/37 (i)          | EUR | 1 085 000          | 1 272 423              | 1,15                |
| Commerzbank AG, 0,750 %, 24/03/26 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 300 000            | 278 167                | 0,25                |
| Deutsche Bahn Finance GmbH, 1,125 %, 29/05/51 EMTN (i)                   | EUR | 110 000            | 64 536                 | 0,06                |
| Deutsche Bahn Finance GmbH, 1,375 %, 03/03/34 EMTN (i)                   | EUR | 565 000            | 457 788                | 0,42                |
| Deutsche Bank AG, 1,375 %, 03/09/26 EMTN (i) (ii)                        | EUR | 600 000            | 550 744                | 0,50                |
| Deutsche Bank AG, 3,250 %, 24/05/28 (i) (ii)                             | EUR | 200 000            | 184 342                | 0,17                |
| Deutsche Bank AG, 5,625 %, 19/05/31 EMTN (i) (ii)                        | EUR | 100 000            | 95 236                 | 0,09                |
| Deutsche Post AG, 3,375 %, 03/07/33 EMTN (i)                             | EUR | 340 000            | 335 306                | 0,30                |
| E.ON SE, 1,625 %, 22/05/29 EMTN (i)                                      | EUR | 395 000            | 350 691                | 0,32                |

|                                                                                       |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>              |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                           |     |                    |                        |                     |
| <b>Allemagne - 9,26 % (31 décembre 2022 : 8,27 %) (suite)</b>                         |     |                    |                        |                     |
| Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide, 1,875 %, 31/03/28 (i)                | EUR | 230 000            | 203 387                | 0,18                |
| Hannover Rueck SE, 1,750 %, 08/10/40 (i) (ii)                                         | EUR | 100 000            | 79 171                 | 0,07                |
| Hannover Rueck SE, 3,375 % (i) (ii) (iii)                                             | EUR | 100 000            | 95 625                 | 0,09                |
| Heidelberg Materials AG, 3,750 %, 31/05/32 (i)                                        | EUR | 200 000            | 189 815                | 0,17                |
| HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, Zero Coupon Bond, 01/11/24 EMTN (i)               | EUR | 300 000            | 281 910                | 0,26                |
| Knorr-Bremse AG, 3,250 %, 21/09/27 EMTN (i)                                           | EUR | 300 000            | 294 353                | 0,27                |
| LEG Immobilien SE, 1,250 %, 23/01/24 EMTN (i)                                         | EUR | 300 000            | 293 880                | 0,27                |
| Merck Financial Services GmbH, 0,500 %, 16/07/28 EMTN (i)                             | EUR | 400 000            | 343 873                | 0,31                |
| Merck KGaA, 1,625 %, 09/09/80 (i) (ii)                                                | EUR | 200 000            | 178 216                | 0,16                |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, 26/05/49 (i) (ii) | EUR | 100 000            | 90 718                 | 0,08                |
| Vier Gas Transport GmbH, 1,500 %, 25/09/28 EMTN (i)                                   | EUR | 300 000            | 264 883                | 0,24                |
| Volkswagen Bank GmbH, 4,250 %, 07/01/26 EMTN (i)                                      | EUR | 500 000            | 495 337                | 0,45                |
| Volkswagen Bank GmbH, 4,625 %, 03/05/31 EMTN (i)                                      | EUR | 600 000            | 602 405                | 0,55                |
| Volkswagen Financial Services AG, 0,875 %, 31/01/28 EMTN (i)                          | EUR | 255 000            | 217 890                | 0,20                |
| Vonovia SE, 0,250 %, 01/09/28 EMTN (i)                                                | EUR | 200 000            | 155 289                | 0,14                |
| Vonovia SE, 0,375 %, 16/06/27 EMTN (i)                                                | EUR | 300 000            | 248 924                | 0,23                |
| Vonovia SE, 1,000 %, 16/06/33 (i)                                                     | EUR | 200 000            | 135 596                | 0,12                |
|                                                                                       |     |                    | 10 213 970             | 9,26                |
| <b>Irlande - 2,40 % (31 décembre 2022 : 2,82 %)</b>                                   |     |                    |                        |                     |
| Abbott Ireland Financing DAC, 1,500 %, 27/09/26 (i)                                   | EUR | 300 000            | 280 378                | 0,25                |
| AIB Group PLC, 1,875 %, 19/11/29 EMTN (i) (ii)                                        | EUR | 300 000            | 281 910                | 0,26                |
| AIB Group PLC, 2,250 %, 04/04/28 EMTN (i) (ii)                                        | EUR | 150 000            | 135 993                | 0,12                |
| AIB Group PLC, 5,750 %, 16/02/29 (i) (ii)                                             | EUR | 300 000            | 308 805                | 0,28                |
| CCEP Finance Ireland DAC, Zero Coupon Bond, 06/09/25 (i)                              | EUR | 520 000            | 477 045                | 0,43                |
| Lunar Funding V for Swisscom AG, 1,125 %, 12/10/26 (i)                                | EUR | 675 000            | 617 621                | 0,56                |
| PartnerRe Ireland Finance DAC, 1,250 %, 15/09/26 (i)                                  | EUR | 305 000            | 277 063                | 0,25                |
| Permanent TSB Group Holdings PLC, 6,625 %, 25/04/28 (i) (ii)                          | EUR | 270 000            | 269 944                | 0,25                |
|                                                                                       |     |                    | 2 648 759              | 2,40                |
| <b>Italie - 2,17 % (31 décembre 2022 : 2,17 %)</b>                                    |     |                    |                        |                     |
| Autostrade per l'Italia SpA, 2,000 %, 15/01/30 (i)                                    | EUR | 300 000            | 251 538                | 0,23                |
| Enel SpA, 1,375 % (i) (ii) (iii)                                                      | EUR | 375 000            | 304 688                | 0,27                |
| ENI SpA, 2,625 % (i) (ii) (iii)                                                       | EUR | 255 000            | 234 851                | 0,21                |
| Hera SpA, 0,250 %, 03/12/30 EMTN (i)                                                  | EUR | 400 000            | 301 211                | 0,27                |
| Intesa Sanpaolo SpA, 4,000 %, 19/05/26 EMTN (i)                                       | EUR | 220 000            | 217 628                | 0,20                |
| Intesa Sanpaolo SpA, 4,875 %, 19/05/30 EMTN (i)                                       | EUR | 130 000            | 129 754                | 0,12                |
| Leonardo SpA, 2,375 %, 08/01/26 (i)                                                   | EUR | 225 000            | 212 829                | 0,19                |
| Mediobanca Banca di Credito Finanziario spa, 1,000 %, 17/07/29 EMTN (i) (ii)          | EUR | 450 000            | 374 320                | 0,34                |
| Snam SpA, 0,750 %, 17/06/30 EMTN (i)                                                  | EUR | 275 000            | 220 538                | 0,20                |
| UniCredit SpA, 5,850 %, 15/11/27 EMTN (i) (ii)                                        | EUR | 150 000            | 153 468                | 0,14                |
|                                                                                       |     |                    | 2 400 825              | 2,17                |
| <b>Japon - 0,62 % (31 décembre 2022 : 0,23 %)</b>                                     |     |                    |                        |                     |
| Asahi Group Holdings Ltd, 1,151 %, 19/09/25 (i)                                       | EUR | 480 000            | 450 520                | 0,41                |
| Takeda Pharmaceutical Co Ltd., 3,000 %, 21/11/30 (i)                                  | EUR | 250 000            | 234 696                | 0,21                |
|                                                                                       |     |                    | 685 216                | 0,62                |

|                                                                                  |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|----------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME</b>                     |     |                    |                        |                     |
| <b>(suite)</b>                                                                   |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| <b>Liechtenstein - 0,28 % (31 décembre 2022 : 0,60 %)</b>                        |     |                    |                        |                     |
| Swiss Life Finance I Ltd, 0,500 %, 15/09/31 (i)                                  | EUR | 420 000            | 307 318                | 0,28                |
|                                                                                  |     |                    | 307 318                | 0,28                |
| <b>Luxembourg - 4,82 % (31 décembre 2022 : 7,92 %)</b>                           |     |                    |                        |                     |
| Aroundtown SA, 1,450 %, 09/07/28 EMTN (i)                                        | EUR | 200 000            | 135 184                | 0,12                |
| Aroundtown SA, 2,875 % EMTN (i) (ii) (iii)                                       | EUR | 100 000            | 34 000                 | 0,03                |
| Aroundtown SA, 3,375 % (i) (ii) (iii)                                            | EUR | 100 000            | 41 294                 | 0,04                |
| Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 0,334 %, 13/08/28 (i)                        | EUR | 320 000            | 268 594                | 0,24                |
| Bevco Lux Sarl, 1,000 %, 16/01/30 (i)                                            | EUR | 270 000            | 209 746                | 0,19                |
| Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,250 %, 26/04/27 EMTN (i)    | EUR | 200 000            | 159 474                | 0,14                |
| CPI Property Group SA, 1,625 %, 23/04/27 EMTN (i)                                | EUR | 135 000            | 97 916                 | 0,09                |
| DH Europe Finance II Sarl, 0,450 %, 18/03/28 (i)                                 | EUR | 190 000            | 163 662                | 0,15                |
| DH Europe Finance II Sarl, 1,350 %, 18/09/39 (i)                                 | EUR | 300 000            | 208 936                | 0,19                |
| Euroclear Investments SA, 1,125 %, 07/12/26 (i)                                  | EUR | 500 000            | 452 949                | 0,41                |
| Eurofins Scientific SE, 4,000 %, 06/07/29 (i)                                    | EUR | 235 000            | 227 353                | 0,21                |
| John Deere Bank SA, 2,500 %, 14/09/26 EMTN (i)                                   | EUR | 265 000            | 254 716                | 0,23                |
| Logicor Financing Sarl, 1,625 %, 17/01/30 EMTN (i)                               | EUR | 400 000            | 294 664                | 0,27                |
| Medtronic Global Holdings SCA, 1,125 %, 07/03/27 (i)                             | EUR | 555 000            | 505 138                | 0,46                |
| Medtronic Global Holdings SCA, 1,500 %, 02/07/39 (i)                             | EUR | 450 000            | 315 680                | 0,29                |
| Medtronic Global Holdings SCA, 3,125 %, 15/10/31 (i)                             | EUR | 155 000            | 148 364                | 0,13                |
| Novartis Finance SA, Zero Coupon Bond, 23/09/28 (i)                              | EUR | 335 000            | 281 769                | 0,26                |
| SELP Finance Sarl, 3,750 %, 10/08/27 EMTN (i)                                    | EUR | 430 000            | 402 104                | 0,36                |
| SES SA, 5,625 % (i) (ii) (iii)                                                   | EUR | 560 000            | 553 840                | 0,50                |
| SIX Finance Luxembourg SA, Zero Coupon Bond, 02/12/25 (i)                        | EUR | 300 000            | 269 007                | 0,24                |
| Traton Finance Luxembourg SA, 4,250 %, 16/05/28 EMTN (i)                         | EUR | 300 000            | 296 469                | 0,27                |
|                                                                                  |     |                    | 5 320 859              | 4,82                |
| <b>Pays-Bas – 15,36 % (31 décembre 2022 : 16,88 %)</b>                           |     |                    |                        |                     |
| ABN AMRO Bank NV, 4,375 %, 20/10/28 (i)                                          | EUR | 400 000            | 397 674                | 0,36                |
| ABN AMRO Bank NV, 4,500 %, 21/11/34 (i)                                          | EUR | 300 000            | 303 657                | 0,27                |
| ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, 22/02/33 EMTN (i) (ii)                                | EUR | 200 000            | 195 594                | 0,18                |
| AGCO International Holdings BV, 0,800 %, 06/10/28 (i)                            | EUR | 125 000            | 103 730                | 0,09                |
| Airbus SE, 1,375 %, 13/05/31 EMTN (i)                                            | EUR | 200 000            | 167 916                | 0,15                |
| Alliander NV, 2,625 %, 09/09/27 EMTN (i)                                         | EUR | 310 000            | 298 812                | 0,27                |
| Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 1,125 %, 17/09/25 (i)                   | EUR | 600 000            | 562 602                | 0,51                |
| Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co Ltd., 2,750 %, 19/02/49 (i) (ii) | EUR | 240 000            | 209 891                | 0,19                |
| ASR Nederland NV, 3,375 %, 02/05/49 (i) (ii)                                     | EUR | 100 000            | 86 674                 | 0,08                |
| ASR Nederland NV, 5,000 % (i) (ii) (iii)                                         | EUR | 100 000            | 98 174                 | 0,09                |
| ASR Nederland NV, 7,000 %, 07/12/43 (i) (ii)                                     | EUR | 100 000            | 103 943                | 0,09                |
| BP Capital Markets BV, 3,773 %, 12/05/30 EMTN (i)                                | EUR | 500 000            | 492 729                | 0,45                |
| Citycon Treasury BV, 2,375 %, 15/01/27 EMTN (i)                                  | EUR | 200 000            | 159 665                | 0,14                |
| Compass Group Finance Netherlands BV, 3,000 %, 08/03/30 EMTN (i)                 | EUR | 590 000            | 562 133                | 0,51                |
| Cooperatieve Rabobank UA, 4,233 %, 25/04/29 EMTN (i) (ii)                        | EUR | 500 000            | 493 908                | 0,45                |
| Daimler Truck International Finance BV, 3,875 %, 19/06/26 EMTN (i)               | EUR | 100 000            | 99 537                 | 0,09                |
| Daimler Truck International Finance BV, 3,875 %, 19/06/29 EMTN (i)               | EUR | 200 000            | 197 877                | 0,18                |

|                                                                                             |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>                    |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                 |     |                    |                        |                     |
| <b>Pays-Bas – 15,36 % (31 décembre 2022 : 16,88 %) (suite)</b>                              |     |                    |                        |                     |
| easyJet FinCo BV, 1,875 %, 03/03/28 EMTN (i)                                                | EUR | 140 000            | 122 057                | 0,11                |
| ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 % (i) (ii) (iii)                               | EUR | 355 000            | 338 670                | 0,31                |
| ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG, 3,375 %, 29/09/47 (i) (ii) | EUR | 285 000            | 256 477                | 0,23                |
| Enel Finance International NV, 0,875 %, 17/01/31 EMTN (i)                                   | EUR | 300 000            | 238 542                | 0,22                |
| Enel Finance International NV, 4,500 %, 20/02/43 EMTN (i)                                   | EUR | 200 000            | 195 225                | 0,18                |
| Enexis Holding NV, 0,750 %, 02/07/31 EMTN (i)                                               | EUR | 600 000            | 484 030                | 0,44                |
| Essity Capital BV, 3,000 %, 21/09/26 EMTN (i)                                               | EUR | 440 000            | 427 515                | 0,39                |
| Heimstaden Bostad Treasury BV, 1,625 %, 13/10/31 EMTN (i)                                   | EUR | 250 000            | 145 000                | 0,13                |
| Iberdrola International BV, 1,874 % (i) (ii) (iii)                                          | EUR | 400 000            | 359 326                | 0,33                |
| ING Groep NV, 0,250 %, 18/02/29 (i) (ii)                                                    | EUR | 300 000            | 245 536                | 0,22                |
| ING Groep NV, 1,250 %, 16/02/27 (i) (ii)                                                    | EUR | 300 000            | 274 696                | 0,25                |
| ING Groep NV, 2,125 %, 23/05/26 EMTN (i) (ii)                                               | EUR | 300 000            | 285 959                | 0,26                |
| ING Groep NV, 2,500 %, 15/02/29 EMTN (i) (ii)                                               | EUR | 400 000            | 391 244                | 0,35                |
| ING Groep NV, 4,125 %, 24/08/33 (i) (ii)                                                    | EUR | 100 000            | 94 164                 | 0,08                |
| ING Groep NV, 4,500 %, 23/05/29 (i) (ii)                                                    | EUR | 500 000            | 494 395                | 0,45                |
| JAB Holdings BV, 5,000 %, 12/06/33 (i)                                                      | EUR | 200 000            | 202 913                | 0,18                |
| JDE Peet's NV, 0,500 %, 16/01/29 EMTN (i)                                                   | EUR | 210 000            | 172 595                | 0,16                |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0,375 %, 18/03/30 (i)                                        | EUR | 370 000            | 299 683                | 0,27                |
| LeasePlan Corp NV, 0,125 %, 13/09/23 EMTN (i)                                               | EUR | 365 000            | 362 163                | 0,33                |
| Lseg Netherlands BV, Zero Coupon Bond, 06/04/25 EMTN (i)                                    | EUR | 265 000            | 246 783                | 0,22                |
| Mondelez International Holdings Netherlands BV, Zero Coupon Bond, 22/09/26 (i)              | EUR | 360 000            | 318 809                | 0,29                |
| Nederlandse Gasunie NV, 0,375 %, 03/10/31 EMTN (i)                                          | EUR | 105 000            | 80 256                 | 0,07                |
| Nederlandse Gasunie NV, 3,375 %, 11/07/34 EMTN (i)                                          | EUR | 160 000            | 154 620                | 0,14                |
| NN Group NV, 4,375 % EMTN (i) (ii) (iii)                                                    | EUR | 100 000            | 98 361                 | 0,09                |
| NN Group NV, 5,250 %, 01/03/43 EMTN (i) (ii)                                                | EUR | 175 000            | 166 676                | 0,15                |
| PACCAR Financial Europe BV, 3,250 %, 29/11/25 EMTN (i)                                      | EUR | 310 000            | 304 565                | 0,28                |
| PACCAR Financial Europe BV, 3,375 %, 15/05/26 EMTN (i)                                      | EUR | 350 000            | 345 212                | 0,31                |
| Prosus NV, 2,085 %, 19/01/30 (i)                                                            | EUR | 180 000            | 140 400                | 0,13                |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1,750 %, 28/02/39 EMTN (i)                            | EUR | 200 000            | 156 817                | 0,14                |
| Sika Capital BV, 3,750 %, 03/11/26 (i)                                                      | EUR | 535 000            | 531 751                | 0,48                |
| Sika Capital BV, 3,750 %, 03/05/30 (i)                                                      | EUR | 205 000            | 204 378                | 0,18                |
| Stedin Holding NV, 0,875 %, 24/10/25 EMTN (i)                                               | EUR | 540 000            | 502 832                | 0,46                |
| Stellantis NV, 0,750 %, 18/01/29 EMTN (i)                                                   | EUR | 180 000            | 150 284                | 0,14                |
| Telefonica Europe BV, 3,875 % (i) (ii) (iii)                                                | EUR | 300 000            | 276 960                | 0,25                |
| TenneT Holding BV, 1,375 %, 26/06/29 EMTN (i)                                               | EUR | 300 000            | 265 917                | 0,24                |
| TenneT Holding BV, 1,500 %, 03/06/39 EMTN (i)                                               | EUR | 100 000            | 76 014                 | 0,07                |
| TenneT Holding BV, 4,500 %, 28/10/34 EMTN (i)                                               | EUR | 290 000            | 308 308                | 0,28                |
| TenneT Holding BV, 4,750 %, 28/10/42 EMTN (i)                                               | EUR | 175 000            | 194 282                | 0,18                |
| Toyota Motor Finance Netherlands BV, 3,375 %, 13/01/26 EMTN (i)                             | EUR | 250 000            | 246 323                | 0,22                |
| Upjohn Finance BV, 1,908 %, 23/06/32 (i)                                                    | EUR | 390 000            | 299 122                | 0,27                |
| Ureco Finance NV, 3,250 %, 13/06/32 EMTN (i)                                                | EUR | 310 000            | 293 237                | 0,27                |
| Volkswagen International Finance NV, 3,375 % (i) (ii) (iii)                                 | EUR | 100 000            | 96 381                 | 0,09                |
| Volkswagen International Finance NV, 3,500 % (i) (ii) (iii)                                 | EUR | 200 000            | 187 500                | 0,17                |
| Volkswagen International Finance NV, 3,748 % (i) (ii) (iii)                                 | EUR | 200 000            | 173 722                | 0,16                |
| Vonovia Finance BV, 2,125 %, 22/03/30 EMTN (i)                                              | EUR | 300 000            | 243 252                | 0,22                |
| Wintershall Dea Finance 2 BV, 2,499 % (i) (ii) (iii)                                        | EUR | 200 000            | 169 692                | 0,15                |



