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 2024

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**

Organisation 3

Présentation de la Société 5

Rapports du Gestionnaire Financier 17

État condensé de la situation financière 24

Compte de résultat global condensé 26

État condensé des variations de l'actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables 28

État condensé des flux de trésorerie 30

Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2024 32

Calendrier des investissements
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Multisector Income Fund 60
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles High Income Fund 78
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund 92
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund 105
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Euro High Yield Fund 107
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Euro Credit Fund 115
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund 126

Calendrier des évolutions du portefeuille
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Multisector Income Fund 137
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles High Income Fund 139
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund 141
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund 143
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Euro High Yield Fund 145
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Euro Credit Fund 147
Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund 149

Annexe I - Divulgation de la performance 151

Annexe II - Règlement sur les opérations de financement sur titres 158

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 2023 – Déclaration de gouvernance d'entreprise composition du Conseil d'Administration

** Administrateur indépendant

*** 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 Promoteur (jusqu'au 31 mars 2024)

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

Société de gestion et Promoteur

Natixis Investment Managers S.A.
(jusqu'au 31 mars 2024)
2 rue Jean Monnet
L-2180 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Natixis Investment Managers
International *(à compter du 1er avril 2024)*
43, avenue Pierre Mendès-France
75013 Paris
France

Distributeur

Natixis Investment Managers
International
43, avenue Pierre Mendès-France
75013 Paris
France

Gestionnaire financier

Loomis, Sayles & Company, L.P. [(1)]
One Financial Center
Boston
Massachusetts 02111
États-Unis

Loomis Sayles (Netherlands) B.V. [(2)]
Stadsplateau 7
3521 AZ Utrecht
Pays-Bas

Conseiller juridique de la Société

William Fry LLP
2 Grand Canal Square
Dublin
D02 A342
Irlande

[(1)] *Jusqu'au 31 mars 2024 pour les Fonds Loomis Sayles Euro High Yield Fund, Loomis Sayles Euro Credit Fund et Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund.*

[(2)] *À compter du 1er avril 2024 pour les Fonds Loomis Sayles Euro High Yield Fund, Loomis Sayles Euro Credit Fund et Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund.*

Organisation (suite)

Secrétaire

Wilton Secretarial Limited
6th Floor
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.

Au 30 juin 2024, six** Fonds (les « Fonds ») présentaient 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 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 Fund ») 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

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.
** Le Fonds Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund a été fermé aux souscriptions le 5 mars 2024.
*** Autorisé à Hong Kong et disponible au public à Hong Kong.
**** Non autorisé à Hong Kong et non disponible au public à Hong Kong.

Présentation de la Société (suite)