|                                                                          |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b> |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                              |     |                    |                        |                     |
| <b>Pays-Bas – 15,36 % (31 décembre 2022 : 16,88 %) (suite)</b>           |     |                    |                        |                     |
| Wintershall Dea Finance BV, 1,332 %, 25/09/28 (i)                        | EUR | 300 000            | 251 640                | 0,23                |
| Wolters Kluwer NV, 3,000 %, 23/09/26 (i)                                 | EUR | 200 000            | 195 032                | 0,18                |
| WPC Eurobond BV, 0,950 %, 01/06/30 (i)                                   | EUR | 200 000            | 151 722                | 0,14                |
| WPC Eurobond BV, 2,250 %, 19/07/24 (i)                                   | EUR | 200 000            | 193 553                | 0,17                |
|                                                                          |     |                    | 16 949 107             | 15,36               |
| <b>Nouvelle-Zélande - 1,05 % (31 décembre 2022 : 1,12 %)</b>             |     |                    |                        |                     |
| ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0,200 %, 23/09/27 EMTN (i)                    | EUR | 525 000            | 444 459                | 0,40                |
| ASB Bank Ltd, 4,500 %, 16/03/27 EMTN (i)                                 | EUR | 130 000            | 130 248                | 0,12                |
| ASB Finance Ltd, 0,250 %, 08/09/28 EMTN (i)                              | EUR | 305 000            | 248 046                | 0,23                |
| ASB Finance Ltd, 0,750 %, 13/03/24 EMTN (i)                              | EUR | 340 000            | 331 487                | 0,30                |
|                                                                          |     |                    | 1 154 240              | 1,05                |
| <b>Norvège - 2,37 % (31 décembre 2022 : 2,29 %)</b>                      |     |                    |                        |                     |
| DNB Bank ASA, 0,250 %, 23/02/29 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 440 000            | 364 610                | 0,33                |
| Equinor ASA, 1,250 %, 17/02/27 EMTN (i)                                  | EUR | 340 000            | 310 224                | 0,28                |
| Santander Consumer Bank AS, 0,125 %, 11/09/24 EMTN (i)                   | EUR | 700 000            | 664 574                | 0,60                |
| Santander Consumer Bank AS, 0,125 %, 14/04/26 EMTN (i)                   | EUR | 300 000            | 266 182                | 0,24                |
| Statnett SF, 0,875 %, 08/03/25 EMTN (i)                                  | EUR | 225 000            | 212 991                | 0,19                |
| Telenor ASA, 0,250 %, 14/02/28 EMTN (i)                                  | EUR | 125 000            | 106 428                | 0,10                |
| Telenor ASA, 0,750 %, 31/05/26 EMTN (i)                                  | EUR | 430 000            | 392 951                | 0,36                |
| Variable Energi ASA, 5,500 %, 04/05/29 EMTN (i)                          | EUR | 295 000            | 293 935                | 0,27                |
|                                                                          |     |                    | 2 611 895              | 2,37                |
| <b>Portugal - 0,60 % (31 décembre 2022 : 0,64 %)</b>                     |     |                    |                        |                     |
| EDP - Energias de Portugal SA, 1,700 %, 20/07/80 (i) (ii)                | EUR | 300 000            | 273 675                | 0,25                |
| EDP - Energias de Portugal SA, 2,875 %, 01/06/26 EMTN (i)                | EUR | 400 000            | 387 776                | 0,35                |
|                                                                          |     |                    | 661 451                | 0,60                |
| <b>Espagne - 2,61 % (31 décembre 2022 : 3,66 %)</b>                      |     |                    |                        |                     |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4,375 %, 14/10/29 EMTN (i)           | EUR | 300 000            | 304 549                | 0,28                |
| Banco de Sabadell SA, 2,625 %, 24/03/26 EMTN (i) (ii)                    | EUR | 400 000            | 380 065                | 0,34                |
| Banco Santander SA, 3,875 %, 16/01/28 EMTN (i)                           | EUR | 500 000            | 491 791                | 0,45                |
| Banco Santander SA, 5,750 %, 23/08/33 EMTN (i) (ii)                      | EUR | 200 000            | 198 832                | 0,18                |
| Bankinter SA, 0,875 %, 08/07/26 EMTN (i)                                 | EUR | 200 000            | 178 774                | 0,16                |
| CaixaBank SA, 0,625 %, 21/01/28 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 400 000            | 351 904                | 0,32                |
| CaixaBank SA, 3,750 %, 15/02/29 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 500 000            | 492 439                | 0,45                |
| Cellnex Finance Co SA, 1,250 %, 15/01/29 EMTN (i)                        | EUR | 300 000            | 248 512                | 0,22                |
| Merlin Properties Socimi SA, 1,375 %, 01/06/30 EMTN (i)                  | EUR | 300 000            | 231 433                | 0,21                |
|                                                                          |     |                    | 2 878 299              | 2,61                |
| <b>Suède - 2,82 % (31 décembre 2022 : 2,70 %)</b>                        |     |                    |                        |                     |
| Akelius Residential Property AB, 1,750 %, 07/02/25 EMTN (i)              | EUR | 225 000            | 209 995                | 0,19                |
| EQT AB, 0,875 %, 14/05/31 (i)                                            | EUR | 390 000            | 276 989                | 0,25                |
| Fastighets AB Balder, 1,875 %, 14/03/25 (i)                              | EUR | 200 000            | 176 859                | 0,16                |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1,375 %, 31/10/28 (i) (ii)             | EUR | 500 000            | 493 000                | 0,45                |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1,750 %, 11/11/26 EMTN (i)             | EUR | 300 000            | 278 198                | 0,25                |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4,125 %, 29/06/27 EMTN (i)             | EUR | 310 000            | 309 690                | 0,28                |
| Swedbank AB, 0,300 %, 20/05/27 (i) (ii)                                  | EUR | 600 000            | 528 000                | 0,48                |
| Swedbank AB, 3,625 %, 23/08/32 EMTN (i) (ii)                             | EUR | 200 000            | 183 103                | 0,16                |
| Vattenfall AB, 3,750 %, 18/10/26 EMTN (i)                                | EUR | 495 000            | 492 636                | 0,45                |

|                                                                                      |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>             |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                          |     |                    |                        |                     |
| <b>Suède - 2,82 % (31 décembre 2022 : 2,70 %) (suite)</b>                            |     |                    |                        |                     |
| Volvo Treasury AB, Zero Coupon Bond, 18/05/26 EMTN (i)                               | EUR | 180 000            | 161 167                | 0,15                |
|                                                                                      |     |                    | 3 109 637              | 2,82                |
| <b>Suisse - 2,14 % (31 décembre 2022 : 2,29 %)</b>                                   |     |                    |                        |                     |
| Credit Suisse AG, 0,250 %, 01/09/28 EMTN (i)                                         | EUR | 585 000            | 468 410                | 0,43                |
| Credit Suisse AG, 0,450 %, 19/05/25 EMTN (i)                                         | EUR | 235 000            | 215 739                | 0,20                |
| Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 4,840 %, 03/11/28 EMTN (i)                        | EUR | 300 000            | 300 835                | 0,27                |
| UBS Group AG, 0,250 %, 03/11/26 (i) (ii)                                             | EUR | 560 000            | 498 789                | 0,45                |
| UBS Group AG, 0,650 %, 14/01/28 EMTN (i) (ii)                                        | EUR | 400 000            | 343 361                | 0,31                |
| UBS Group AG, 0,875 %, 03/11/31 (i)                                                  | EUR | 290 000            | 214 293                | 0,19                |
| UBS Group AG, 1,250 %, 17/07/25 EMTN (i) (ii)                                        | EUR | 110 000            | 105 187                | 0,10                |
| UBS Group AG, 3,250 %, 02/04/26 EMTN (i) (ii)                                        | EUR | 220 000            | 211 833                | 0,19                |
|                                                                                      |     |                    | 2 358 447              | 2,14                |
| <b>Royaume-Uni - 8,35 % (31 décembre 2022 : 7,35 %)</b>                              |     |                    |                        |                     |
| AstraZeneca PLC, 0,375 %, 03/06/29 EMTN (i)                                          | EUR | 300 000            | 249 286                | 0,23                |
| AstraZeneca PLC, 3,750 %, 03/03/32 EMTN (i)                                          | EUR | 265 000            | 266 943                | 0,24                |
| BG Energy Capital PLC, 2,250 %, 21/11/29 EMTN (i)                                    | EUR | 670 000            | 606 406                | 0,55                |
| BP Capital Markets PLC, 1,104 %, 15/11/34 (i)                                        | EUR | 190 000            | 137 994                | 0,13                |
| BP Capital Markets PLC, 3,250 % (i) (ii) (iii)                                       | EUR | 255 000            | 234 695                | 0,21                |
| Brambles Finance PLC, 4,250 %, 22/03/31 EMTN (i)                                     | EUR | 215 000            | 215 770                | 0,20                |
| Chanel Ceres PLC, 0,500 %, 31/07/26 (i)                                              | EUR | 470 000            | 417 939                | 0,38                |
| Chanel Ceres PLC, 1,000 %, 31/07/31 (i)                                              | EUR | 280 000            | 222 258                | 0,20                |
| Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1,875 %, 18/03/30 (i)                            | EUR | 250 000            | 221 904                | 0,20                |
| DS Smith PLC, 0,875 %, 12/09/26 EMTN (i)                                             | EUR | 300 000            | 267 936                | 0,24                |
| GlaxoSmithKline Capital PLC, 1,375 %, 12/09/29 (i)                                   | EUR | 200 000            | 175 769                | 0,16                |
| GlaxoSmithKline Capital PLC, Zero Coupon Bond, 23/09/23 EMTN (i)                     | EUR | 775 000            | 768 409                | 0,70                |
| HSBC Holdings PLC, 3,019 %, 15/06/27 (i) (ii)                                        | EUR | 400 000            | 381 394                | 0,35                |
| HSBC Holdings PLC, 3,125 %, 07/06/28 EMTN (i)                                        | EUR | 200 000            | 185 290                | 0,17                |
| HSBC Holdings PLC, 6,364 %, 16/11/32 (i) (ii)                                        | EUR | 200 000            | 203 448                | 0,18                |
| InterContinental Hotels Group PLC, 1,625 %, 08/10/24 EMTN (i)                        | EUR | 140 000            | 135 204                | 0,12                |
| Lloyds Bank Corporate Markets PLC, 4,125 %, 30/05/27 EMTN (i)                        | EUR | 500 000            | 494 172                | 0,45                |
| Lloyds Banking Group PLC, 1,750 %, 07/09/28 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 200 000            | 198 250                | 0,18                |
| National Gas Transmission PLC, 4,250 %, 05/04/30 EMTN (i)                            | EUR | 225 000            | 224 488                | 0,20                |
| National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC, 3,530 %, 20/09/28 EMTN (i) | EUR | 1 030 000          | 1 002 303              | 0,91                |
| Nationwide Building Society 1,500 % 08/03/26 (i) (ii)                                | EUR | 455 000            | 429 777                | 0,39                |
| NatWest Group PLC, 1,750 %, 02/03/26 EMTN (i) (ii)                                   | EUR | 180 000            | 170 807                | 0,15                |
| NatWest Group PLC, 4,771 %, 16/02/29 EMTN (i) (ii)                                   | EUR | 520 000            | 512 898                | 0,46                |
| SSE PLC, 4,000 % (i) (ii) (iii)                                                      | EUR | 230 000            | 211 138                | 0,19                |
| Standard Chartered PLC, 0,900 %, 02/07/27 EMTN (i) (ii)                              | EUR | 615 000            | 547 126                | 0,50                |
| Standard Chartered PLC, 2,500 %, 09/09/30 (i) (ii)                                   | EUR | 325 000            | 301 451                | 0,27                |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC, 0,375 %, 27/07/29 EMTN (i)                    | EUR | 200 000            | 160 260                | 0,15                |
| Vodafone Group PLC, 1,625 %, 24/11/30 EMTN (i)                                       | EUR | 315 000            | 269 608                | 0,24                |
|                                                                                      |     |                    | 9 212 923              | 8,35                |

|  | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--|--------------------|------------------------|---------------------|
|--|--------------------|------------------------|---------------------|

**OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME  
(suite)**

**OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)**

**États-Unis - 16,94 % (31 décembre 2022 : 16,01 %)**

|                                                         |     |         |         |      |
|---------------------------------------------------------|-----|---------|---------|------|
| AbbVie Inc, 0,750 %, 18/11/27                           | EUR | 400 000 | 352 984 | 0,32 |
| American Tower Corp, 0,400 %, 15/02/27                  | EUR | 360 000 | 311 829 | 0,28 |
| American Tower Corp, 0,450 %, 15/01/27                  | EUR | 300 000 | 260 038 | 0,23 |
| Apple Inc, 1,375 %, 24/05/29                            | EUR | 300 000 | 268 983 | 0,24 |
| Archer-Daniels-Midland Co 1,000 %, 12/09/25             | EUR | 315 000 | 295 343 | 0,27 |
| AT&T Inc, 1,600 %, 19/05/28                             | EUR | 525 000 | 469 573 | 0,42 |
| AT&T Inc, 1,950 %, 15/09/23                             | EUR | 290 000 | 288 690 | 0,26 |
| AT&T Inc, 3,550 %, 18/11/25                             | EUR | 165 000 | 163 039 | 0,15 |
| AT&T Inc, 4,300 %, 18/11/34                             | EUR | 235 000 | 235 329 | 0,21 |
| Bank of America Corp, 1,381 %, 09/05/30 EMTN (ii)       | EUR | 200 000 | 168 848 | 0,15 |
| Bank of America Corp, 1,662 %, 25/04/28 EMTN (ii)       | EUR | 255 000 | 228 955 | 0,21 |
| Bank of America Corp, 1,776 %, 04/05/27 EMTN (ii)       | EUR | 950 000 | 877 986 | 0,80 |
| Berkshire Hathaway Finance Corp, 1,500 %, 18/03/30      | EUR | 290 000 | 249 385 | 0,23 |
| Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, 16/03/27               | EUR | 275 000 | 249 066 | 0,23 |
| Booking Holdings Inc, 4,250 %, 15/05/29                 | EUR | 635 000 | 642 818 | 0,58 |
| Cargill Inc, 3,875 %, 24/04/30                          | EUR | 300 000 | 298 871 | 0,27 |
| Chubb INA Holdings Inc, 0,300 %, 15/12/24               | EUR | 260 000 | 245 189 | 0,22 |
| Chubb INA Holdings Inc, 1,400 %, 15/06/31               | EUR | 335 000 | 270 786 | 0,24 |
| Citigroup Inc, 0,500 %, 08/10/27 EMTN (ii)              | EUR | 300 000 | 263 883 | 0,24 |
| Citigroup Inc, 1,500 %, 24/07/26 EMTN (ii)              | EUR | 285 000 | 267 294 | 0,24 |
| Coca-Cola Co, 1,250 %, 08/03/31                         | EUR | 320 000 | 272 063 | 0,25 |
| Corning Inc, 4,125 %, 15/05/31                          | EUR | 375 000 | 371 158 | 0,34 |
| Danaher Corp, 2,100 %, 30/09/26                         | EUR | 300 000 | 284 097 | 0,26 |
| Digital Euro Finco LLC, 1,125 %, 09/04/28               | EUR | 560 000 | 461 367 | 0,42 |
| Dover Corp, 0,750 %, 04/11/27                           | EUR | 190 000 | 165 691 | 0,15 |
| Eli Lilly & Co, 1,125 %, 14/09/51                       | EUR | 160 000 | 91 766  | 0,08 |
| Fiserv Inc, 0,375 %, 01/07/23                           | EUR | 230 000 | 230 000 | 0,21 |
| Fiserv Inc, 4,500 %, 24/05/31                           | EUR | 260 000 | 260 938 | 0,24 |
| General Motors Financial Co Inc, 4,300 %, 15/02/29 EMTN | EUR | 100 000 | 97 306  | 0,09 |
| General Motors Financial Co Inc, 4,500 %, 22/11/27 EMTN | EUR | 140 000 | 138 818 | 0,13 |
| Global Payments Inc, 4,875 %, 17/03/31                  | EUR | 340 000 | 338 400 | 0,31 |
| Goldman Sachs Group Inc, 0,875 %, 21/01/30 EMTN         | EUR | 200 000 | 161 953 | 0,15 |
| Goldman Sachs Group Inc, 3,750 %, 30/04/24 EMTN (ii)    | EUR | 450 000 | 450 076 | 0,41 |
| Illinois Tool Works Inc, 0,625 %, 05/12/27              | EUR | 335 000 | 293 613 | 0,27 |
| International Business Machines Corp, 3,625 %, 06/02/31 | EUR | 400 000 | 395 285 | 0,36 |
| JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, 18/05/28 EMTN (ii)        | EUR | 335 000 | 302 811 | 0,27 |
| JPMorgan Chase & Co, 1,963 %, 23/03/30 EMTN (ii)        | EUR | 350 000 | 308 628 | 0,28 |
| Kraft Heinz Foods Co, 2,250 %, 25/05/28                 | EUR | 325 000 | 300 092 | 0,27 |
| Kraft Heinz Foods Co, 3,812 %, 09/05/25 (ii)            | EUR | 260 000 | 260 481 | 0,24 |
| Merck & Co Inc, 0,500 %, 02/11/24                       | EUR | 210 000 | 200 695 | 0,18 |
| Molson Coors Beverage Co, 1,250 %, 15/07/24             | EUR | 340 000 | 328 889 | 0,30 |
| Mondelez International Inc, 1,625 %, 08/03/27           | EUR | 300 000 | 276 183 | 0,25 |
| Morgan Stanley, 0,406 %, 29/10/27 (ii)                  | EUR | 700 000 | 610 142 | 0,55 |
| Morgan Stanley, 0,495 %, 26/10/29 (ii)                  | EUR | 700 000 | 570 213 | 0,52 |
| Nasdaq Inc, 0,900 %, 30/07/33                           | EUR | 305 000 | 219 634 | 0,20 |
| Netflix Inc, 4,625 %, 15/05/29                          | EUR | 405 000 | 409 426 | 0,37 |
| PPG Industries Inc, 2,750 %, 01/06/29                   | EUR | 105 000 | 97 769  | 0,09 |
| Procter & Gamble Co, 1,250 %, 25/10/29                  | EUR | 220 000 | 193 191 | 0,17 |
| Prologis Euro Finance LLC 1,000 %, 08/02/29 EMTN        | EUR | 690 000 | 573 238 | 0,52 |

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND (suite)

Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                       |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|---------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| Realty Income Corp, 4,875 %, 06/07/30 | EUR | 275 000            | 273 809                | 0,25                |

OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME  
(suite)

OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)

États-Unis – 16,94 % (31 décembre 2022 : 16,01 %) (suite)

|                                                  |     |         |            |       |
|--------------------------------------------------|-----|---------|------------|-------|
| RELX Capital Inc 1,300 %, 12/05/25               | EUR | 220 000 | 208 428    | 0,19  |
| Thermo Fisher Scientific Inc, 0,875 %, 01/10/31  | EUR | 330 000 | 264 153    | 0,24  |
| Toyota Motor Credit Corp, 4,050 %, 13/09/29 EMTN | EUR | 360 000 | 364 379    | 0,33  |
| Unilever Capital Corp, 3,400 %, 06/06/33 EMTN    | EUR | 330 000 | 324 357    | 0,29  |
| United Parcel Service Inc, 1,500 %, 15/11/32     | EUR | 140 000 | 113 987    | 0,10  |
| Verizon Communications Inc, 1,300 %, 18/05/33    | EUR | 620 000 | 477 813    | 0,43  |
| Verizon Communications Inc, 4,250 %, 31/10/30    | EUR | 585 000 | 591 819    | 0,54  |
| Visa Inc, 1,500 %, 15/06/26                      | EUR | 640 000 | 600 282    | 0,54  |
| Wells Fargo & Co, 1,000 %, 02/02/27 EMTN         | EUR | 450 000 | 397 908    | 0,36  |
|                                                  |     |         | 18 689 747 | 16,94 |

**TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES** **106 932 224** **96,92**

**TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES  
OBLIGATIONS À MOYEN TERME** **106 932 224** **96,92**

**TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR  
PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS  
INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS  
(Coût : 109 632 416 EUR)**

**106 932 224** **96,92**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS - 0,01 % (31 décembre 2022 : (0,32 %))

Contrats de change à terme en cours - 0,00 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)

| Échéance                                                           | Montant acheté | Montant vendu | Contrepartie            | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente<br>USD | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------|----------------|---------------|-------------------------|------------------------------------------------|---------------------|
| 31/07/23                                                           | 701 422 USD    | 639 599 EUR   | Brown Brothers Harriman | 2 423                                          | 0,00 %              |
| Plus-value latente sur les contrats de change à terme en cours     |                |               |                         | 2 423                                          | 0,00 %              |
| <b>Gain latent net sur les contrats de change à terme en cours</b> |                |               |                         | <b>2 423</b>                                   | <b>0,00 %</b>       |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Contrats à terme normalisés - 0,01 % (31 décembre 2022 : (0,32 %))

| Nombre de<br>contrats                                                                                                        | Libellé                               | Contrepartie | Engagement | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|--------------|------------|-----------------------------------------|---------------------|
| (48)                                                                                                                         | Euro-Bobl September 2023<br>Futures   | JP Morgan    | 5 624 640  | 70 560                                  | 0,07 %              |
| 42                                                                                                                           | Euro-Bund September 2023<br>Futures   | JP Morgan    | 5 636 820  | (19 740)                                | (0,02 %)            |
| 73                                                                                                                           | Euro-Schatz September 2023<br>Futures | JP Morgan    | 7 697 180  | (43 130)                                | (0,04 %)            |
| Plus-value latente sur les contrats à terme normalisés                                                                       |                                       |              |            | 70 560                                  | 0,07 %              |
| Moins-value latente sur les contrats à terme normalisés                                                                      |                                       |              |            | (62 870)                                | (0,06 %)            |
| <b>Plus-value nette latente sur contrats à terme normalisés</b>                                                              |                                       |              |            | <b>7 690</b>                            | <b>0,01 %</b>       |
|                                                                                                                              |                                       |              |            | Juste valeur<br>en USD                  | % de l'actif<br>net |
| <b>Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat</b>                               |                                       |              |            | <b>107 005 207</b>                      | <b>96,99</b>        |
| <b>Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat</b>                                |                                       |              |            | <b>(62 870)</b>                         | <b>(0,06)</b>       |
| <b>TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS</b> |                                       |              |            | <b>106 942 337</b>                      | <b>96,93</b>        |
| Avoirs nets en banque                                                                                                        |                                       |              |            | 3 330 826                               | 3,02                |
| Autres actifs                                                                                                                |                                       |              |            | 2 865 592                               | 2,60                |
| Moins autres passifs                                                                                                         |                                       |              |            | (2 811 955)                             | (2,55)              |
| <b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D' ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES</b>                                           |                                       |              |            | <b>110 326 800</b>                      | <b>100,00</b>       |

## LES DIX PREMIÈRES PARTICIPATIONS SECTORIELLES AU 30 JUIN 2023 EN POURCENTAGE DE L'ACTIF NET

|                          |         |
|--------------------------|---------|
| Activités bancaires      | 32,38 % |
| Électricité              | 9,03 %  |
| Télécommunications       | 5,40 %  |
| Automobile               | 4,62 %  |
| Assurance                | 3,95 %  |
| Pétrole et gaz           | 3,65 %  |
| Produits pharmaceutiques | 3,40 %  |
| REIT                     | 3,18 %  |
| Immobilier               | 2,73 %  |
| Services commerciaux     | 2,57 %  |

- (i) Titres émis par des émetteurs non américains ou non canadiens.  
(ii) Indique un titre à taux variable. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2023.  
(iii) Obligations perpétuelles.

## Abréviations

EUR : Euro  
USD : Dollar américain

| <b>Analyse de l'actif total</b>                                                                                                        | <b>% de<br/>Total de l'actif</b> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle ou échangés sur un marché réglementé                 | 93,76                            |
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire autres que ceux admis à une cote officielle ou négociés sur un marché réglementé | 0,75                             |
| Instruments financiers dérivés                                                                                                         | 0,01                             |
| Actif circulant                                                                                                                        | 5,48                             |
|                                                                                                                                        | <u>100,00</u>                    |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                                                                        |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME –<br/>97,74 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 97,76 %)</b> |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 97,74 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2022 : 97,76 %)</b>                              |     |                    |                        |                     |
| <b>Australie - 0,09 % (31 décembre 2022 : 0,12 %)</b>                                                                  |     |                    |                        |                     |
| CIMIC Finance Ltd, 1,500 %, 28/05/29 EMTN (i)                                                                          | EUR | 615 000            | 478 486                | 0,09                |
|                                                                                                                        |     |                    | 478 486                | 0,09                |
| <b>Autriche - 1,34 % (31 décembre 2022 : 1,26 %)</b>                                                                   |     |                    |                        |                     |
| BAWAG Group AG, 2,375 %, 26/03/29 EMTN (i) (ii)                                                                        | EUR | 2 200 000          | 2 029 236              | 0,38                |
| BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und<br>Oesterreichische Postsparkasse AG, 4,125 %, 18/01/27 EMTN (i)         | EUR | 1 300 000          | 1 272 848              | 0,24                |
| Erste Group Bank AG, 1,625 %, 08/09/31 EMTN (i) (ii)                                                                   | EUR | 1 500 000          | 1 320 720              | 0,24                |
| Erste Group Bank AG, 4,250 %, 30/05/30 EMTN (i) (ii)                                                                   | EUR | 2 600 000          | 2 581 385              | 0,48                |
|                                                                                                                        |     |                    | 7 204 189              | 1,34                |
| <b>Belgique - 3,33 % (31 décembre 2022 : 2,83 %)</b>                                                                   |     |                    |                        |                     |
| Ageas SA, 3,250 %, 02/07/49 (i) (ii)                                                                                   | EUR | 1 000 000          | 851 606                | 0,16                |
| Argenta Spaarbank NV, 1,000 %, 06/02/24 EMTN (i)                                                                       | EUR | 2 400 000          | 2 352 600              | 0,44                |
| Belfius Bank SA, 3,125 %, 11/05/26 (i)                                                                                 | EUR | 700 000            | 666 585                | 0,12                |
| Belfius Bank SA, 3,875 %, 12/06/28 EMTN (i)                                                                            | EUR | 2 000 000          | 1 981 272              | 0,37                |
| Elia Transmission Belgium SA, 0,875 %, 28/04/30 EMTN (i)                                                               | EUR | 2 700 000          | 2 230 367              | 0,41                |
| Elia Transmission Belgium SA, 1,375 %, 14/01/26 EMTN (i)                                                               | EUR | 600 000            | 562 815                | 0,10                |
| FLUVIUS System Operator CVBA, 0,250 %, 14/06/28 EMTN (i)                                                               | EUR | 2 600 000          | 2 186 600              | 0,41                |
| KBC Group NV, 0,750 %, 21/01/28 EMTN (i) (ii)                                                                          | EUR | 1 900 000          | 1 660 843              | 0,31                |
| KBC Group NV, 1,625 %, 18/09/29 EMTN (i) (ii)                                                                          | EUR | 500 000            | 474 359                | 0,09                |
| KBC Group NV, 4,375 %, 19/04/30 EMTN (i) (ii)                                                                          | EUR | 900 000            | 891 596                | 0,17                |
| KBC Group NV, 4,500 %, 06/06/26 EMTN (i) (ii)                                                                          | EUR | 1 600 000          | 1 590 693              | 0,30                |
| Lonza Finance International NV, 3,875 %, 25/05/33 (i)                                                                  | EUR | 1 230 000          | 1 222 515              | 0,23                |
| Proximus SADP, 4,000 %, 08/03/30 EMTN (i)                                                                              | EUR | 1 200 000          | 1 208 388              | 0,22                |
|                                                                                                                        |     |                    | 17 880 239             | 3,33                |
| <b>Canada - 0,62 % (31 décembre 2022 : 0,65 %)</b>                                                                     |     |                    |                        |                     |
| Great-West Lifeco Inc, 4,700 %, 16/11/29                                                                               | EUR | 1 440 000          | 1 474 631              | 0,28                |
| Magna International Inc, 4,375 %, 17/03/32                                                                             | EUR | 1 825 000          | 1 845 219              | 0,34                |
|                                                                                                                        |     |                    | 3 319 850              | 0,62                |
| <b>Danemark - 0,83 % (31 décembre 2022 : 1,09 %)</b>                                                                   |     |                    |                        |                     |
| Jyske Bank A/S, 0,250 %, 17/02/28 EMTN (i) (ii)                                                                        | EUR | 1 425 000          | 1 212 612              | 0,23                |
| Nykredit Realkredit AS, 0,750 %, 20/01/27 EMTN (i)                                                                     | EUR | 2 465 000          | 2 145 378              | 0,40                |
| Nykredit Realkredit AS, 5,500 %, 29/12/32 (i) (ii)                                                                     | EUR | 1 100 000          | 1 076 123              | 0,20                |
|                                                                                                                        |     |                    | 4 434 113              | 0,83                |
| <b>Finlande - 1,32 % (31 décembre 2022 : 0,09 %)</b>                                                                   |     |                    |                        |                     |
| Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 0,875 %, 17/09/29<br>EMTN (i)                                                  | EUR | 1 300 000          | 883 691                | 0,16                |
| Nokia OYJ, 3,125 %, 15/05/28 EMTN (i)                                                                                  | EUR | 1 485 000          | 1 398 166              | 0,26                |
| Nordea Bank Abp, 4,125 %, 05/05/28 EMTN (i)                                                                            | EUR | 1 705 000          | 1 687 786              | 0,31                |
| Sampo OYJ, 3,375 %, 23/05/49 (i) (ii)                                                                                  | EUR | 400 000            | 355 293                | 0,07                |
| Stora Enso OYJ, 4,250 %, 01/09/29 EMTN (i)                                                                             | EUR | 1 550 000          | 1 549 788              | 0,29                |
| Teollisuuden Voima OYJ, 4,750 %, 01/06/30 EMTN (i)                                                                     | EUR | 1 235 000          | 1 234 234              | 0,23                |
|                                                                                                                        |     |                    | 7 108 958              | 1,32                |
| <b>France - 18,68 % (31 décembre 2022 : 15,14 %)</b>                                                                   |     |                    |                        |                     |
| Accor SA, 2,375 %, 29/11/28 (i)                                                                                        | EUR | 1 100 000          | 986 418                | 0,18                |
| Aéroports de Paris, 2,125 %, 02/10/26 (i)                                                                              | EUR | 2 500 000          | 2 378 270              | 0,44                |
| ALD SA, 4,250 %, 18/01/27 EMTN (i)                                                                                     | EUR | 1 000 000          | 995 756                | 0,19                |
| APRR SA, 1,625 %, 13/01/32 EMTN (i)                                                                                    | EUR | 1 500 000          | 1 271 847              | 0,24                |
| APRR SA, 3,125 %, 24/01/30 EMTN (i)                                                                                    | EUR | 1 000 000          | 971 512                | 0,18                |

|  | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--|--------------------|------------------------|---------------------|
|--|--------------------|------------------------|---------------------|

### OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)

#### OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)

##### France - 18,68 % (31 décembre 2022 : 15,14 %) (suite)

|                                                                          |     |           |           |      |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|-----------|-----------|------|
| Arval Service Lease SA, 0,875 %, 17/02/25 EMTN (i)                       | EUR | 1 600 000 | 1 508 637 | 0,28 |
| Arval Service Lease SA, 4,125 %, 13/04/26 EMTN (i)                       | EUR | 1 300 000 | 1 286 688 | 0,24 |
| Arval Service Lease SA, 4,250 %, 11/11/25 EMTN (i)                       | EUR | 1 200 000 | 1 190 722 | 0,22 |
| AXA SA, 1,875 %, 10/07/42 EMTN (i) (ii)                                  | EUR | 1 550 000 | 1 168 712 | 0,22 |
| AXA SA, 3,941 % EMTN (i) (ii) (iii)                                      | EUR | 900 000   | 876 140   | 0,17 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,250 %, 19/07/28 (i)             | EUR | 2 500 000 | 2 028 960 | 0,38 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,625 %, 03/11/28 EMTN (i)        | EUR | 2 000 000 | 1 637 212 | 0,30 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,750 %, 08/06/26 EMTN (i)        | EUR | 3 400 000 | 3 074 974 | 0,57 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 1,375 %, 16/07/28 EMTN (i)        | EUR | 1 300 000 | 1 139 988 | 0,21 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 1,625 %, 19/01/26 EMTN (i)        | EUR | 100 000   | 93 556    | 0,02 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 1,875 %, 18/06/29 EMTN (i)        | EUR | 1 800 000 | 1 521 986 | 0,28 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 4,125 %, 14/06/33 EMTN (i)        | EUR | 2 100 000 | 2 091 733 | 0,39 |
| Banque Stellantis France SACA, 0,625 %, 21/06/24 (i)                     | EUR | 1 000 000 | 965 476   | 0,18 |
| Banque Stellantis France SACA, 3,875 %, 19/01/26 EMTN (i)                | EUR | 700 000   | 694 187   | 0,13 |
| BNP Paribas SA, 0,250 %, 13/04/27 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 3 400 000 | 3 005 453 | 0,56 |
| BNP Paribas SA, 0,500 %, 19/01/30 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 500 000   | 400 650   | 0,07 |
| BNP Paribas SA, 1,375 %, 28/05/29 EMTN (i)                               | EUR | 1 600 000 | 1 348 186 | 0,25 |
| BNP Paribas SA, 2,500 %, 31/03/32 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 1 300 000 | 1 155 713 | 0,22 |
| BNP Paribas SA, 3,875 %, 23/02/29 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 1 400 000 | 1 378 692 | 0,26 |
| Bouygues SA, 3,875 %, 17/07/31 (i)                                       | EUR | 1 900 000 | 1 880 240 | 0,35 |
| Bouygues SA, 5,375 %, 30/06/42 (i)                                       | EUR | 700 000   | 766 500   | 0,14 |
| Cie de Saint-Gobain, 3,500 %, 18/01/29 EMTN (i)                          | EUR | 1 400 000 | 1 374 859 | 0,26 |
| CNP Assurances, 1,250 %, 27/01/29 (i)                                    | EUR | 300 000   | 247 762   | 0,05 |
| CNP Assurances, 5,250 %, 18/07/53 EMTN (i) (ii)                          | EUR | 600 000   | 573 815   | 0,11 |
| Coentreprise de Transport d'Électricité SA, 0,875 %, 29/09/24 (i)        | EUR | 1 800 000 | 1 725 570 | 0,32 |
| Coentreprise de Transport d'Électricité SA, 2,125 %, 29/07/32 (i)        | EUR | 1 000 000 | 856 810   | 0,16 |
| Crédit Agricole SA, 1,875 %, 22/04/27 (i) (ii)                           | EUR | 2 900 000 | 2 690 620 | 0,50 |
| Crédit Agricole SA, 3,375 %, 28/07/27 EMTN (i)                           | EUR | 800 000   | 779 050   | 0,14 |
| Crédit Agricole SA, 3,875 %, 20/04/31 EMTN (i)                           | EUR | 1 300 000 | 1 284 701 | 0,24 |
| Crédit Agricole SA, 4,250 %, 11/07/29 (i) (ii)                           | EUR | 1 500 000 | 1 490 145 | 0,28 |
| Crédit Mutuel Arkea SA, 4,250 %, 01/12/32 EMTN (i)                       | EUR | 1 000 000 | 1 002 893 | 0,19 |
| Danone SA, 3,470 %, 22/05/31 EMTN (i)                                    | EUR | 2 600 000 | 2 587 684 | 0,48 |
| Électricité de France SA, 4,250 %, 25/01/32 EMTN (i)                     | EUR | 400 000   | 395 184   | 0,07 |
| Électricité de France SA, 4,375 %, 12/10/29 EMTN (i)                     | EUR | 2 700 000 | 2 724 872 | 0,51 |
| Électricité de France SA, 4,625 %, 25/01/43 EMTN (i)                     | EUR | 300 000   | 286 904   | 0,05 |
| ELO SACA, 4,875 %, 08/12/28 EMTN (i)                                     | EUR | 1 000 000 | 958 480   | 0,18 |
| Engie SA, 1,500 % (i) (ii) (iii)                                         | EUR | 2 200 000 | 1 798 377 | 0,33 |
| Engie SA, 3,625 %, 11/01/30 EMTN (i)                                     | EUR | 1 900 000 | 1 878 564 | 0,35 |
| Firmenich Productions Participations SAS, 1,750 %, 30/04/30 (i)          | EUR | 1 155 000 | 1 014 247 | 0,19 |
| Engie SA, 1,625 %, 14/03/30 EMTN (i)                                     | EUR | 2 100 000 | 1 789 586 | 0,33 |
| Groupe des Assurances du Crédit Mutuel SADIR, 1,850 %, 21/04/42 (i) (ii) | EUR | 500 000   | 365 666   | 0,07 |
| Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 2,500 %, 04/05/27 EMTN (i)  | EUR | 2 000 000 | 1 866 080 | 0,35 |



## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|  |  | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--|--|--------------------|------------------------|---------------------|
|--|--|--------------------|------------------------|---------------------|

OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME  
(suite)

## OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)

## France - 18,68 % (31 décembre 2022 : 15,14 %) (suite)

|                                                                         |     |           |             |       |
|-------------------------------------------------------------------------|-----|-----------|-------------|-------|
| La Banque Postale SA, 4,000 %, 03/05/28 EMTN (i)                        | EUR | 2 600 000 | 2 572 175   | 0,48  |
| La Poste SA, 3,750 %, 12/06/30 EMTN (i)                                 | EUR | 1 100 000 | 1 096 245   | 0,20  |
| L'Oréal SA, 2,875 %, 19/05/28 EMTN (i)                                  | EUR | 2 100 000 | 2 043 741   | 0,38  |
| Orange SA, 1,250 %, 07/07/27 EMTN (i)                                   | EUR | 1 500 000 | 1 369 914   | 0,26  |
| Orange SA, 3,625 %, 16/11/31 EMTN (i)                                   | EUR | 1 400 000 | 1 405 082   | 0,26  |
| Orange SA, 5,375 % EMTN (i) (ii) (iii)                                  | EUR | 1 000 000 | 989 964     | 0,18  |
| Orano SA, 5,375 %, 15/05/27 EMTN (i)                                    | EUR | 2 000 000 | 2 046 795   | 0,38  |
| PSA Tresorerie GIE, 6,000 %, 19/09/33 (i)                               | EUR | 485 000   | 531 534     | 0,10  |
| RCI Banque SA, 0,500 %, 14/07/25 EMTN (i)                               | EUR | 1 075 000 | 993 816     | 0,19  |
| RCI Banque SA, 4,500 %, 06/04/27 EMTN (i)                               | EUR | 3 115 000 | 3 059 845   | 0,57  |
| RTE Réseau de Transport d'Électricité SADIR, 1,625 %, 27/11/25 EMTN (i) | EUR | 1 500 000 | 1 422 300   | 0,26  |
| RTE Réseau de Transport d'Électricité SADIR, 3,750 %, 04/07/35 EMTN (i) | EUR | 1 400 000 | 1 393 748   | 0,26  |
| Société Générale SA, 0,500 %, 12/06/29 (i) (ii)                         | EUR | 1 700 000 | 1 378 860   | 0,26  |
| Société Générale SA, 0,625 %, 02/12/27 (i) (ii)                         | EUR | 4 200 000 | 3 637 435   | 0,68  |
| Société Générale SA, 1,500 %, 30/05/25 EMTN (i) (ii)                    | EUR | 1 800 000 | 1 748 848   | 0,33  |
| Société Générale SA, 4,125 %, 02/06/27 (i)                              | EUR | 1 000 000 | 990 272     | 0,18  |
| Société Générale SA, 5,625 %, 02/06/33 EMTN (i)                         | EUR | 1 000 000 | 988 916     | 0,18  |
| Société Nationale SNCF SA, 1,000 %, 25/05/40 (i)                        | EUR | 1 300 000 | 855 824     | 0,16  |
| Solvay Finance SACA, 5,425 % (i) (ii) (iii)                             | EUR | 920 000   | 917 700     | 0,17  |
| Suez SACA, 4,625 %, 03/11/28 EMTN (i)                                   | EUR | 2 700 000 | 2 757 785   | 0,51  |
| Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0,750 %, 25/10/28 EMTN (i)                | EUR | 2 100 000 | 1 694 272   | 0,32  |
| Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0,875 %, 29/03/32 EMTN (i)                | EUR | 900 000   | 627 098     | 0,12  |
| Verallia SA, 1,875 %, 10/11/31 (i)                                      | EUR | 1 800 000 | 1 446 541   | 0,27  |
| WPP Finance SA, 4,125 %, 30/05/28 EMTN (i)                              | EUR | 785 000   | 784 426     | 0,15  |
|                                                                         |     |           | 100 263 213 | 18,68 |