Au 30 juin 2024, 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 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-I/A (CHF)	Classe d'Actions G/A (EUR)	Classe d'Actions G/A (EUR)
Classe d'Actions C/D (USD)	Classe d'Actions C/D (USD)	Classe d'Actions C/D (USD)	Classe d'Actions H-I/A (GBP)	Classe d'Actions H-I/A (CHF)	Classe d'Actions H-I/A (CHF)
Classe d'Actions CT/A (USD)	Classe d'Actions CT/DM (USD)	Classe d'Actions F/D (USD)	Classe d'Actions H-I/D (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 G/A (EUR)	Classe d'Actions H-N/A (CHF)	Classe d'Actions H-I/A (USD)	Classe d'Actions H-I/D (GBP)
Classe d'Actions CT/DM (USD)	Classe d'Actions H-I/A (CHF)	Classe d'Actions H-F/A (GBP)	Classe d'Actions H-N/A (GBP)	Classe d'Actions H-I/D (GBP)	Classe d'Actions H-N/A (CHF)
Classe d'Actions CW/A (EUR)	Classe d'Actions H-I/A (EUR)	Classe d'Actions H-F/D (GBP)	Classe d'Actions H-N/D (GBP)	Classe d'Actions H-N/A (CHF)	Classe d'Actions H-N/A (GBP)
Classe d'Actions F/A (USD)	Classe d'Actions H-I/A (SGD)	Classe d'Actions H-I/A (AUD)	Classe d'Actions H-R/A (CHF)	Classe d'Actions H-N/A (GBP)	Classe d'Actions H-N/D (GBP)
Classe d'Actions F/DM (USD)	Classe d'Actions H-I/D (EUR)	Classe d'Actions H-I/A (EUR)	Classe d'Actions H-RE/A (CHF)	Classe d'Actions H-N/A (USD)	Classe d'Actions H-R/A (CHF)
Classe d'Actions H-CW/A (EUR)	Classe d'Actions H-I/D (GBP)	Classe d'Actions H-I/A (SEK)	Classe d'Actions H-S/A (CHF)	Classe d'Actions H-N/D (GBP)	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/A (SGD)	Classe d'Actions H-S/A (GBP)	Classe d'Actions H-R/A (CHF)	Classe d'Actions H-S/A (CHF)
Classe d'Actions H-I/A (SEK)	Classe d'Actions H-N/A (CHF)	Classe d'Actions H-I/A (USD)	Classe d'Actions H-S/D (GBP)	Classe d'Actions H-RE/A (CHF)	Classe d'Actions H-S/A (GBP)
Classe d'Actions H-I/A (SGD)	Classe d'Actions H-N/A (EUR)	Classe d'Actions H-I/D (EUR)	Classe d'Actions H-S2/A (CHF)	Classe d'Actions H-S/A (CHF)	Classe d'Actions H-S/D (GBP)
Classe d'Actions H-I/D (EUR)	Classe d'Actions H-N/A (GBP)	Classe d'Actions H-I/D (GBP)	Classe d'Actions H-S2/A (GBP)	Classe d'Actions H-S/A (GBP)	Classe d'Actions H-S2/A (CHF)
Classe d'Actions H-I/D (GBP)	Classe d'Actions H-N/D (CHF)	Classe d'Actions H-I/D (SGD)	Classe d'Actions H-S2/D (GBP)	Classe d'Actions H-S/A (USD)	Classe d'Actions H-S2/A (GBP)
Classe d'Actions H-I/D (SEK)	Classe d'Actions H-N/D (EUR)	Classe d'Actions H-N/A (CHF)	Classe d'Actions I/A (EUR)	Classe d'Actions H-S/D (GBP)	Classe d'Actions H-S2/D (GBP)
Classe d'Actions H-I/D (SGD)	Classe d'Actions H-N/D (GBP)	Classe d'Actions H-N/A (EUR)	Classe d'Actions I/D (EUR)	Classe d'Actions H-S2/A (CHF)	Classe d'Actions I/A (EUR)
Classe d'Actions H-I/DG (SGD)	Classe d'Actions H-N/DM (GBP)	Classe d'Actions H-N/A (GBP)	Classe d'Actions N/A (EUR)	Classe d'Actions H-S2/A (GBP)	Classe d'Actions I/D (EUR)
Classe d'Actions H-N/A (CHF)	Classe d'Actions H-N1/A (CHF)	Classe d'Actions H-N/D (CHF)	Classe d'Actions N/D (EUR)	Classe d'Actions H-S2/A (USD)	Classe d'Actions N/A (EUR)
Classe d'Actions H-N/A (EUR)	Classe d'Actions H-N1/A (EUR)	Classe d'Actions H-N/D (EUR)	Classe d'Actions Q/A (EUR)	Classe d'Actions H-S2/D (GBP)	Classe d'Actions N/D (EUR)
Classe d'Actions H-N/A (GBP)	Classe d'Actions H-R/A (EUR)	Classe d'Actions H-N/D (GBP)	Classe d'Actions R/A (EUR)	Classe d'Actions I/A (EUR)	Classe d'Actions Q/A (EUR)
Classe d'Actions H-N/D (CHF)	Classe d'Actions H-R/A (SGD)	Classe d'Actions H-N/DM (GBP)	Classe d'Actions R/D (EUR)	Classe d'Actions I/D (EUR)	Classe d'Actions R/A (EUR)
Classe d'Actions H-N/D (EUR)	Classe d'Actions H-R/D (EUR)	Classe d'Actions H-R/A (EUR)	Classe d'Actions RE/A (EUR)	Classe d'Actions N/A (EUR)	Classe d'Actions R/D (EUR)
Classe d'Actions H-N/D (GBP)	Classe d'Actions H-R/D (SGD)	Classe d'Actions H-R/A (SEK)	Classe d'Actions RE/D (EUR)	Classe d'Actions N/D (EUR)	Classe d'Actions RE/A (EUR)
Classe d'Actions H-N/DM (GBP)	Classe d'Actions H-RE/A (EUR)	Classe d'Actions H-R/A (SGD)	Classe d'Actions S/A (EUR)	Classe d'Actions Q/A (EUR)	Classe d'Actions RE/D (EUR)
Classe d'Actions H-N1/A (EUR)	Classe d'Actions H-RE/D (EUR)	Classe d'Actions H-R/D (EUR)	Classe d'Actions S/D (EUR)	Classe d'Actions R/A (EUR)	Classe d'Actions S/A (EUR)
Classe d'Actions H-R/A (EUR)	Classe d'Actions H-S/A (CHF)	Classe d'Actions H-R/D (SGD)	Classe d'Actions S2/A (EUR)	Classe d'Actions R/D (EUR)	Classe d'Actions S/D (EUR)
Classe d'Actions H-R/A (SEK)	Classe d'Actions H-S/A (EUR)	Classe d'Actions H-RE/A (EUR)	Classe d'Actions S2/D (EUR)	Classe d'Actions RE/A (EUR)	Classe d'Actions S1/A (EUR)
Classe d'Actions H-R/A (SGD)	Classe d'Actions H-S/A (SGD)	Classe d'Actions H-RE/D (EUR)		Classe d'Actions RE/D (EUR)	Classe d'Actions S1/D (EUR)