## Allemagne - 9,59 % (31 décembre 2022 : 8,49 %)

|                                                                 |     |           |           |      |
|-----------------------------------------------------------------|-----|-----------|-----------|------|
| Allianz SE, 4,597 %, 07/09/38 EMTN (i) (ii)                     | EUR | 1 900 000 | 1 846 671 | 0,34 |
| Allianz SE, 5,824 %, 25/07/53 (i) (ii)                          | EUR | 800 000   | 822 806   | 0,15 |
| Amprion GmbH, 0,625 %, 23/09/33 EMTN (i)                        | EUR | 1 100 000 | 797 834   | 0,15 |
| Amprion GmbH, 3,971 %, 22/09/32 (i)                             | EUR | 400 000   | 401 545   | 0,08 |
| Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,500 %, 29/05/29 (i)                 | EUR | 1 100 000 | 1 070 179 | 0,20 |
| Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,500 %, 23/04/75 EMTN (i) (ii)       | EUR | 1 600 000 | 1 458 000 | 0,27 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, 15/02/25 (i) | EUR | 3 000 000 | 2 872 062 | 0,54 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, 15/02/28 (i) | EUR | 1 500 000 | 1 366 368 | 0,25 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,000 %, 15/08/24 (i) | EUR | 1 000 000 | 974 274   | 0,18 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,500 %, 04/07/44 (i) | EUR | 1 315 000 | 1 325 235 | 0,25 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,000 %, 04/01/37 (i) | EUR | 6 290 000 | 7 376 534 | 1,37 |
| Commerzbank AG, 0,750 %, 24/03/26 EMTN (i) (ii)                 | EUR | 1 200 000 | 1 112 669 | 0,21 |
| Deutsche Bahn Finance GmbH, 1,125 %, 29/05/51 EMTN (i)          | EUR | 500 000   | 293 345   | 0,05 |
| Deutsche Bahn Finance GmbH, 1,375 %, 03/03/34 EMTN (i)          | EUR | 3 640 000 | 2 949 288 | 0,55 |
| Deutsche Bahn Finance GmbH, 1,600 % (i) (ii) (iii)              | EUR | 1 200 000 | 952 900   | 0,18 |
| Deutsche Bank AG, 1,375 %, 03/09/26 EMTN (i) (ii)               | EUR | 2 800 000 | 2 570 137 | 0,48 |
| Deutsche Bank AG, 3,250 %, 24/05/28 (i) (ii)                    | EUR | 1 100 000 | 1 013 881 | 0,19 |
| Deutsche Bank AG, 5,625 %, 19/05/31 EMTN (i) (ii)               | EUR | 400 000   | 380 946   | 0,07 |
| Deutsche Post AG, 3,375 %, 03/07/33 EMTN (i)                    | EUR | 1 615 000 | 1 592 706 | 0,30 |
| E.ON SE, 1,625 %, 22/05/29 EMTN (i)                             | EUR | 2 990 000 | 2 654 594 | 0,49 |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                                       |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME</b>                          |     |                    |                        |                     |
| <b>(suite)</b>                                                                        |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                           |     |                    |                        |                     |
| <b>Allemagne - 9,59 % (31 décembre 2022 : 8,49 %) (suite)</b>                         |     |                    |                        |                     |
| Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide, 1,875 %, 31/03/28 (i)                | EUR | 1 455 000          | 1 286 647              | 0,24                |
| Hannover Rueck SE, 1,750 %, 08/10/40 (i) (ii)                                         | EUR | 500 000            | 395 855                | 0,07                |
| Hannover Rueck SE, 3,375 % (i) (ii) (iii)                                             | EUR | 300 000            | 286 875                | 0,05                |
| HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, 0,625 %, 01/11/28 EMTN (i)                        | EUR | 1 600 000          | 1 306 736              | 0,24                |
| HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, Zero Coupon Bond, 01/11/24 EMTN (i)               | EUR | 1 900 000          | 1 785 430              | 0,33                |
| Knorr-Bremse AG, 3,250 %, 21/09/27 EMTN (i)                                           | EUR | 1 400 000          | 1 373 646              | 0,26                |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,125 %, 09/01/32 EMTN (i)                           | EUR | 1 100 000          | 868 892                | 0,16                |
| LEG Immobilien SE, 1,250 %, 23/01/24 EMTN (i)                                         | EUR | 2 000 000          | 1 959 200              | 0,37                |
| Merck Financial Services GmbH, 0,500 %, 16/07/28 EMTN (i)                             | EUR | 1 700 000          | 1 461 459              | 0,27                |
| Merck KGaA, 1,625 %, 09/09/80 (i) (ii)                                                | EUR | 2 400 000          | 2 138 597              | 0,40                |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, 26/05/49 (i) (ii) | EUR | 500 000            | 453 589                | 0,08                |
| Vier Gas Transport GmbH, 1,500 %, 25/09/28 EMTN (i)                                   | EUR | 1 500 000          | 1 324 417              | 0,25                |
| Vier Gas Transport GmbH, 4,625 %, 26/09/32 EMTN (i)                                   | EUR | 700 000            | 723 243                | 0,14                |
| Vonovia SE, 0,250 %, 01/09/28 EMTN (i)                                                | EUR | 800 000            | 621 157                | 0,12                |
| Vonovia SE, 0,375 %, 16/06/27 EMTN (i)                                                | EUR | 1 300 000          | 1 078 672              | 0,20                |
| Vonovia SE, 1,000 %, 16/06/33 (i)                                                     | EUR | 900 000            | 610 180                | 0,11                |
|                                                                                       |     |                    | 51 506 569             | 9,59                |
| <b>Irlande - 2,85 % (31 décembre 2022 : 2,48 %)</b>                                   |     |                    |                        |                     |
| Abbott Ireland Financing DAC, 1,500 %, 27/09/26 (i)                                   | EUR | 1 200 000          | 1 121 510              | 0,21                |
| AIB Group PLC, 1,875 %, 19/11/29 EMTN (i) (ii)                                        | EUR | 2 035 000          | 1 912 289              | 0,36                |
| AIB Group PLC, 2,250 %, 04/04/28 EMTN (i) (ii)                                        | EUR | 600 000            | 543 973                | 0,10                |
| AIB Group PLC, 5,750 %, 16/02/29 (i) (ii)                                             | EUR | 1 660 000          | 1 708 721              | 0,32                |
| CCEP Finance Ireland DAC, 0,875 %, 06/05/33 (i)                                       | EUR | 3 420 000          | 2 606 204              | 0,49                |
| CCEP Finance Ireland DAC, Zero Coupon Bond, 06/09/25 (i)                              | EUR | 2 200 000          | 2 018 267              | 0,38                |
| Lunar Funding V for Swisscom AG, 1,125 %, 12/10/26 (i)                                | EUR | 3 190 000          | 2 918 831              | 0,54                |
| PartnerRe Ireland Finance DAC, 1,250 %, 15/09/26 (i)                                  | EUR | 1 200 000          | 1 090 082              | 0,20                |
| Permanent TSB Group Holdings PLC, 6,625 %, 25/04/28 (i) (ii)                          | EUR | 1 370 000          | 1 369 718              | 0,25                |
|                                                                                       |     |                    | 15 289 595             | 2,85                |
| <b>Italie - 1,75 % (31 décembre 2022 : 3,13 %)</b>                                    |     |                    |                        |                     |
| ASTM SpA, 1,500 %, 25/01/30 EMTN (i)                                                  | EUR | 900 000            | 729 839                | 0,14                |
| CA Auto Bank SPA, 0,500 %, 18/09/23 EMTN (i)                                          | EUR | 1 285 000          | 1 275 915              | 0,24                |
| Intesa Sanpaolo SpA, 4,000 %, 19/05/26 EMTN (i)                                       | EUR | 1 080 000          | 1 068 355              | 0,20                |
| Intesa Sanpaolo SpA, 4,875 %, 19/05/30 EMTN (i)                                       | EUR | 950 000            | 948 205                | 0,18                |
| Mediobanca Banca di Credito Finanziario spa, 1,000 %, 17/07/29 EMTN (i) (ii)          | EUR | 2 410 000          | 2 004 691              | 0,37                |
| Snam SpA, 0,750 %, 17/06/30 EMTN (i)                                                  | EUR | 1 905 000          | 1 527 730              | 0,28                |
| Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0,375 %, 25/09/30 EMTN (i)                          | EUR | 1 000 000          | 780 844                | 0,14                |
| UniCredit SpA, 5,850 %, 15/11/27 EMTN (i) (ii)                                        | EUR | 1 050 000          | 1 074 278              | 0,20                |
|                                                                                       |     |                    | 9 409 857              | 1,75                |
| <b>Japon - 0,40 % (31 décembre 2022 : 0,00 %)</b>                                     |     |                    |                        |                     |
| Takeda Pharmaceutical Co Ltd., 3,000 %, 21/11/30 (i)                                  | EUR | 2 300 000          | 2 159 203              | 0,40                |
|                                                                                       |     |                    | 2 159 203              | 0,40                |
| <b>Liechtenstein - 0,35 % (31 décembre 2022 : 0,57 %)</b>                             |     |                    |                        |                     |
| Swiss Life Finance I Ltd, 0,500 %, 15/09/31 (i)                                       | EUR | 2 150 000          | 1 573 177              | 0,30                |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                                             |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME</b>                                |     |                    |                        |                     |
| <b>(suite)</b>                                                                              |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                                 |     |                    |                        |                     |
| <b>Liechtenstein - 0,35 % (31 décembre 2022 : 0,57 %) (suite)</b>                           |     |                    |                        |                     |
| Swiss Life Finance I Ltd, 3,250 %, 31/08/29 (i)                                             | EUR | 300 000            | 284 185                | 0,05                |
|                                                                                             |     |                    | 1 857 362              | 0,35                |
| <b>Luxembourg - 4,33 % (31 décembre 2022 : 6,08 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| Aroundtown SA, 1,450 %, 09/07/28 EMTN (i)                                                   | EUR | 900 000            | 608 326                | 0,11                |
| Aroundtown SA, 1,625 %, 31/01/28 EMTN (i)                                                   | EUR | 500 000            | 351 597                | 0,07                |
| Aroundtown SA, 2,875 % EMTN (i) (ii) (iii)                                                  | EUR | 300 000            | 102 000                | 0,02                |
| Aroundtown SA, 3,375 % (i) (ii) (iii)                                                       | EUR | 400 000            | 165 176                | 0,03                |
| Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 0,334 %, 13/08/28 (i)                                   | EUR | 1 500 000          | 1 259 034              | 0,23                |
| CPI Property Group SA, 1,625 %, 23/04/27 EMTN (i)                                           | EUR | 570 000            | 413 424                | 0,08                |
| DH Europe Finance II Sarl, 0,450 %, 18/03/28 (i)                                            | EUR | 2 620 000          | 2 256 816              | 0,42                |
| DH Europe Finance II Sarl, 1,350 %, 18/09/39 (i)                                            | EUR | 1 300 000          | 905 388                | 0,17                |
| Euroclear Investments SA, 1,125 %, 07/12/26 (i)                                             | EUR | 1 100 000          | 996 487                | 0,19                |
| Eurofins Scientific SE, 0,875 %, 19/05/31 (i)                                               | EUR | 1 185 000          | 901 346                | 0,17                |
| John Deere Bank SA, 2,500 %, 14/09/26 EMTN (i)                                              | EUR | 820 000            | 788 179                | 0,15                |
| Medtronic Global Holdings SCA, 1,125 %, 07/03/27 (i)                                        | EUR | 3 215 000          | 2 926 158              | 0,55                |
| Medtronic Global Holdings SCA, 1,500 %, 02/07/39 (i)                                        | EUR | 2 300 000          | 1 613 478              | 0,30                |
| Medtronic Global Holdings SCA, 2,250 %, 07/03/39 (i)                                        | EUR | 1 800 000          | 1 427 339              | 0,27                |
| Medtronic Global Holdings SCA, 3,125 %, 15/10/31 (i)                                        | EUR | 1 655 000          | 1 584 146              | 0,29                |
| Novartis Finance SA, Zero Coupon Bond, 23/09/28 (i)                                         | EUR | 1 600 000          | 1 345 760              | 0,25                |
| Prologis International Funding II SA, 2,375 %, 14/11/30 (i)                                 | EUR | 1 125 000          | 939 260                | 0,17                |
| SELP Finance Sarl, 3,750 %, 10/08/27 EMTN (i)                                               | EUR | 2 310 000          | 2 160 141              | 0,40                |
| SES SA, 5,625 % (i) (ii) (iii)                                                              | EUR | 2 510 000          | 2 482 390              | 0,46                |
|                                                                                             |     |                    | 23 226 445             | 4,33                |
| <b>Pays-Bas – 16,12 % (31 décembre 2022 : 18,90 %)</b>                                      |     |                    |                        |                     |
| ABN AMRO Bank NV, 4,375 %, 20/10/28 (i)                                                     | EUR | 2 500 000          | 2 485 463              | 0,46                |
| ABN AMRO Bank NV, 4,500 %, 21/11/34 (i)                                                     | EUR | 1 700 000          | 1 720 723              | 0,32                |
| ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, 22/02/33 EMTN (i) (ii)                                           | EUR | 900 000            | 880 175                | 0,16                |
| AGCO International Holdings BV, 0,800 %, 06/10/28 (i)                                       | EUR | 1 200 000          | 995 809                | 0,19                |
| Alcon Finance BV, 2,375 %, 31/05/28 (i)                                                     | EUR | 1 350 000          | 1 251 204              | 0,23                |
| Alliander NV, 2,625 %, 09/09/27 EMTN (i)                                                    | EUR | 1 350 000          | 1 301 278              | 0,24                |
| Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 1,125 %, 17/09/25 (i)                              | EUR | 3 500 000          | 3 281 845              | 0,61                |
| Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co Ltd., 2,750 %, 19/02/49 (i) (ii)            | EUR | 965 000            | 843 937                | 0,16                |
| ASR Nederland NV, 3,375 %, 02/05/49 (i) (ii)                                                | EUR | 500 000            | 433 370                | 0,08                |
| ASR Nederland NV, 5,000 % (i) (ii) (iii)                                                    | EUR | 450 000            | 441 783                | 0,08                |
| ASR Nederland NV, 7,000 %, 07/12/43 (i) (ii)                                                | EUR | 375 000            | 389 787                | 0,07                |
| Citycon Treasury BV, 2,375 %, 15/01/27 EMTN (i)                                             | EUR | 1 590 000          | 1 269 338              | 0,24                |
| Compass Group Finance Netherlands BV, 3,000 %, 08/03/30 EMTN (i)                            | EUR | 2 965 000          | 2 824 957              | 0,53                |
| Cooperatieve Rabobank UA, 4,233 %, 25/04/29 EMTN (i) (ii)                                   | EUR | 2 400 000          | 2 370 758              | 0,44                |
| Daimler Truck International Finance BV, 3,875 %, 19/06/26 EMTN (i)                          | EUR | 500 000            | 497 685                | 0,09                |
| Daimler Truck International Finance BV, 3,875 %, 19/06/29 EMTN (i)                          | EUR | 1 000 000          | 989 386                | 0,18                |
| easyJet FinCo BV, 1,875 %, 03/03/28 EMTN (i)                                                | EUR | 1 600 000          | 1 394 941              | 0,26                |
| ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 % (i) (ii) (iii)                               | EUR | 1 950 000          | 1 860 300              | 0,35                |
| ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG, 3,375 %, 29/09/47 (i) (ii) | EUR | 1 165 000          | 1 048 407              | 0,20                |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                          |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME</b>             |     |                    |                        |                     |
| <b>(suite)</b>                                                           |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                              |     |                    |                        |                     |
| <b>Pays-Bas – 16,12 % (31 décembre 2022 : 18,90 %) (suite)</b>           |     |                    |                        |                     |
| Enexis Holding NV, 0,750 %, 02/07/31 EMTN (i)                            | EUR | 2 860 000          | 2 307 208              | 0,43                |
| Essity Capital BV, 3,000 %, 21/09/26 EMTN (i)                            | EUR | 1 920 000          | 1 865 522              | 0,35                |
| Euronext NV, 1,000 %, 18/04/25 (i)                                       | EUR | 2 670 000          | 2 518 558              | 0,47                |
| GSK Capital BV, 3,000 %, 28/11/27 EMTN (i)                               | EUR | 1 200 000          | 1 170 749              | 0,22                |
| Iberdrola International BV, 1,450 % (i) (ii) (iii)                       | EUR | 1 600 000          | 1 378 707              | 0,26                |
| Iberdrola International BV, 1,874 % (i) (ii) (iii)                       | EUR | 2 000 000          | 1 796 632              | 0,33                |
| ING Groep NV, 0,250 %, 18/02/29 (i) (ii)                                 | EUR | 1 200 000          | 982 145                | 0,18                |
| ING Groep NV, 1,250 %, 16/02/27 (i) (ii)                                 | EUR | 1 400 000          | 1 281 915              | 0,24                |
| ING Groep NV, 1,625 %, 26/09/29 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 400 000            | 377 838                | 0,07                |
| ING Groep NV, 2,125 %, 23/05/26 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 2 000 000          | 1 906 392              | 0,36                |
| ING Groep NV, 2,500 %, 15/02/29 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 1 500 000          | 1 467 165              | 0,27                |
| ING Groep NV, 4,125 %, 24/08/33 (i) (ii)                                 | EUR | 300 000            | 282 491                | 0,05                |
| ING Groep NV, 4,500 %, 23/05/29 (i) (ii)                                 | EUR | 2 300 000          | 2 274 217              | 0,42                |
| JAB Holdings BV, 5,000 %, 12/06/33 (i)                                   | EUR | 1 000 000          | 1 014 566              | 0,19                |
| JDE Peet's NV, 0,500 %, 16/01/29 EMTN (i)                                | EUR | 1 950 000          | 1 602 666              | 0,30                |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0,375 %, 18/03/30 (i)                     | EUR | 3 175 000          | 2 571 604              | 0,48                |
| LeasePlan Corp NV, 0,125 %, 13/09/23 EMTN (i)                            | EUR | 2 320 000          | 2 301 969              | 0,43                |
| Lseg Netherlands BV, Zero Coupon Bond, 06/04/25 EMTN (i)                 | EUR | 1 135 000          | 1 056 978              | 0,20                |
| Nederlandse Gasunie NV, 0,375 %, 03/10/31 EMTN (i)                       | EUR | 320 000            | 244 588                | 0,05                |
| Nederlandse Gasunie NV, 3,375 %, 11/07/34 EMTN (i)                       | EUR | 1 820 000          | 1 758 801              | 0,33                |
| NN Group NV, 4,375 % EMTN (i) (ii) (iii)                                 | EUR | 132 000            | 129 836                | 0,02                |
| NN Group NV, 5,250 %, 01/03/43 EMTN (i) (ii)                             | EUR | 620 000            | 590 510                | 0,11                |
| PACCAR Financial Europe BV, 3,250 %, 29/11/25 EMTN (i)                   | EUR | 1 330 000          | 1 306 680              | 0,24                |
| PACCAR Financial Europe BV, 3,375 %, 15/05/26 EMTN (i)                   | EUR | 1 685 000          | 1 661 950              | 0,31                |
| Prosus NV, 2,085 %, 19/01/30 (i)                                         | EUR | 1 180 000          | 920 400                | 0,17                |
| Rentokil Initial Finance BV, 4,375 %, 27/06/30 EMTN (i)                  | EUR | 1 130 000          | 1 143 791              | 0,21                |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2,750 %, 09/09/30 EMTN (i)         | EUR | 3 100 000          | 2 968 374              | 0,55                |
| Sika Capital BV, 3,750 %, 03/11/26 (i)                                   | EUR | 2 475 000          | 2 459 968              | 0,46                |
| Sika Capital BV, 3,750 %, 03/05/30 (i)                                   | EUR | 945 000            | 942 133                | 0,18                |
| Stedin Holding NV, 0,875 %, 24/10/25 EMTN (i)                            | EUR | 2 785 000          | 2 593 308              | 0,48                |
| Stedin Holding NV, 2,375 %, 03/06/30 EMTN (i)                            | EUR | 1 425 000          | 1 308 911              | 0,24                |
| Stellantis NV, 0,750 %, 18/01/29 EMTN (i)                                | EUR | 950 000            | 793 164                | 0,15                |
| Telefonica Europe BV, 3,875 % (i) (ii) (iii)                             | EUR | 1 900 000          | 1 754 080              | 0,33                |
| TenneT Holding BV, 1,375 %, 26/06/29 EMTN (i)                            | EUR | 1 460 000          | 1 294 129              | 0,24                |
| TenneT Holding BV, 1,500 %, 03/06/39 EMTN (i)                            | EUR | 375 000            | 285 051                | 0,05                |
| TenneT Holding BV, 4,500 %, 28/10/34 EMTN (i)                            | EUR | 1 100 000          | 1 169 445              | 0,22                |
| TenneT Holding BV, 4,750 %, 28/10/42 EMTN (i)                            | EUR | 900 000            | 999 162                | 0,19                |
| Toyota Motor Finance Netherlands BV, Zero Coupon Bond, 27/10/25 EMTN (i) | EUR | 935 000            | 853 748                | 0,16                |
| Urenco Finance NV, 3,250 %, 13/06/32 EMTN (i)                            | EUR | 1 205 000          | 1 139 838              | 0,21                |
| Vonovia Finance BV, 2,125 %, 22/03/30 EMTN (i)                           | EUR | 1 500 000          | 1 216 260              | 0,23                |
| Vonovia Finance BV, 2,250 %, 07/04/30 (i)                                | EUR | 400 000            | 329 059                | 0,06                |
| Wabtec Transportation Netherlands BV, 1,250 %, 03/12/27 (i)              | EUR | 1 300 000          | 1 127 825              | 0,21                |
| Wolters Kluwer NV, 3,000 %, 23/09/26 (i)                                 | EUR | 1 110 000          | 1 082 428              | 0,20                |
| WPC Eurobond BV, 0,950 %, 01/06/30 (i)                                   | EUR | 1 610 000          | 1 221 362              | 0,23                |
| WPC Eurobond BV, 2,250 %, 19/07/24 (i)                                   | EUR | 835 000            | 808 085                | 0,15                |
|                                                                          |     |                    | <b>86 541 354</b>      | <b>16,12</b>        |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                          |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b> |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                              |     |                    |                        |                     |
| <b>Nouvelle-Zélande - 1,03 % (31 décembre 2022 : 1,06 %)</b>             |     |                    |                        |                     |
| ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0,200 %, 23/09/27 EMTN (i)                    | EUR | 2 700 000          | 2 285 788              | 0,43                |
| ASB Bank Ltd, 4,500 %, 16/03/27 EMTN (i)                                 | EUR | 880 000            | 881 681                | 0,16                |
| ASB Finance Ltd, 0,250 %, 08/09/28 EMTN (i)                              | EUR | 1 420 000          | 1 154 838              | 0,22                |
| ASB Finance Ltd, 0,750 %, 13/03/24 EMTN (i)                              | EUR | 1 230 000          | 1 199 201              | 0,22                |
|                                                                          |     |                    | <u>5 521 508</u>       | <u>1,03</u>         |
| <b>Norvège - 2,41 % (31 décembre 2022 : 3,20 %)</b>                      |     |                    |                        |                     |
| DNB Bank ASA, 0,250 %, 23/02/29 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 2 090 000          | 1 731 899              | 0,32                |
| Santander Consumer Bank AS, 0,125 %, 11/09/24 EMTN (i)                   | EUR | 3 400 000          | 3 227 933              | 0,60                |
| Santander Consumer Bank AS, 0,125 %, 14/04/26 EMTN (i)                   | EUR | 1 600 000          | 1 419 635              | 0,27                |
| Statkraft AS, 1,500 %, 26/03/30 EMTN (i)                                 | EUR | 1 035 000          | 904 857                | 0,17                |
| Statnett SF, 0,875 %, 08/03/25 EMTN (i)                                  | EUR | 1 225 000          | 1 159 615              | 0,22                |
| Statnett SF, 1,250 %, 26/04/30 EMTN (i)                                  | EUR | 2 225 000          | 1 901 640              | 0,35                |
| Telenor ASA, 0,250 %, 14/02/28 EMTN (i)                                  | EUR | 595 000            | 506 595                | 0,09                |
| Telenor ASA, 0,750 %, 31/05/26 EMTN (i)                                  | EUR | 2 275 000          | 2 078 986              | 0,39                |
|                                                                          |     |                    | <u>12 931 160</u>      | <u>2,41</u>         |
| <b>Espagne - 2,68 % (31 décembre 2022 : 3,33 %)</b>                      |     |                    |                        |                     |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4,375 %, 14/10/29 EMTN (i)           | EUR | 1 600 000          | 1 624 262              | 0,30                |
| Banco de Sabadell SA, 2,625 %, 24/03/26 EMTN (i) (ii)                    | EUR | 1 700 000          | 1 615 275              | 0,30                |
| Banco Santander SA, 3,875 %, 16/01/28 EMTN (i)                           | EUR | 2 400 000          | 2 360 599              | 0,44                |
| Banco Santander SA, 5,750 %, 23/08/33 EMTN (i) (ii)                      | EUR | 1 100 000          | 1 093 579              | 0,20                |
| Bankinter SA, 0,875 %, 08/07/26 EMTN (i)                                 | EUR | 700 000            | 625 709                | 0,12                |
| CaixaBank SA, 0,625 %, 21/01/28 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 2 600 000          | 2 287 376              | 0,43                |
| CaixaBank SA, 3,750 %, 15/02/29 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 2 400 000          | 2 363 707              | 0,44                |
| Cellnex Finance Co S.A., 1,250 %, 15/01/29 EMTN (i)                      | EUR | 1 200 000          | 994 047                | 0,18                |
| Mapfre SA, 2,875 %, 13/04/30 (i)                                         | EUR | 500 000            | 430 184                | 0,08                |
| Merlin Properties Socimi SA, 1,375 %, 01/06/30 EMTN (i)                  | EUR | 1 300 000          | 1 002 875              | 0,19                |
|                                                                          |     |                    | <u>14 397 613</u>      | <u>2,68</u>         |
| <b>Suède - 2,83 % (31 décembre 2022 : 3,16 %)</b>                        |     |                    |                        |                     |
| EQT AB, 0,875 %, 14/05/31 (i)                                            | EUR | 2 065 000          | 1 466 625              | 0,27                |
| Fastighets AB Balder, 1,875 %, 14/03/25 (i)                              | EUR | 900 000            | 795 866                | 0,15                |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1,375 %, 31/10/28 (i) (ii)             | EUR | 2 250 000          | 2 218 500              | 0,41                |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1,750 %, 11/11/26 EMTN (i)             | EUR | 1 300 000          | 1 205 525              | 0,23                |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4,125 %, 29/06/27 EMTN (i)             | EUR | 1 470 000          | 1 468 529              | 0,27                |
| Swedbank AB, 0,300 %, 20/05/27 (i) (ii)                                  | EUR | 3 370 000          | 2 965 600              | 0,55                |
| Swedbank AB, 3,625 %, 23/08/32 EMTN (i) (ii)                             | EUR | 600 000            | 549 309                | 0,10                |
| Vattenfall AB, 3,750 %, 18/10/26 EMTN (i)                                | EUR | 2 200 000          | 2 189 493              | 0,41                |
| Volvo Treasury AB, 3,625 %, 25/05/27 EMTN (i)                            | EUR | 1 850 000          | 1 837 147              | 0,34                |
| Volvo Treasury AB, Zero Coupon Bond, 18/05/26 EMTN (i)                   | EUR | 570 000            | 510 362                | 0,10                |
|                                                                          |     |                    | <u>15 206 956</u>      | <u>2,83</u>         |
| <b>Suisse - 2,23 % (31 décembre 2022 : 2,24 %)</b>                       |     |                    |                        |                     |
| Credit Suisse AG, 0,250 %, 01/09/28 EMTN (i)                             | EUR | 2 825 000          | 2 261 978              | 0,42                |
| Credit Suisse AG, 0,450 %, 19/05/25 EMTN (i)                             | EUR | 1 080 000          | 991 481                | 0,19                |
| Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 4,840 %, 03/11/28 EMTN (i)            | EUR | 1 400 000          | 1 403 895              | 0,26                |
| UBS Group AG, 0,250 %, 03/11/26 (i) (ii)                                 | EUR | 3 335 000          | 2 970 464              | 0,55                |
| UBS Group AG, 0,650 %, 14/01/28 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 1 880 000          | 1 613 795              | 0,30                |
| UBS Group AG, 0,875 %, 03/11/31 (i)                                      | EUR | 1 620 000          | 1 197 083              | 0,22                |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|  |  | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--|--|--------------------|------------------------|---------------------|
|--|--|--------------------|------------------------|---------------------|

OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME  
(suite)

## OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)

## Suisse - 2,23 % (31 décembre 2022 : 2,24 %) (suite)

|                                               |     |           |            |      |
|-----------------------------------------------|-----|-----------|------------|------|
| UBS Group AG, 1,250 %, 17/07/25 EMTN (i) (ii) | EUR | 470 000   | 449 437    | 0,09 |
| UBS Group AG, 3,250 %, 02/04/26 EMTN (i) (ii) | EUR | 1 120 000 | 1 078 426  | 0,20 |
|                                               |     |           | 11 966 559 | 2,23 |

## Royaume-Uni – 8,16 % (31 décembre 2022 : 7,10 %) (suite)

|                                                                                      |     |           |            |      |
|--------------------------------------------------------------------------------------|-----|-----------|------------|------|
| AstraZeneca PLC, 0,375 %, 03/06/29 EMTN (i)                                          | EUR | 1 930 000 | 1 603 737  | 0,30 |
| AstraZeneca PLC, 3,750 %, 03/03/32 EMTN (i)                                          | EUR | 1 300 000 | 1 309 534  | 0,24 |
| Brambles Finance PLC, 4,250 %, 22/03/31 EMTN (i)                                     | EUR | 1 060 000 | 1 063 794  | 0,20 |
| Chanel Ceres PLC, 0,500 %, 31/07/26 (i)                                              | EUR | 2 005 000 | 1 782 910  | 0,33 |
| Chanel Ceres PLC, 1,000 %, 31/07/31 (i)                                              | EUR | 2 220 000 | 1 762 187  | 0,33 |
| DS Smith PLC, 0,875 %, 12/09/26 EMTN (i)                                             | EUR | 1 465 000 | 1 308 422  | 0,24 |
| GlaxoSmithKline Capital PLC, 1,375 %, 12/09/29 (i)                                   | EUR | 900 000   | 790 960    | 0,15 |
| GlaxoSmithKline Capital PLC, Zero Coupon Bond, 23/09/23 EMTN (i)                     | EUR | 2 230 000 | 2 211 036  | 0,41 |
| HSBC Holdings PLC, 3,019 %, 15/06/27 (i) (ii)                                        | EUR | 2 540 000 | 2 421 851  | 0,45 |
| HSBC Holdings PLC, 3,125 %, 07/06/28 EMTN (i)                                        | EUR | 850 000   | 787 482    | 0,15 |
| HSBC Holdings PLC, 6,364 %, 16/11/32 (i) (ii)                                        | EUR | 1 360 000 | 1 383 445  | 0,26 |
| InterContinental Hotels Group PLC, 1,625 %, 08/10/24 EMTN (i)                        | EUR | 1 100 000 | 1 062 316  | 0,20 |
| Lloyds Bank Corporate Markets PLC, 4,125 %, 30/05/27 EMTN (i)                        | EUR | 2 500 000 | 2 470 861  | 0,46 |
| Lloyds Banking Group PLC, 1,750 %, 07/09/28 EMTN (i) (ii)                            | EUR | 900 000   | 892 125    | 0,17 |
| London Stock Exchange Group PLC, 1,750 %, 19/09/29 EMTN (i)                          | EUR | 1 825 000 | 1 615 797  | 0,30 |
| National Gas Transmission PLC, 4,250 %, 05/04/30 EMTN (i)                            | EUR | 1 025 000 | 1 022 666  | 0,19 |
| National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC, 3,530 %, 20/09/28 EMTN (i) | EUR | 4 355 000 | 4 237 894  | 0,79 |
| Nationwide Building Society 1,500 % 08/03/26 (i) (ii)                                | EUR | 2 770 000 | 2 616 442  | 0,49 |
| Nationwide Building Society, 3,250 %, 05/09/29 EMTN (i)                              | EUR | 1 050 000 | 989 268    | 0,19 |
| NatWest Group PLC, 1,750 %, 02/03/26 EMTN (i) (ii)                                   | EUR | 1 420 000 | 1 347 475  | 0,25 |
| NatWest Group PLC, 4,771 %, 16/02/29 EMTN (i) (ii)                                   | EUR | 2 660 000 | 2 623 668  | 0,49 |
| SSE PLC, 2,875 %, 01/08/29 EMTN (i)                                                  | EUR | 1 470 000 | 1 393 178  | 0,26 |
| SSE PLC, 4,000 % (i) (ii) (iii)                                                      | EUR | 1 240 000 | 1 138 308  | 0,21 |
| Standard Chartered PLC, 0,900 %, 02/07/27 EMTN (i) (ii)                              | EUR | 3 380 000 | 3 006 970  | 0,56 |
| Standard Chartered PLC, 2,500 %, 09/09/30 (i) (ii)                                   | EUR | 1 525 000 | 1 414 502  | 0,26 |
| Virgin Money UK PLC, 4,625 %, 29/10/28 EMTN (i) (ii)                                 | EUR | 250 000   | 234 262    | 0,04 |
| Vodafone Group PLC, 1,625 %, 24/11/30 EMTN (i)                                       | EUR | 1 520 000 | 1 300 968  | 0,24 |
|                                                                                      |     |           | 43 792 058 | 8,16 |

## États-Unis - 16,80 % (31 décembre 2022 : 16,48 %)

|                                                   |     |           |           |      |
|---------------------------------------------------|-----|-----------|-----------|------|
| AbbVie Inc, 0,750 %, 18/11/27                     | EUR | 1 610 000 | 1 420 761 | 0,27 |
| American Tower Corp, 0,400 %, 15/02/27            | EUR | 1 840 000 | 1 593 793 | 0,30 |
| American Tower Corp, 0,450 %, 15/01/27            | EUR | 1 970 000 | 1 707 584 | 0,32 |
| AT&T Inc, 1,600 %, 19/05/28                       | EUR | 2 605 000 | 2 329 975 | 0,43 |
| AT&T Inc, 1,950 %, 15/09/23                       | EUR | 1 305 000 | 1 299 104 | 0,24 |
| AT&T Inc, 3,550 %, 18/11/25                       | EUR | 855 000   | 844 841   | 0,16 |
| AT&T Inc, 4,300 %, 18/11/34                       | EUR | 2 020 000 | 2 022 828 | 0,38 |
| Bank of America Corp, 1,381 %, 09/05/30 EMTN (ii) | EUR | 1 500 000 | 1 266 357 | 0,24 |
| Bank of America Corp, 1,662 %, 25/04/28 EMTN (ii) | EUR | 1 580 000 | 1 418 625 | 0,26 |
| Bank of America Corp, 1,776 %, 04/05/27 EMTN (ii) | EUR | 3 865 000 | 3 572 018 | 0,67 |
| BMW US CAPITAL LLC, 1,000 %, 20/04/27 EMTN        | EUR | 2 315 000 | 2 096 487 | 0,39 |

## Calendrier des investissements

Au 30 juin 2023

|                                                                                |     | Valeur<br>nominale | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|--------------------------------------------------------------------------------|-----|--------------------|------------------------|---------------------|
| <b>OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME<br/>(suite)</b>       |     |                    |                        |                     |
| <b>OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)</b>                                    |     |                    |                        |                     |
| <b>États-Unis – 16,80 % (31 décembre 2022 : 16,48 %) (suite)</b>               |     |                    |                        |                     |
| Booking Holdings Inc, 4,250 %, 15/05/29                                        | EUR | 3 620 000          | 3 664 569              | 0,68                |
| Chubb INA Holdings Inc, 1,400 %, 15/06/31                                      | EUR | 3 335 000          | 2 695 734              | 0,50                |
| Citigroup Inc, 0,500 %, 08/10/27 EMTN (ii)                                     | EUR | 1 420 000          | 1 249 046              | 0,23                |
| Citigroup Inc, 1,500 %, 24/07/26 EMTN (ii)                                     | EUR | 1 835 000          | 1 720 999              | 0,32                |
| Coca-Cola Co, 1,250 %, 08/03/31                                                | EUR | 3 400 000          | 2 890 673              | 0,54                |
| Corning Inc, 4,125 %, 15/05/31                                                 | EUR | 2 060 000          | 2 038 896              | 0,38                |
| Digital Euro Finco LLC, 1,125 %, 09/04/28                                      | EUR | 3 220 000          | 2 652 861              | 0,49                |
| Dover Corp, 0,750 %, 04/11/27                                                  | EUR | 1 500 000          | 1 308 084              | 0,24                |
| Eli Lilly & Co, 1,125 %, 14/09/51                                              | EUR | 600 000            | 344 124                | 0,06                |
| Fiserv Inc, 0,375 %, 01/07/23                                                  | EUR | 1 630 000          | 1 630 000              | 0,30                |
| Fiserv Inc, 4,500 %, 24/05/31                                                  | EUR | 2 890 000          | 2 900 427              | 0,54                |
| General Mills Inc, 3,907 %, 13/04/29                                           | EUR | 405 000            | 405 425                | 0,08                |
| General Motors Financial Co, Inc., 4,300 %, 15/02/29 EMTN                      | EUR | 780 000            | 758 987                | 0,14                |
| General Motors Financial Co, Inc., 4,500 %, 22/11/27 EMTN                      | EUR | 800 000            | 793 244                | 0,15                |
| Global Payments Inc, 4,875 %, 17/03/31                                         | EUR | 2 020 000          | 2 010 492              | 0,37                |
| Illinois Tool Works Inc, 0,625 %, 05/12/27                                     | EUR | 1 485 000          | 1 301 540              | 0,24                |
| Illinois Tool Works Inc, 2,125 %, 22/05/30                                     | EUR | 700 000            | 630 120                | 0,12                |
| JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, 18/05/28 EMTN (ii)                               | EUR | 1 790 000          | 1 618 002              | 0,30                |
| JPMorgan Chase & Co, 1,963 %, 23/03/30 EMTN (ii)                               | EUR | 1 500 000          | 1 322 691              | 0,25                |
| Kraft Heinz Foods Co, 2,250 %, 25/05/28                                        | EUR | 2 750 000          | 2 539 240              | 0,47                |
| Kraft Heinz Foods Co, 3,812 %, 09/05/25 (ii)                                   | EUR | 1 220 000          | 1 222 257              | 0,23                |
| Merck & Co, Inc., 0,500 %, 02/11/24                                            | EUR | 1 050 000          | 1 003 475              | 0,19                |
| Morgan Stanley, 0,406 %, 29/10/27 (ii)                                         | EUR | 3 425 000          | 2 985 340              | 0,56                |
| Morgan Stanley, 0,495 %, 26/10/29 (ii)                                         | EUR | 3 500 000          | 2 851 065              | 0,53                |
| Nasdaq Inc, 0,900 %, 30/07/33                                                  | EUR | 1 525 000          | 1 098 171              | 0,21                |
| Netflix Inc, 4,625 %, 15/05/29                                                 | EUR | 2 325 000          | 2 350 408              | 0,44                |
| PPG Industries Inc, 2,750 %, 01/06/29                                          | EUR | 3 155 000          | 2 937 715              | 0,55                |
| Prologis Euro Finance LLC 1,000 %, 08/02/29 EMTN                               | EUR | 3 690 000          | 3 065 578              | 0,57                |
| Realty Income Corp, 4,875 %, 06/07/30                                          | EUR | 1 315 000          | 1 309 303              | 0,24                |
| RELX Capital Inc 1,300 %, 12/05/25                                             | EUR | 1 020 000          | 966 346                | 0,18                |
| Thermo Fisher Scientific Inc, 0,875 %, 01/10/31                                | EUR | 1 825 000          | 1 460 847              | 0,27                |
| Toyota Motor Credit Corp, 4,050 %, 13/09/29 EMTN                               | EUR | 2 540 000          | 2 570 898              | 0,48                |
| Unilever Capital Corp, 3,400 %, 06/06/33 EMTN                                  | EUR | 1 880 000          | 1 847 852              | 0,34                |
| United Parcel Service Inc, 1,500 %, 15/11/32                                   | EUR | 640 000            | 521 083                | 0,10                |
| Verizon Communications Inc, 0,375 %, 22/03/29                                  | EUR | 1 160 000          | 951 643                | 0,18                |
| Verizon Communications Inc, 1,300 %, 18/05/33                                  | EUR | 2 845 000          | 2 192 545              | 0,41                |
| Verizon Communications Inc, 4,250 %, 31/10/30                                  | EUR | 2 675 000          | 2 706 180              | 0,50                |
| Visa Inc, 1,500 %, 15/06/26                                                    | EUR | 3 060 000          | 2 870 099              | 0,54                |
| Visa Inc, 2,000 %, 15/06/29                                                    | EUR | 1 300 000          | 1 202 500              | 0,22                |
|                                                                                |     |                    | <b>90 160 832</b>      | <b>16,80</b>        |
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES</b>                                  |     |                    | <b>524 656 119</b>     | <b>97,74</b>        |
| <b>TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES<br/>OBLIGATIONS À MOYEN TERME</b> |     |                    | <b>524 656 119</b>     | <b>97,74</b>        |

| Calendrier des investissements | Au 30 juin 2023 |
|--------------------------------|-----------------|
|--------------------------------|-----------------|

|                                                                                                                                                                 | Juste valeur<br>en EUR | % de l'actif<br>net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|---------------------|
| <b>TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR<br/>PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS<br/>INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS<br/>(Coût : 533 891 300 EUR)</b> | <b>524 656 119</b>     | <b>97,74</b>        |