Présentation de la Société (suite)

Loomis Sayles Multisector Income Fund	Loomis Sayles High Income Fund	Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund	Loomis Sayles Euro Credit Fund	Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund
Classe d'Actions H-R/D (EUR)	Classe d'Actions H-S/D (EUR)	Classe d'Actions H-S/A (AUD)	Classe d'Actions S/A (EUR)	Classe d'Actions S2/A (EUR)
Classe d'Actions H-R/D (SEK)	Classe d'Actions H-S/D (GBP)	Classe d'Actions H-S/A (EUR)	Classe d'Actions S/D (EUR)	Classe d'Actions S2/D (EUR)
Classe d'Actions H-R/D (SGD)	Classe d'Actions I/A (EUR)	Classe d'Actions H-S/A (NOK)	Classe d'Actions S1/A (EUR)	Classe d'Actions S3/A (EUR)
Classe d'Actions H-R/DG (SGD)	Classe d'Actions I/A (SGD)	Classe d'Actions H-S/A (SEK)	Classe d'Actions S1/D (EUR)	Classe d'Actions S3/D (EUR)
Classe d'Actions H-R/DM (AUD)	Classe d'Actions I/A (USD)	Classe d'Actions H-S/A (SGD)	Classe d'Actions S2/A (EUR)	
Classe d'Actions H-R/DM (SGD)	Classe d'Actions I/D (GBP)	Classe d'Actions H-S/A (USD)	Classe d'Actions S2/D (EUR)	
Classe d'Actions H-RE/A (EUR)	Classe d'Actions I/D (JPY)	Classe d'Actions H-S/D (EUR)	Classe d'Actions S3/A (EUR)	
Classe d'Actions H-RE/D (EUR)	Classe d'Actions I/D (SGD)	Classe d'Actions H-S/D (GBP)	Classe d'Actions S3/D (EUR)	
Classe d'Actions H-RE/DM (AUD)	Classe d'Actions I/D (USD)	Classe d'Actions H-S/D (SGD)		
Classe d'Actions H-S/A (EUR)	Classe d'Actions N/A (EUR)	Classe d'Actions I/A (EUR)		
Classe d'Actions H-S/A (SEK)	Classe d'Actions N/A (USD)	Classe d'Actions I/A (SGD)		
Classe d'Actions H-S/A (SGD)	Classe d'Actions N/DM (USD)	Classe d'Actions I/A (USD)		
Classe d'Actions H-S/D (EUR)	Classe d'Actions N1/A (USD)	Classe d'Actions I/D (GBP)		
Classe d'Actions H-S/D (GBP)	Classe d'Actions Q/A (USD)	Classe d'Actions I/D (SGD)		
Classe d'Actions H-S/D (SEK)	Classe d'Actions R/A (EUR)	Classe d'Actions I/D (USD)		
Classe d'Actions I/A (EUR)	Classe d'Actions R/A (SGD)	Classe d'Actions N/A (EUR)		
Classe d'Actions I/A (SGD)	Classe d'Actions R/A (USD)	Classe d'Actions N/A (USD)		
Classe d'Actions I/A (USD)	Classe d'Actions R/D (EUR)	Classe d'Actions N/DM (USD)		
Classe d'Actions I/D (GBP)	Classe d'Actions R/D (GBP)	Classe d'Actions N1/A (EUR)		
Classe d'Actions I/D (SGD)	Classe d'Actions R/D (SGD)	Classe d'Actions N1/A (USD)		
Classe d'Actions I/D (USD)	Classe d'Actions R/D (USD)	Classe d'Actions R/A (EUR)		
Classe d'Actions I/DG (HKD)	Classe d'Actions R/DM (USD)	Classe d'Actions R/A (SGD)		
Classe d'Actions I/DG (USD)	Classe d'Actions RE/A (EUR)	Classe d'Actions R/A (USD)		
Classe d'Actions J/DM (USD)	Classe d'Actions RE/A (USD)	Classe d'Actions R/D (EUR)		
Classe d'Actions N/A (EUR)	Classe d'Actions RE/D (EUR)	Classe d'Actions R/D (GBP)		
Classe d'Actions N/A (USD)	Classe d'Actions RE/D (USD)	Classe d'Actions R/D (SGD)		
Classe d'Actions N/DM (USD)	Classe d'Actions S/A (EUR)	Classe d'Actions R/D (USD)		
Classe d'Actions N1/A (EUR)	Classe d'Actions S/A (SGD)	Classe d'Actions RE/A (EUR)		
Classe d'Actions N1/A (USD)	Classe d'Actions S/A (USD)	Classe d'Actions RE/A (USD)		
Classe d'Actions N1/D (USD)	Classe d'Actions S/D (GBP)	Classe d'Actions RE/D (EUR)		