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS - 0,03 % (31 décembre 2022 : (0,20 %))

## Contrats à terme normalisés - 0,03 % (31 décembre 2022 : (0,20 %))

| Nombre de<br>contrats                                           | Libellé                               | Contrepartie | Engagement | Plus-value/<br>(moins-value)<br>latente | % de l'actif<br>net |
|-----------------------------------------------------------------|---------------------------------------|--------------|------------|-----------------------------------------|---------------------|
| (322)                                                           | Euro-Bobl September 2023<br>Futures   | JP Morgan    | 37 731 960 | 473 340                                 | 0,09 %              |
| 110                                                             | Euro-Bund September 2023<br>Futures   | JP Morgan    | 14 763 100 | (51 700)                                | (0,01 %)            |
| 492                                                             | Euro-Schatz September 2023<br>Futures | JP Morgan    | 51 858 320 | (272 120)                               | (0,05 %)            |
| Plus-value latente sur les contrats à terme normalisés          |                                       |              |            | 473 340                                 | 0,09 %              |
| Moins-value latente sur les contrats à terme normalisés         |                                       |              |            | (323 820)                               | (0,06 %)            |
| <b>Plus-value nette latente sur contrats à terme normalisés</b> |                                       |              |            | <b>149 520</b>                          | <b>0,03 %</b>       |

|                                                                                                | Juste valeur<br>en USD | % de l'actif<br>net |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|---------------------|
| <b>Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>525 129 459</b>     | <b>97,83</b>        |
| <b>Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat</b>  | <b>(323 820)</b>       | <b>(0,06)</b>       |

|                                                                                                                                      |                    |               |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|---------------|
| <b>TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE<br/>VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT<br/>ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS</b> | <b>524 805 639</b> | <b>97,77</b>  |
| Avoirs nets en banque                                                                                                                | 12 409 138         | 2,31          |
| Autres actifs                                                                                                                        | 9 269 702          | 1,73          |
| Moins autres passifs                                                                                                                 | (9 724 141)        | (1,81)        |
| <b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS<br/>PARTICIPANTES REMBOURSABLES</b>                                                | <b>536 760 338</b> | <b>100,00</b> |



**LES DIX PREMIÈRES PARTICIPATIONS SECTORIELLES AU 30 JUIN 2023 EN POURCENTAGE DE L'ACTIF NET**

|                          |         |
|--------------------------|---------|
| Activités bancaires      | 32,51 % |
| Électricité              | 9,44 %  |
| Télécommunications       | 5,92 %  |
| Automobile               | 3,93 %  |
| Assurance                | 3,66 %  |
| REIT                     | 3,66 %  |
| Santé                    | 3,34 %  |
| Produits pharmaceutiques | 3,16 %  |
| Immobilier               | 2,69 %  |
| Finance                  | 2,69 %  |

(i) Titres émis par des émetteurs non américains ou non canadiens.

(ii) Indique un titre à taux variable. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2023.

(iii) Obligations perpétuelles.

## Abréviations

EUR : Euro

**Analyse de l'actif total**

**% de  
Total de l'actif**

|                                                                                                                        |               |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
| Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle ou échangés sur un marché réglementé | 96,00         |
| Instruments financiers dérivés                                                                                         | 0,03          |
| Actif circulant                                                                                                        | 3,97          |
|                                                                                                                        | <u>100,00</u> |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE

| Principaux achats                                         | USD nominal       | Coût USD      |
|-----------------------------------------------------------|-------------------|---------------|
| United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, 30/06/25       | 68 420 000,00     | 68 093 935,94 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 27/04/23   | 29 850 000,00     | 29 543 973,38 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 20/06/23   | 8 895 000,00      | 8 833 282,89  |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 27/06/23   | 8 830 000,00      | 8 762 352,40  |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 23/05/23   | 5 735 000,00      | 5 698 964,13  |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 12/07/2023 | 5 850 000,00      | 5 696 712,78  |
| Micron Technology Inc, 5,875 %, 15/09/33                  | 4 690 000,00      | 4 666 784,50  |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 28/12/23   | 4 385 000,00      | 4 268 967,66  |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 24/10/23   | 4 340 000,00      | 4 267 155,03  |
| Astrazeneca Finance LLC, 4,875 %, 03/03/28                | 4 195 000,00      | 4 186 526,10  |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 21/12/23   | 2 930 000,00      | 2 853 838,72  |
| American Tower Corp, 5,500 %, 15/03/28                    | 2 575 000,00      | 2 567 120,50  |
| Salesforce Inc, 3,700 % 11/04/28                          | 2 410 000,00      | 2 345 177,15  |
| Sprint Capital Corp, 8,750 %, 15/03/32                    | 1 750 000,00      | 2 132 102,00  |
| General Motors Financial Co Inc, 6,000 %, 09/01/28        | 1 755 000,00      | 1 754 842,05  |
| Micron Technology Inc, 5,875 %, 09/02/33                  | 1 735 000,00      | 1 733 837,55  |
| Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, 01/03/31            | 1 950 000,00      | 1 729 964,00  |
| Indonesia Treasury Bond, 6,375 %, 15/08/28                | 21 774 000 000,00 | 1 476 254,96  |
| GATX Corp, 5,450 %, 15/09/33                              | 1 470 000,00      | 1 468 608,10  |
| Lithia Motors Inc, 3,875 %, 01/06/29 144A                 | 1 665 000,00      | 1 448 775,00  |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

| Principales ventes                                                      | USD nominal   | Produit USD   |
|-------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|
| United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, 30/11/23                     | 35 535 000,00 | 34 829 852,34 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 02/02/2023               | 29 000 000,00 | 28 929 550,54 |
| United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, 29/02/24                     | 23 365 000,00 | 22 764 446,48 |
| United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, 31/10/23                     | 12 280 000,00 | 12 082 368,75 |
| United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, 15/05/52                     | 9 020 000,00  | 7 725 973,83  |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 27/04/23                 | 6 925 000,00  | 6 887 306,34  |
| Svenska Handelsbanken AB, 0,550 %, 11/06/24 144A                        | 4 515 000,00  | 4 294 758,30  |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 09/03/2023               | 4 250 000,00  | 4 241 152,82  |
| Owl Rock Capital Corp, 4,250 %, 15/01/26                                | 3 900 000,00  | 3 653 855,00  |
| Salesforce Inc, 3,700 % 11/04/28                                        | 3 100 000,00  | 3 040 183,10  |
| Astrazeneca Finance LLC, 4,875 %, 03/03/28                              | 2 995 000,00  | 3 030 522,85  |
| Intel Corp, 3,750 %, 05/08/27                                           | 3 060 000,00  | 2 959 392,50  |
| El Paso Energy Capital Trust I                                          | 60 244,00     | 2 772 921,03  |
| General Motors Co, 5,200 %, 01/04/45                                    | 3 215 000,00  | 2 718 076,90  |
| PulteGroup Inc, 6,375 %, 15/05/33                                       | 2 585 000,00  | 2 684 910,25  |
| 2020 Cash Mandatory Exchangeable Trust, Zero Coupon Bond, 01/06/23 144A | 1 926,00      | 2 270 440,97  |
| Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, 2,360 %, 20/03/26 144A        | 2 230 000,00  | 2 109 527,73  |
| American Tower Corp, 5,500 %, 15/03/28                                  | 1 705 000,00  | 1 733 736,20  |
| Pfizer Inc, 3,000 %, 15/12/26                                           | 1 640 000,00  | 1 558 752,75  |
| PulteGroup Inc, 6,000 %, 15/02/35                                       | 1 545 000,00  | 1 550 338,45  |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE

| Principaux achats                                                  | USD nominal | Coût USD   |
|--------------------------------------------------------------------|-------------|------------|
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 17/10/23            | 600 000,00  | 590 597,92 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 30/05/23            | 225 000,00  | 223 441,78 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 30/03/23            | 170 000,00  | 168 365,46 |
| Calpine Corp, 4,500 %, 15/02/28 144A                               | 65 000,00   | 59 462,50  |
| Ford Motor Co, 4,346 %, 08/12/26                                   | 55 000,00   | 53 000,20  |
| Rand Parent LLC, 8,500 %, 15/02/30 144A                            | 55 000,00   | 52 834,05  |
| Transocean Poseidon Ltd, 6,875 %, 01/02/27 144A                    | 42 500,00   | 42 052,76  |
| VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,250 %, 01/12/26 144A        | 45 000,00   | 41 764,05  |
| TransDigm Inc, 6,750 %, 15/08/28 144A                              | 40 000,00   | 40 000,00  |
| Hilton Domestic Operating Co Inc, 3,625 %, 15/02/32 144A           | 45 000,00   | 37 326,25  |
| Covanta Holding Corp, 4,875 %, 01/12/29 144A                       | 40 000,00   | 35 124,35  |
| Targa Resources Corp, 6,125 %, 15/03/33                            | 30 000,00   | 30 355,90  |
| Sensata Technologies Inc, 3,750 %, 15/02/31 144A                   | 35 000,00   | 30 188,75  |
| Amgen Inc, 5,250 %, 02/03/25                                       | 30 000,00   | 29 980,20  |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC, 3,875 %, 01/11/33 144A          | 35 000,00   | 28 706,25  |
| Carnival Corp, 9,875 %, 01/08/27 144A                              | 25 000,00   | 25 634,50  |
| Civitas Resources Inc, 8,375 %, 01/07/28 144A                      | 25 000,00   | 25 000,00  |
| Seagate HDD Cayman, 4,750 %, 01/01/25                              | 25 000,00   | 24 549,25  |
| Entegris Escrow Corp, 4,750 %, 15/04/29 144A                       | 25 000,00   | 23 193,25  |
| CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 5,000 %, 01/02/28 144A | 25 000,00   | 23 112,50  |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND (suite)

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

| Principales ventes                                                | USD nominal | Produit USD |
|-------------------------------------------------------------------|-------------|-------------|
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 30/03/23           | 200 000,00  | 198 432,83  |
| First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, 01/03/26 144A                | 200 000,00  | 190 000,00  |
| SoftBank Group Corp, 4,625 %, 06/07/28                            | 200 000,00  | 172 500,00  |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 17/10/23           | 150 000,00  | 147 560,61  |
| Sprint LLC, 7,625 %, 15/02/25                                     | 135 000,00  | 138 910,65  |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 30/05/23           | 90 000,00   | 89 724,97   |
| Loomis Sayles Asia Bond Plus Fund                                 | 10,63       | 84 998,94   |
| United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, 15/12/23               | 80 000,00   | 78 156,25   |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, 01/10/26 | 75 000,00   | 66 725,30   |
| Calpine Corp, 5,125 %, 15/03/28 144A                              | 70 000,00   | 63 512,50   |
| Navient Corp, 5,625 %, 01/08/33                                   | 85 000,00   | 62 210,60   |
| Uber Technologies Inc, 8,000 %, 01/11/26 144A                     | 55 000,00   | 56 069,40   |
| Morgan Stanley, Zero Coupon Bond, 18/02/26                        | 55 000,00   | 52 262,85   |
| JPMorgan Chase & Co, Zero Coupon Bond, 22/04/26                   | 55 000,00   | 51 286,25   |
| Ford Motor Co, 3,250 %, 12/02/32                                  | 55 000,00   | 42 550,00   |
| Sprint LLC, 7,625 %, 01/03/26                                     | 40 000,00   | 42 340,90   |
| Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, 01/09/30                      | 40 000,00   | 42 280,70   |
| DCP Midstream Operating LP, 5,625 %, 15/07/27                     | 40 000,00   | 40 062,35   |
| PDC Energy Inc, 5,750 %, 15/05/26                                 | 40 000,00   | 39 808,25   |
| Hilton Domestic Operating Co Inc, 5,375 %, 01/05/25 144A          | 40 000,00   | 39 723,25   |
| SBA Communications Corp, 3,125 %, 01/02/29                        | 45 000,00   | 38 441,85   |
| Open Text Corp, 3,875 %, 01/12/29 144A                            | 45 000,00   | 37 818,70   |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE

| Principaux achats                                           | USD nominal      | Coût USD     |
|-------------------------------------------------------------|------------------|--------------|
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, 15/08/28 | 1 570 000,00     | 1 530 139,16 |
| United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 31/01/30         | 1 425 000,00     | 1 389 653,32 |
| Japan Government Five Year Bond, 0,100 %, 20/12/25          | 122 500 000,00   | 877 683,21   |
| United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 15/09/25         | 665 000,00       | 654 063,87   |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, 15/08/32 | 600 000,00       | 617 332,76   |
| United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, 31/10/24         | 590 000,00       | 591 286,33   |
| Canadian Government Bond, 1,500 %, 01/06/26                 | 845 000,00       | 590 876,80   |
| Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 15/02/33                  | 7 418 000 000,00 | 504 673,81   |
| UnitedHealth Group Inc, 4,500 %, 15/04/33                   | 490 000,00       | 484 787,45   |
| Korea Treasury Bond, 4,250 %, 10/12/32                      | 569 920 000,00   | 467 867,27   |
| United Kingdom Gilt, 4,750 %, 07/12/30                      | 360 000,00       | 467 010,62   |
| China Development Bank, 3,020 %, 06/03/33                   | 3 200 000,00     | 459 993,93   |
| Freddie Mac Pool, 4,500 %, 01/05/53                         | 384 272,58       | 370 582,87   |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,000 %, 15/08/24 | 350 000,00       | 370 379,01   |
| United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, 31/05/28         | 340 000,00       | 334 116,41   |
| T-Mobile USA Inc, 5,050 %, 15/07/33                         | 335 000,00       | 332 866,00   |
| Republic of South Africa Government Bond, 7,000 %, 28/02/31 | 8 075 000,00     | 324 778,50   |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300 %, 15/02/33 | 290 000,00       | 313 235,96   |
| AT&T Inc, 2,250 %, 01/02/32                                 | 335 000,00       | 266 288,75   |
| New South Wales Treasury Corp, 2,000 %, 08/03/33            | 485 000,00       | 263 337,15   |
| Bank of America Corp, Zero Coupon Bond, 25/04/34            | 250 000,00       | 247 460,10   |
| United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, 15/05/51         | 330 000,00       | 239 623,83   |
| CVS Health Corp, 5,300 %, 01/06/33                          | 235 000,00       | 234 278,55   |
| Danske Bank A/S, Zero Coupon Bond, 21/06/30                 | 210 000,00       | 227 465,81   |
| Rio Tinto Finance USA PLC, 5,000 %, 09/03/33                | 225 000,00       | 224 661,55   |
| Fannie Mae Pool, 6,500 %, 01/05/53                          | 216 983,56       | 222 261,75   |
| United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, 15/02/53         | 225 000,00       | 221 595,70   |
| Sweden Government Bond, 2,500 %, 12/05/25                   | 2 250 000,00     | 215 214,94   |
| Centene Corp, 2,500 %, 01/03/31                             | 265 000,00       | 213 062,85   |
| Ford Motor Credit Co LLC, 7,200 %, 10/06/30                 | 200 000,00       | 200 000,00   |
| NatWest Group PLC, Zero Coupon Bond, 13/09/29               | 200 000,00       | 200 000,00   |
| Amgen Inc, 5,250 %, 02/03/33                                | 195 000,00       | 194 343,60   |
| Autonomous Community of Madrid Spain, 4,300 %, 15/09/26     | 155 000,00       | 173 239,97   |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND (suite)

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

| Principales ventes                                                   | USD nominal      | Produit USD  |
|----------------------------------------------------------------------|------------------|--------------|
| United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, 31/05/24                  | 1 835 000,00     | 1 784 058,40 |
| China Government Bond, 1,990 %, 09/04/25                             | 10 290 000,00    | 1 507 048,61 |
| United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, 31/10/24                  | 1 320 000,00     | 1 313 873,44 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Zero Coupon Bond, 15/02/30 | 1 110 000,00     | 1 049 832,75 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,000 %, 15/08/24          | 975 000,00       | 1 036 726,85 |
| United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, 15/02/32                  | 1 170 000,00     | 1 020 214,27 |
| United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, 15/02/41                  | 1 280 000,00     | 972 800,58   |
| European Investment Bank, 2,375 %, 06/07/23 144A                     | 1 290 000,00     | 954 283,11   |
| Fannie Mae Pool, 2,000 %, 01/05/51                                   | 984 391,13       | 839 347,25   |
| United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, 15/08/31                  | 980 000,00       | 832 540,63   |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, 15/08/28          | 790 000,00       | 779 865,79   |
| Japan Government Thirty Year Bond, 1,700 %, 20/12/43                 | 86 450 000,00    | 717 064,69   |
| United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, 31/01/27                  | 725 000,00       | 665 531,84   |
| United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, 15/05/51                  | 815 000,00       | 639 658,79   |
| United Kingdom Gilt, 2,250 %, 07/09/23                               | 495 000,00       | 604 446,24   |
| Republic of South Africa Government Bond, 7,000 %, 28/02/31          | 11 710 000,00    | 572 904,74   |
| Colombian TES, 7,500 %, 26/08/26                                     | 2 888 500 000,00 | 561 797,36   |
| Spain Government Bond, 1,300 %, 31/10/26 144A                        | 495 000,00       | 512 118,74   |
| Fannie Mae Pool, 3,000 %, 01/11/51                                   | 550 034,91       | 505 430,52   |
| Japan Government Two Year Bond, 0,005 %, 01/05/24                    | 66 550 000,00    | 505 087,82   |
| COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, 3,902 %, 10/07/50                      | 500 000,00       | 487 031,25   |
| United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 31/01/30                  | 485 000,00       | 476 714,45   |
| Fannie Mae Pool, 2,500 %, 01/05/52                                   | 535 295,39       | 474 572,82   |
| Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide, 1,875 %, 31/03/28   | 490 000,00       | 472 974,81   |
| United Kingdom Gilt, 4,250 %, 07/12/55                               | 325 000,00       | 443 869,67   |
| United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, 30/04/27                  | 440 000,00       | 426 404,69   |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Zero Coupon Bond, 15/08/26 | 420 000,00       | 416 278,52   |
| Korea Treasury Bond, 1,375 %, 10/06/30                               | 571 320 000,00   | 408 850,22   |
| New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, 20/05/26                     | 560 000,00       | 394 102,09   |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Zero Coupon Bond, 15/08/52 | 655 000,00       | 381 402,10   |
| Norway Government Bond, 1,750 %, 13/03/25 144A                       | 3 895 000,00     | 379 355,49   |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE

| Principaux achats                                                      | USD nominal       | Coût USD     |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|--------------|
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 20/04/23                | 4 100 000,00      | 4 063 368,62 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 15/08/23                | 3 950 000,00      | 3 893 715,78 |
| China Government International Bond, 1,200 %, 21/10/30                 | 3 400 000,00      | 2 867 396,40 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 13/04/23                | 2 480 000,00      | 2 457 536,16 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 11/05/2023              | 1 750 000,00      | 1 740 308,50 |
| Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 15/09/30                             | 25 384 000 000,00 | 1 739 499,86 |
| Mexican Bonos, 7,750 %, 29/05/31                                       | 28 615 900,00     | 1 477 191,18 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 17/10/23                | 1 450 000,00      | 1 426 609,89 |
| Uruguay Government International Bond, 8,250 %, 21/05/31               | 60 397 000,00     | 1 401 090,67 |
| Colombian TES, 7,750 %, 18/09/30                                       | 7 281 000 000,00  | 1 344 592,87 |
| Republic of South Africa Government Bond, 8,000 %, 31/01/30            | 26 192 500,00     | 1 313 859,37 |
| Malaysia Government Bond, 2,632 %, 15/04/31                            | 6 224 000,00      | 1 287 357,98 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 31/08/23                | 820 000,00        | 804 298,33   |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 06/04/23                | 800 000,00        | 791 404,78   |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4,700 %, 01/09/30 144A | 670 000 000,00    | 772 203,89   |
| Gaci First Investment Co, 4,750 %, 14/02/30                            | 520 000,00        | 514 514,00   |
| Turkey Government Bond, 11,700 %, 13/11/30                             | 7 411 000,00      | 492 583,64   |
| Gaci First Investment Co, 4,875 %, 14/02/35                            | 390 000,00        | 381 205,50   |
| Petroleos Mexicanos, 10,000 %, 07/02/33 144A                           | 390 000,00        | 381 030,00   |
| Export-Import Bank of India, 5,500 %, 18/01/33 144A                    | 375 000,00        | 374 516,25   |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.



# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (suite)

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

| Principales ventes                                                     | USD nominal       | Produit USD  |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|--------------|
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 20/04/23                | 3 100 000,00      | 3 084 981,80 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 15/08/23                | 1 710 000,00      | 1 689 784,63 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 09/03/2023              | 1 675 000,00      | 1 662 614,33 |
| Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 15/09/30                             | 20 733 000 000,00 | 1 427 454,46 |
| Mexican Bonos, 7,750 %, 29/05/31                                       | 25 105 300,00     | 1 313 568,82 |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 26/01/23                | 1 300 000,00      | 1 297 112,07 |
| Malaysia Government Bond, 2,632 %, 15/04/31                            | 5 984 000,00      | 1 221 903,54 |
| China Government International Bond, 1,200 %, 21/10/30                 | 1 400 000,00      | 1 184 222,00 |
| Republic of South Africa Government Bond, 8,000 %, 31/01/30            | 23 282 800,00     | 1 149 737,51 |
| Colombian TES, 7,750 %, 18/09/30                                       | 5 368 500 000,00  | 1 026 173,55 |
| Uruguay Government International Bond, 8,250 %, 21/05/31               | 42 684 000,00     | 1 014 192,91 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4,700 %, 01/09/30 144A | 720 000 000,00    | 857 962,51   |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 06/04/2023              | 800 000,00        | 792 036,11   |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 11/05/2023              | 650 000,00        | 648 410,89   |
| Gaci First Investment Co, 4,750 %, 14/02/30                            | 520 000,00        | 520 000,00   |
| Turkey Government Bond, 11,700 %, 13/11/30                             | 7 966 000,00      | 502 505,67   |
| United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 13/04/23                | 450 000,00        | 447 864,40   |
| Ecopetrol SA, 8,875 %, 13/01/33                                        | 375 000,00        | 394 833,75   |
| Export-Import Bank of India, 5,500 %, 18/01/33 144A                    | 375 000,00        | 385 698,75   |
| Petroleos Mexicanos, 10,000 %, 07/02/33 144A                           | 390 000,00        | 382 703,10   |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE

| Principaux achats                                                | EUR nominal | Coût EUR   |
|------------------------------------------------------------------|-------------|------------|
| Forvia, 2,750 %, 15/02/27                                        | 510 000,00  | 450 225,00 |
| Ford Motor Credit Co LLC, 3,250 %, 15/09/25                      | 400 000,00  | 383 620,00 |
| iliad SA, 2,375 %, 17/06/26                                      | 400 000,00  | 366 708,00 |
| Deutsche Lufthansa AG, 2,875 %, 16/05/27                         | 400 000,00  | 360 585,00 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, 15/09/29 | 285 000,00  | 286 600,00 |
| Deutsche Lufthansa AG, 3,000 %, 29/05/26                         | 300 000,00  | 279 750,00 |
| Ford Motor Credit Co LLC, 6,125 %, 15/05/28                      | 235 000,00  | 235 875,00 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,875 %, 31/03/27 | 250 000,00  | 211 025,00 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,625 %, 15/10/28 | 270 000,00  | 208 845,00 |
| INEOS Quattro Finance 2 Plc, 2,500 %, 15/01/26                   | 230 000,00  | 203 413,70 |
| Nexans SA, 5,500 %, 05/04/28                                     | 200 000,00  | 202 200,00 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 6,000 %, 31/01/25 | 200 000,00  | 201 460,00 |
| IHO Verwaltungs GmbH, 8,750 %, 15/05/28                          | 200 000,00  | 201 110,00 |
| RCI Banque SA, 4,625 %, 13/07/26                                 | 200 000,00  | 201 068,00 |
| Stena International SA, 7,250 %, 15/02/28                        | 200 000,00  | 200 000,00 |
| Playtech PLC, 5,875 %, 28/06/28                                  | 200 000,00  | 200 000,00 |
| Emerald Debt Merger Sub LLC, 6,375 %, 15/12/30 144A              | 200 000,00  | 199 348,00 |
| Nykredit Realkredit AS, Zero Coupon Bond, 29/12/32               | 200 000,00  | 198 002,00 |
| RCI Banque SA, 4,500 %, 06/04/27                                 | 200 000,00  | 196 603,00 |
| Vodafone Group PLC, Zero Coupon Bond, 27/08/80                   | 210 000,00  | 189 561,70 |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND (suite)

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

| Principales ventes                                               | EUR nominal | Produit EUR |
|------------------------------------------------------------------|-------------|-------------|
| Teollisuuden Voima Oyj, 2,125 %, 04/02/25                        | 325 000,00  | 314 437,25  |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 3,750 %, 09/05/27 | 350 000,00  | 314 383,00  |
| Deutsche Lufthansa AG, 2,875 %, 11/02/25                         | 300 000,00  | 288 750,00  |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, 15/09/29 | 285 000,00  | 288 492,50  |
| Deutsche Lufthansa AG, 3,000 %, 29/05/26                         | 300 000,00  | 280 875,00  |
| ING Groep NV, Zero Coupon Bond, 22/03/30                         | 300 000,00  | 280 053,00  |
| Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,875 %, 08/07/26          | 300 000,00  | 278 008,00  |
| Forvia, 3,750 %, 15/06/28                                        | 310 000,00  | 275 280,00  |
| IHO Verwaltungs GmbH, 3,875 %, 15/05/27                          | 300 000,00  | 269 150,00  |
| Repsol International Finance BV, Zero Coupon Bond, 11/06/72      | 280 000,00  | 260 900,00  |
| Nokia Oyj, 3,125 %, 15/05/28                                     | 260 000,00  | 245 691,15  |
| Synthomer PLC, 3,875 %, 01/07/25                                 | 220 000,00  | 207 980,00  |
| Électricité de France SA, Zero Coupon Bond, 06/12/71             | 200 000,00  | 203 000,00  |
| Valeo, 5,375 %, 28/05/27                                         | 200 000,00  | 201 774,00  |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 6,000 %, 31/01/25 | 200 000,00  | 201 300,00  |
| RCI Banque SA, 4,625 %, 13/07/26                                 | 200 000,00  | 201 000,00  |
| Barclays PLC, Zero Coupon Bond, 07/02/28                         | 200 000,00  | 199 360,00  |
| UniCredit SpA, Zero Coupon Bond, 20/02/29                        | 200 000,00  | 198 700,00  |
| Vodafone Group PLC, Zero Coupon Bond, 03/01/79                   | 200 000,00  | 198 250,00  |
| Coty Inc, 3,875 %, 15/04/26                                      | 200 000,00  | 194 260,00  |
| SIG Combibloc PurchaseCo Sarl, 2,125 %, 18/06/25                 | 200 000,00  | 193 415,00  |
| Ford Motor Credit Co LLC, 1,744 %, 19/07/24                      | 200 000,00  | 192 621,00  |
| Ford Motor Credit Co LLC, 3,250 %, 15/09/25                      | 200 000,00  | 191 625,00  |
| Forvia, 2,750 %, 15/02/27                                        | 210 000,00  | 190 686,40  |
| Ford Motor Credit Co LLC, 2,386 %, 17/02/26                      | 200 000,00  | 188 100,00  |
| Eurofins Scientific SE, Zero Coupon Bond, 13/11/71               | 200 000,00  | 186 092,50  |
| Gruenthal GmbH, 3,625 %, 15/11/26                                | 200 000,00  | 185 502,00  |
| Renault SA, 1,250 %, 24/06/25                                    | 200 000,00  | 185 300,00  |
| Gruenthal GmbH, 4,125 %, 15/05/28                                | 200 000,00  | 184 280,00  |
| IHO Verwaltungs GmbH, 3,750 %, 15/09/26                          | 200 000,00  | 180 950,00  |
| Nissan Motor Co Ltd, 3,201 %, 17/09/28                           | 200 000,00  | 180 554,00  |
| ZF Finance GmbH, 2,000 %, 06/05/27                               | 200 000,00  | 175 750,00  |
| Webuild SpA, 3,875 %, 28/07/26                                   | 200 000,00  | 174 861,00  |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE

| Principaux achats                                                           | EUR nominal  | Coût EUR     |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------------|--------------|
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,000 %, 04/01/37                 | 1 085 000,00 | 1 295 447,95 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,250 %, 19/07/28                    | 900 000,00   | 729 957,00   |
| Nordea Bank Abp, 4,125 %, 05/05/28                                          | 720 000,00   | 716 037,50   |
| Danaher Corp, 2,500 %, 30/03/30                                             | 750 000,00   | 702 915,00   |
| BP Capital Markets BV, 3,773 %, 12/05/30                                    | 700 000,00   | 698 990,00   |
| National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC, 3,530 %, 20/09/28 | 675 000,00   | 668 504,60   |
| Volkswagen Bank GmbH, 2,500 %, 31/07/26                                     | 700 000,00   | 661 228,00   |
| Deutsche Bank AG, Zero Coupon Bond, 03/09/26                                | 700 000,00   | 646 955,00   |
| SELP Finance Sarl, 3,750 %, 10/08/27                                        | 645 000,00   | 609 310,00   |
| ALD SA, 4,250 %, 18/01/27                                                   | 600 000,00   | 603 354,00   |
| Arval Service Lease SA/France, 4,125 %, 13/04/26                            | 600 000,00   | 598 044,00   |
| Volkswagen Bank GmbH, 4,625 %, 03/05/31                                     | 600 000,00   | 597 876,00   |
| Credit Suisse AG/London, 0,250 %, 01/09/28                                  | 795 000,00   | 597 315,10   |
| Coca-Cola Co, 1,250 %, 08/03/31                                             | 700 000,00   | 596 610,00   |
| Morgan Stanley, Zero Coupon Bond, 26/10/29                                  | 700 000,00   | 567 350,00   |
| Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 02/07/27                          | 615 000,00   | 556 224,50   |
| Sika Capital BV, 3,750 %, 03/11/26                                          | 535 000,00   | 535 163,25   |
| Deutsche Bank AG, Zero Coupon Bond, 23/02/28                                | 600 000,00   | 534 448,00   |
| Bank of America Corp, Zero Coupon Bond, 04/05/27                            | 550 000,00   | 512 217,50   |
| Toyota Motor Credit Corp, 4,050 %, 13/09/29                                 | 510 000,00   | 512 195,80   |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND (suite)

### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

| Principales ventes                                       | EUR nominal  | Produit EUR  |
|----------------------------------------------------------|--------------|--------------|
| Deutsche Bank AG, Zero Coupon Bond, 17/02/27             | 1 300 000,00 | 1 166 947,00 |
| Volkswagen Financial Services AG, 0,875 %, 31/01/28      | 970 000,00   | 835 727,80   |
| Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 27/01/28       | 925 000,00   | 818 796,00   |
| Banco de Sabadell SA, Zero Coupon Bond, 07/11/25         | 800 000,00   | 751 856,00   |
| Danaher Corp, 2,500 %, 30/03/30                          | 750 000,00   | 706 121,70   |
| Volkswagen Bank GmbH, 2,500 %, 31/07/26                  | 700 000,00   | 664 251,00   |
| CaixaBank SA, Zero Coupon Bond, 10/07/26                 | 700 000,00   | 652 600,00   |
| ABN AMRO Bank NV, 4,250 %, 21/02/30                      | 600 000,00   | 604 140,00   |
| TenneT Holding BV, 2,125 %, 17/11/29                     | 650 000,00   | 599 730,00   |
| Orange SA, 3,625 %, 16/11/31                             | 600 000,00   | 596 361,00   |
| Société Foncière Lyonnaise SA, 1,500 %, 29/05/25         | 600 000,00   | 573 300,00   |
| Citigroup Inc, Zero Coupon Bond, 22/09/28                | 580 000,00   | 571 102,80   |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,250 %, 19/07/28 | 700 000,00   | 570 107,00   |
| Richemont International Holding SA, 1,000 %, 26/03/26    | 600 000,00   | 559 370,00   |
| Morgan Stanley, Zero Coupon Bond, 25/10/28               | 550 000,00   | 556 930,00   |
| LeasePlan Corp NV, 0,250 %, 07/09/26                     | 610 000,00   | 539 781,30   |
| KBC Group NV, Zero Coupon Bond, 01/03/27                 | 600 000,00   | 535 396,00   |
| Utah Acquisition Sub Inc, 3,125 %, 22/11/28              | 560 000,00   | 531 624,80   |
| Deutsche Bank AG, Zero Coupon Bond, 23/02/28             | 600 000,00   | 528 984,00   |
| Air Products and Chemicals Inc, 0,500 %, 05/05/28        | 600 000,00   | 523 212,00   |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

**NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC****LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND****CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE**

| <b>Principaux achats</b>                                                    | <b>EUR nominal</b> | <b>Coût EUR</b> |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------------------|-----------------|
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,000 %, 04/01/37                 | 3 820 000,00       | 4 508 251,70    |
| Coca-Cola Co, 1,250 %, 08/03/31                                             | 5 260 000,00       | 4 474 617,20    |
| Nordea Bank Abp, 4,125 %, 05/05/28                                          | 3 755 000,00       | 3 737 955,00    |
| Bank of America Corp, Zero Coupon Bond, 04/05/27                            | 3 865 000,00       | 3 598 466,25    |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,250 %, 19/07/28                    | 4 200 000,00       | 3 410 113,00    |
| SELP Finance Sarl, 3,750 %, 10/08/27                                        | 3 600 000,00       | 3 404 616,00    |
| RCI Banque SA, 4,500 %, 06/04/27                                            | 3 115 000,00       | 3 079 220,75    |
| Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 02/07/27                          | 3 380 000,00       | 3 046 752,10    |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2,750 %, 09/09/30                     | 3 100 000,00       | 3 020 044,00    |
| Toyota Motor Credit Corp, 4,050 %, 13/09/29                                 | 2 990 000,00       | 3 014 387,20    |
| PPG Industries Inc, 2,750 %, 01/06/29                                       | 3 155 000,00       | 2 987 124,75    |
| Deutsche Bank AG, Zero Coupon Bond, 03/09/26                                | 3 200 000,00       | 2 948 106,00    |
| Fiserv Inc, 4,500 %, 24/05/31                                               | 2 890 000,00       | 2 902 282,50    |
| La Poste SA, 3,750 %, 12/06/30                                              | 2 900 000,00       | 2 879 700,00    |
| Morgan Stanley, Zero Coupon Bond, 26/10/29                                  | 3 500 000,00       | 2 839 135,00    |
| Credit Suisse AG/London, 0,250 %, 01/09/28                                  | 3 730 000,00       | 2 819 150,25    |
| Suez SACA, 4,625 %, 03/11/28                                                | 2 700 000,00       | 2 762 104,00    |
| Chubb INA Holdings Inc, 1,400 %, 15/06/31                                   | 3 335 000,00       | 2 704 451,55    |
| National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC, 3,530 %, 20/09/28 | 2 720 000,00       | 2 694 067,55    |
| Digital Euro Finco LLC, 1,125 %, 09/04/28                                   | 3 220 000,00       | 2 682 054,20    |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

## NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

### LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND (suite)

#### CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

| Principales ventes                                    | EUR nominal  | Produit EUR  |
|-------------------------------------------------------|--------------|--------------|
| Deutsche Bank AG, Zero Coupon Bond, 17/02/27          | 4 500 000,00 | 4 043 572,00 |
| TenneT Holding BV, 2,125 %, 17/11/29                  | 4 025 000,00 | 3 709 342,50 |
| Stellantis NV, 0,750 %, 18/01/29                      | 4 250 000,00 | 3 526 463,80 |
| CaixaBank SA, Zero Coupon Bond, 10/07/26              | 3 300 000,00 | 3 076 425,00 |
| Banco de Sabadell SA, Zero Coupon Bond, 07/11/25      | 3 100 000,00 | 2 916 320,00 |
| Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 27/01/28    | 3 260 000,00 | 2 885 115,00 |
| Fiserv Inc, 1,625 %, 01/07/30                         | 3 320 000,00 | 2 819 144,80 |
| ABN AMRO Bank NV, 4,250 %, 21/02/30                   | 2 700 000,00 | 2 718 630,00 |
| Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1,750 %, 26/05/28 | 2 905 000,00 | 2 645 554,45 |
| RCI Banque SA, 4,625 %, 13/07/26                      | 2 605 000,00 | 2 614 811,00 |
| Danaher Corp, 2,500 %, 30/03/30                       | 2 750 000,00 | 2 589 589,80 |
| PPG Industries Inc, 1,400 %, 13/03/27                 | 2 780 000,00 | 2 568 442,00 |
| Nestlé Finance International Ltd, 3,250 %, 15/01/31   | 2 505 000,00 | 2 520 030,00 |
| Snam SpA, 0,750 %, 20/06/29                           | 3 025 000,00 | 2 511 261,00 |
| Highland Holdings Sarl, 0,318 %, 15/12/26             | 2 755 000,00 | 2 451 837,30 |
| Nasdaq Inc, 1,750 %, 28/03/29                         | 2 750 000,00 | 2 443 925,00 |
| Morgan Stanley, Zero Coupon Bond, 25/10/28            | 2 400 000,00 | 2 430 665,00 |
| Citigroup Inc, Zero Coupon Bond, 22/09/28             | 2 465 000,00 | 2 427 186,90 |
| LeasePlan Corp NV, 0,250 %, 07/09/26                  | 2 715 000,00 | 2 402 019,45 |
| Thermo Fisher Scientific Inc, 2,000 %, 15/04/25       | 2 465 000,00 | 2 398 938,00 |

La Banque centrale d'Irlande exige un Calendrier des changements importants apportés à la composition du portefeuille au cours du semestre. Sont entendues comme changements importants les acquisitions regroupées d'un titre dépassant un pour cent de la valeur totale des achats effectués au cours du semestre et les cessions regroupées supérieures à un pour cent de la valeur totale des ventes. Au minimum, les 20 principales acquisitions et les 20 principales cessions doivent figurer au calendrier. Si elles ont été moins de 20, elles doivent toutes y figurer. Une liste complète des évolutions du portefeuille pour le semestre est disponible gratuitement, sur demande auprès de l'Agent administratif.

ANNEXE I

Divulgateion de la performance

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

Conformément à la Section II, Annexe E, « Tableau de performance » du Code on Unit Trusts and Mutual Funds (« UT Code ») :

Un historique de performance pour les 10 derniers exercices ; ou si la structure n'existait pas pendant toute la période, pour toute la période au cours de laquelle elle existait, indiquant le prix d'émission le plus élevé et le prix de rachat le plus bas des parts/actions pour chacune de ces années.

| Classe d'Actions                    | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus faible | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus élevée |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| <b>Classe d'Actions C/A (USD)</b>   |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014   | 20,11                                                     | 21,40                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015   | 18,91                                                     | 20,89                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016   | 18,04                                                     | 21,27                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017   | 20,77                                                     | 22,20                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 20,95                                                     | 22,41                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 21,08                                                     | 23,28                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 19,79                                                     | 24,24                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 23,52                                                     | 24,59                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 19,94                                                     | 24,10                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 20,88                                                     | 21,96                                                     |
| <b>Classe d'Actions C/D (USD)</b>   |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014   | 14,32                                                     | 15,23                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015   | 12,73                                                     | 14,27                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016   | 11,82                                                     | 13,72                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017   | 13,18                                                     | 13,91                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 12,78                                                     | 13,90                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 12,78                                                     | 13,86                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 11,73                                                     | 14,14                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 13,65                                                     | 14,15                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 11,26                                                     | 13,80                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 11,66                                                     | 12,33                                                     |
| <b>Classe d'Actions CT/A (USD)</b>  |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 9,83                                                      | 9,98                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 9,89                                                      | 10,88                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 9,24                                                      | 11,29                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 10,94                                                     | 11,42                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 9,22                                                      | 11,18                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 9,62                                                      | 10,14                                                     |
| <b>Classe d'Actions CT/DG (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 9,15                                                      | 10,17                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 9,42                                                      | 9,98                                                      |
| <b>Classe d'Actions CT/DM (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 9,83                                                      | 9,98                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 9,88                                                      | 10,68                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 9,03                                                      | 10,90                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 10,52                                                     | 10,93                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 8,71                                                      | 10,67                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 9,10                                                      | 9,53                                                      |



# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## ANNEXE I (suite)

### Divulgateion de la performance (suite)

#### LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

| Classe d'Actions                    | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus faible | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus élevée |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| <b>Classe d'Actions F/A (USD)</b>   |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014   | 12,27                                                     | 13,10                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015   | 11,74                                                     | 12,89                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016   | 11,21                                                     | 13,28                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017   | 13,01                                                     | 13,99                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 13,36                                                     | 14,17                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 13,44                                                     | 14,98                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 12,76                                                     | 15,74                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 15,30                                                     | 16,07                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 13,16                                                     | 15,79                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 13,85                                                     | 14,53                                                     |
| <b>Classe d'Actions F/DM (USD)</b>  |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014   | 9,82                                                      | 10,44                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015   | 8,64                                                      | 9,72                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2016   | 7,96                                                      | 9,23                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2017   | 8,89                                                      | 9,36                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 8,59                                                      | 9,37                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 8,62                                                      | 9,32                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 7,88                                                      | 9,51                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 9,17                                                      | 9,53                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 7,59                                                      | 9,30                                                      |
| Période close le 30 juin 2023       | 7,85                                                      | 8,30                                                      |
| <b>Classe d'Actions H-I/A (EUR)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014   | 19,45                                                     | 22,70                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015   | 16,13                                                     | 19,31                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016   | 15,48                                                     | 18,83                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017   | 16,92                                                     | 20,74                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 18,25                                                     | 21,66                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 18,28                                                     | 19,56                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 14,75                                                     | 17,99                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 17,47                                                     | 18,30                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 14,74                                                     | 17,94                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 15,29                                                     | 16,14                                                     |
| <b>Classe d'Actions H-I/D (EUR)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014   | 16,07                                                     | 19,06                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015   | 12,79                                                     | 15,80                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016   | 12,15                                                     | 14,47                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017   | 12,61                                                     | 15,21                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 11,95                                                     | 14,54                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 11,65                                                     | 12,33                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 9,16                                                      | 10,93                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 10,51                                                     | 10,85                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 8,45                                                      | 10,52                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 8,61                                                      | 9,17                                                      |
| <b>Classe d'Actions H-I/D (GBP)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014   | 21,14                                                     | 24,52                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015   | 18,13                                                     | 21,61                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016   | 15,80                                                     | 19,44                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017   | 15,64                                                     | 18,33                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 14,64                                                     | 17,61                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 14,40                                                     | 16,21                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 10,28                                                     | 12,27                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 11,82                                                     | 12,24                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 9,65                                                      | 11,91                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 9,93                                                      | 10,52                                                     |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## ANNEXE I (suite)

### Divulgateion de la performance (suite)

#### LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

| Classe d'Actions                     | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus faible | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus élevée |
|--------------------------------------|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| <b>Classe d'Actions H-N/A (CHF)</b>  |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2017    | 9,95                                                      | 10,92                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018    | 9,65                                                      | 11,15                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019    | 9,70                                                      | 10,71                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020    | 8,78                                                      | 10,73                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021    | 10,41                                                     | 10,89                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022    | 8,75                                                      | 10,68                                                     |
| Période close le 30 juin 2023        | 8,98                                                      | 9,53                                                      |
| <b>Classe d'Actions H-N/A (EUR)</b>  |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2017    | 11,53                                                     | 12,12                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018    | 10,67                                                     | 12,66                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019    | 10,69                                                     | 11,44                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020    | 8,63                                                      | 10,53                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021    | 10,23                                                     | 10,71                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022    | 8,64                                                      | 10,50                                                     |
| Période close le 30 juin 2023        | 8,96                                                      | 9,46                                                      |
| <b>Classe d'Actions H-N/D (EUR)</b>  |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014    | 12,22                                                     | 14,50                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015    | 9,77                                                      | 12,01                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016    | 9,27                                                      | 11,05                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017    | 9,74                                                      | 11,74                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018    | 9,07                                                      | 11,03                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019    | 8,93                                                      | 9,45                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2020    | 7,02                                                      | 8,38                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2021    | 8,06                                                      | 8,32                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2022    | 6,50                                                      | 8,07                                                      |
| Période close le 30 juin 2023        | 6,73                                                      | 7,06                                                      |
| <b>Classe d'Actions H-N1/A (EUR)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2019    | 10,97                                                     | 11,53                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020    | 8,70                                                      | 10,61                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021    | 10,32                                                     | 10,82                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022    | 8,74                                                      | 10,61                                                     |
| Période close le 30 juin 2023        | 9,08                                                      | 9,57                                                      |
| <b>Classe d'Actions H-R/A (EUR)</b>  |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014    | 12,62                                                     | 14,76                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015    | 10,40                                                     | 12,53                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016    | 9,97                                                      | 12,10                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017    | 10,85                                                     | 13,25                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018    | 11,57                                                     | 13,80                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019    | 11,59                                                     | 12,36                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020    | 9,32                                                      | 11,33                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021    | 10,99                                                     | 11,48                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022    | 9,18                                                      | 11,23                                                     |
| Période close le 30 juin 2023        | 9,50                                                      | 10,04                                                     |
| <b>Classe d'Actions H-R/A (SGD)</b>  |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014    | 7,42                                                      | 8,24                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2015    | 6,49                                                      | 7,62                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2016    | 6,11                                                      | 7,73                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2017    | 7,01                                                      | 8,09                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2018    | 7,44                                                      | 8,40                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2019    | 7,53                                                      | 8,45                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2020    | 9,66                                                      | 11,83                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021    | 11,49                                                     | 12,05                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022    | 9,83                                                      | 11,84                                                     |
| Période close le 30 juin 2023        | 10,28                                                     | 10,83                                                     |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## ANNEXE I (suite)

### Divulgateion de la performance (suite)

#### LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

| Classe d'Actions                      | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus faible | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus élevée |
|---------------------------------------|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| <b>Classe d'Actions H-R/D (SGD)</b>   |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014     | 7,43                                                      | 8,29                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2015     | 6,28                                                      | 7,50                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2016     | 5,86                                                      | 7,28                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2017     | 6,49                                                      | 7,37                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2018     | 6,33                                                      | 7,30                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2019     | 6,37                                                      | 6,97                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2020     | 7,92                                                      | 9,49                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2021     | 9,15                                                      | 9,49                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2022     | 7,53                                                      | 9,24                                                      |
| Période close le 30 juin 2023         | 7,76                                                      | 8,23                                                      |
| <b>Classe d'Actions H-RE/DM (AUD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2018     | 6,84                                                      | 7,29                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2019     | 6,82                                                      | 7,32                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2020     | 8,76                                                      | 10,49                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021     | 10,09                                                     | 10,47                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022     | 8,27                                                      | 10,21                                                     |
| Période close le 30 juin 2023         | 8,46                                                      | 9,00                                                      |
| <b>Classe d'Actions H-S/D (EUR)</b>   |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014     | 12,12                                                     | 14,38                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015     | 9,70                                                      | 11,91                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016     | 9,20                                                      | 10,97                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017     | 9,66                                                      | 11,66                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018     | 9,50                                                      | 11,55                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019     | 9,33                                                      | 9,89                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2020     | 7,34                                                      | 8,76                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2021     | 8,40                                                      | 8,69                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2022     | 6,76                                                      | 8,42                                                      |
| Période close le 30 juin 2023         | 6,90                                                      | 7,34                                                      |
| <b>Classe d'Actions I/A (EUR)</b>     |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014     | 29,08                                                     | 31,10                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015     | 27,97                                                     | 30,66                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016     | 26,73                                                     | 31,73                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017     | 31,11                                                     | 33,51                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018     | 32,15                                                     | 33,99                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019     | 32,35                                                     | 36,16                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020     | 28,65                                                     | 33,92                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021     | 30,62                                                     | 34,17                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022     | 31,45                                                     | 34,27                                                     |
| Période close le 30 juin 2023         | 31,17                                                     | 32,67                                                     |
| <b>Classe d'Actions I/A (USD)</b>     |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014     | 15,27                                                     | 16,33                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015     | 14,69                                                     | 16,10                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016     | 14,04                                                     | 16,67                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017     | 16,34                                                     | 17,60                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018     | 16,87                                                     | 17,85                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019     | 16,98                                                     | 18,98                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020     | 16,18                                                     | 20,00                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021     | 19,45                                                     | 20,46                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022     | 16,81                                                     | 20,13                                                     |
| Période close le 30 juin 2023         | 17,70                                                     | 18,58                                                     |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## ANNEXE I (suite)

### Divulgence de la performance (suite)

#### LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

| Classe d'Actions                   | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus faible | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus élevée |
|------------------------------------|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| <b>Classe d'Actions I/D (GBP)</b>  |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014  | 16,22                                                     | 17,26                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015  | 14,45                                                     | 16,19                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016  | 13,43                                                     | 15,62                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017  | 14,98                                                     | 15,85                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018  | 14,61                                                     | 15,81                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019  | 14,53                                                     | 15,81                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020  | 11,18                                                     | 12,15                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021  | 11,12                                                     | 11,95                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 11,06                                                     | 12,29                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 10,56                                                     | 11,54                                                     |
| <b>Classe d'Actions I/D (USD)</b>  |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014  | 13,36                                                     | 14,21                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015  | 11,85                                                     | 13,28                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016  | 10,97                                                     | 12,76                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017  | 12,23                                                     | 12,92                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018  | 11,88                                                     | 12,89                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019  | 11,85                                                     | 12,89                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020  | 10,90                                                     | 13,15                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021  | 12,67                                                     | 13,14                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 10,44                                                     | 12,79                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 10,82                                                     | 11,43                                                     |
| <b>Classe d'Actions I/DG (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 9,18                                                      | 10,17                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 9,48                                                      | 10,02                                                     |
| <b>Classe d'Actions N/A (EUR)</b>  |                                                           |                                                           |
| Période close le 30 juin 2023      | 9,86                                                      | 10,14                                                     |
| <b>Classe d'Actions N/A (USD)</b>  |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2018  | 9,59                                                      | 10,05                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019  | 9,65                                                      | 10,79                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020  | 9,19                                                      | 11,36                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021  | 11,05                                                     | 11,62                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 9,55                                                      | 11,44                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 10,06                                                     | 10,56                                                     |
| <b>Classe d'Actions N/DM (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2021  | 9,85                                                      | 10,05                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 8,07                                                      | 9,89                                                      |
| Période close le 30 juin 2023      | 8,35                                                      | 8,82                                                      |
| <b>Classe d'Actions N1/A (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2017  | 10,00                                                     | 10,05                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018  | 9,65                                                      | 10,20                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019  | 9,71                                                      | 10,86                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020  | 9,26                                                      | 11,46                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021  | 11,14                                                     | 11,73                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 9,65                                                      | 11,54                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 10,15                                                     | 10,66                                                     |
| <b>Classe d'Actions N1/D (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2018  | 9,29                                                      | 10,07                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019  | 9,26                                                      | 10,07                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020  | 8,52                                                      | 10,28                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021  | 9,91                                                      | 10,27                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 8,16                                                      | 10,00                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 8,45                                                      | 8,94                                                      |
| <b>Classe d'Actions R/A (EUR)</b>  |                                                           |                                                           |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## ANNEXE I (suite)

### Divulgateion de la performance (suite)

#### LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

| Classe d'Actions                  | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus faible | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus élevée |
|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2014 | 20,85                                                     | 22,24                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015 | 19,86                                                     | 21,84                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016 | 18,97                                                     | 22,45                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017 | 21,98                                                     | 23,59                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018 | 22,47                                                     | 23,88                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019 | 22,62                                                     | 25,15                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020 | 19,90                                                     | 23,58                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021 | 21,17                                                     | 23,54                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022 | 21,54                                                     | 23,51                                                     |
| Période close le 30 juin 2023     | 21,31                                                     | 22,37                                                     |
| <b>Classe d'Actions R/A (SGD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014 | 7,69                                                      | 8,07                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2015 | 7,20                                                      | 7,92                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2016 | 6,88                                                      | 8,14                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2017 | 7,97                                                      | 8,56                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2018 | 8,15                                                      | 8,66                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2019 | 8,21                                                      | 9,13                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2020 | 11,34                                                     | 12,93                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021 | 12,40                                                     | 13,25                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022 | 11,19                                                     | 12,98                                                     |
| Période close le 30 juin 2023     | 11,24                                                     | 11,57                                                     |
| <b>Classe d'Actions R/A (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014 | 14,29                                                     | 15,25                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015 | 13,62                                                     | 14,97                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016 | 13,00                                                     | 15,39                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017 | 15,06                                                     | 16,17                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018 | 15,41                                                     | 16,37                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019 | 15,50                                                     | 17,24                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020 | 14,68                                                     | 18,08                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021 | 17,56                                                     | 18,43                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022 | 15,06                                                     | 18,10                                                     |
| Période close le 30 juin 2023     | 15,83                                                     | 16,62                                                     |
| <b>Classe d'Actions R/D (EUR)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2022 | 9,18                                                      | 10,08                                                     |
| Période close le 30 juin 2023     | 8,94                                                      | 9,45                                                      |
| <b>Classe d'Actions R/D (GBP)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014 | 21,37                                                     | 22,73                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015 | 19,12                                                     | 21,43                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016 | 17,86                                                     | 20,76                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017 | 19,94                                                     | 21,07                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018 | 19,41                                                     | 21,03                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019 | 19,33                                                     | 21,00                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020 | 14,87                                                     | 16,39                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021 | 14,77                                                     | 15,87                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022 | 14,70                                                     | 16,32                                                     |
| Période close le 30 juin 2023     | 14,01                                                     | 15,32                                                     |
| <b>Classe d'Actions R/D (SGD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014 | 7,79                                                      | 8,28                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2015 | 6,80                                                      | 7,63                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2016 | 6,20                                                      | 7,21                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2017 | 6,90                                                      | 7,28                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2018 | 6,68                                                      | 7,27                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2019 | 6,68                                                      | 7,26                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2020 | 8,96                                                      | 10,21                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021 | 9,53                                                      | 10,06                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022 | 8,26                                                      | 9,77                                                      |
| Période close le 30 juin 2023     | 8,21                                                      | 8,45                                                      |

ANNEXE I (suite)

Divulgateion de la performance (suite)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

| Classe d'Actions                   | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus faible | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus élevée |
|------------------------------------|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| <b>Classe d'Actions R/D (USD)</b>  |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014  | 13,35                                                     | 14,20                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015  | 11,85                                                     | 13,28                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016  | 10,98                                                     | 12,76                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017  | 12,24                                                     | 12,94                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018  | 11,89                                                     | 12,91                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019  | 11,87                                                     | 12,90                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020  | 10,90                                                     | 13,15                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021  | 12,68                                                     | 13,16                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 10,45                                                     | 12,81                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 10,83                                                     | 11,45                                                     |
| <b>Classe d'Actions R/DG (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 9,20                                                      | 10,22                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 9,48                                                      | 10,04                                                     |
| <b>Classe d'Actions R/DM (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014  | 15,31                                                     | 16,28                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015  | 13,62                                                     | 15,32                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016  | 12,69                                                     | 14,71                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017  | 14,19                                                     | 14,95                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018  | 13,71                                                     | 14,97                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019  | 13,76                                                     | 14,87                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020  | 12,58                                                     | 15,18                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021  | 14,64                                                     | 15,21                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 12,13                                                     | 14,86                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 12,53                                                     | 13,25                                                     |
| <b>Classe d'Actions RE/A (EUR)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014  | 19,20                                                     | 20,45                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015  | 18,17                                                     | 20,02                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016  | 17,34                                                     | 20,49                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017  | 20,03                                                     | 21,45                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018  | 20,34                                                     | 21,68                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019  | 20,47                                                     | 22,68                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020  | 17,94                                                     | 21,25                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021  | 19,02                                                     | 21,09                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 19,23                                                     | 21,01                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 19,00                                                     | 19,96                                                     |
| <b>Classe d'Actions RE/A (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014  | 13,59                                                     | 14,48                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015  | 12,86                                                     | 14,17                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016  | 12,28                                                     | 14,50                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017  | 14,18                                                     | 15,19                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018  | 14,40                                                     | 15,35                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019  | 14,49                                                     | 16,06                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020  | 13,66                                                     | 16,78                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021  | 16,29                                                     | 17,06                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 13,89                                                     | 16,74                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 14,57                                                     | 15,31                                                     |
| <b>Classe d'Actions RE/D (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2018  | 9,85                                                      | 9,99                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2019  | 9,91                                                      | 11,00                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020  | 9,37                                                      | 11,51                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021  | 11,18                                                     | 11,72                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022  | 9,54                                                      | 11,50                                                     |
| Période close le 30 juin 2023      | 10,03                                                     | 10,53                                                     |

# NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

## ANNEXE I (suite)

### Divulgateion de la performance (suite)

#### LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

| Classe d'Actions                    | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus faible | Valeur d'inventaire<br>nette par Action la<br>plus élevée |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| <b>Classe d'Actions RE/DM (USD)</b> |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 9,85                                                      | 9,99                                                      |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 9,91                                                      | 11,01                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 9,36                                                      | 11,50                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 11,16                                                     | 11,71                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 9,54                                                      | 11,49                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 10,01                                                     | 10,52                                                     |
| <b>Classe d'Actions S/A (USD)</b>   |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014   | 14,93                                                     | 15,98                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015   | 14,42                                                     | 15,79                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016   | 13,79                                                     | 16,39                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017   | 16,09                                                     | 17,36                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 16,70                                                     | 17,63                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 16,81                                                     | 18,85                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 16,08                                                     | 19,92                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 19,37                                                     | 20,42                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 16,83                                                     | 20,10                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 17,73                                                     | 18,62                                                     |
| <b>Classe d'Actions S/D (GBP)</b>   |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014   | 16,09                                                     | 17,12                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015   | 14,33                                                     | 16,06                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016   | 13,32                                                     | 15,49                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017   | 14,85                                                     | 15,79                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 14,56                                                     | 15,75                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 14,47                                                     | 15,75                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 11,12                                                     | 12,28                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 11,07                                                     | 11,91                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 11,02                                                     | 12,26                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 10,58                                                     | 11,53                                                     |
| <b>Classe d'Actions S/D (USD)</b>   |                                                           |                                                           |
| Exercice clos le 31 décembre 2014   | 16,10                                                     | 17,14                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2015   | 14,34                                                     | 16,07                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2016   | 13,33                                                     | 15,50                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2017   | 14,85                                                     | 15,71                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2018   | 14,44                                                     | 15,67                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2019   | 14,39                                                     | 15,67                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2020   | 13,25                                                     | 15,98                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2021   | 15,40                                                     | 15,98                                                     |
| Exercice clos le 31 décembre 2022   | 12,68                                                     | 15,54                                                     |
| Période close le 30 juin 2023       | 13,15                                                     | 13,90                                                     |

**ANNEXE II**

**Règlement sur les opérations de financement sur titres**

Le Règlement sur les opérations de financement sur titres introduit des exigences de déclaration relatives aux opérations de financement de titres (« OFT ») et aux swaps de taux de rendement total (ou Total Return Rate Swaps).

Une Opération de financement sur titres (OFT) est définie comme suit par l'article 3 (11) de ce Règlement :

- contrat de rachat/mise en pension
- opération de prêt ou d'emprunt de titres ou de matières premières
- transaction d'achat-revente ou une transaction de vente-rachat
- opération de prêt avec appel de marge

Au 30 juin 2023, le Fonds ne détenait aucun instrument entrant dans le champ d'application du Règlement sur les OFT.