Présentation de la Société (suite)

Loomis Sayles Multisector Income Fund	Loomis Sayles High Income Fund	Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund
Classe d'Actions R/A (EUR)	Classe d'Actions S/D (JPY)	Classe d'Actions RE/D (USD)
Classe d'Actions R/A (SGD)	Classe d'Actions S/D (SGD)	Classe d'Actions RE/DM (USD)
Classe d'Actions R/A (USD)	Classe d'Actions S/D (USD)	Classe d'Actions S/A (EUR)
Classe d'Actions R/D (EUR)		Classe d'Actions S/A (SGD)
Classe d'Actions R/D (GBP)		Classe d'Actions S/A (USD)
Classe d'Actions R/D (SGD)		Classe d'Actions S/D (GBP)
Classe d'Actions R/D (USD)		Classe d'Actions S/D (SGD)
Classe d'Actions R/DG (HKD)		Classe d'Actions S/D (USD)
Classe d'Actions R/DG (USD)		
Classe d'Actions R/DM (USD)		
Classe d'Actions RE/A (EUR)		
Classe d'Actions RE/A (USD)		
Classe d'Actions RE/D (EUR)		
Classe d'Actions RE/D (USD)		
Classe d'Actions RE/DM (USD)		
Classe d'Actions S/A (EUR)		
Classe d'Actions S/A (SGD)		
Classe d'Actions S/A (USD)		
Classe d'Actions S/D (GBP)		
Classe d'Actions S/D (SGD)		
Classe d'Actions S/D (USD)		

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 Fonds Loomis Sayles Multisector Income Fund, Loomis Sayles High Income Fund et Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund est actuellement le dollar américain (USD).

La monnaie fonctionnelle 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).

Jusqu'à sa clôture le 5 mars 2024, la monnaie fonctionnelle du Fonds Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund était le dollar américain (USD).

Les classes d'actions de chaque Fonds étaient libellées comme suit au 30 juin 2024 :

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 G, 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 S1, Classe S2 et Classe S3
Livre sterling (GBP)	Classe H-F, 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-R, Classe H-RE et Classe H-S

Au 30 juin 2024, 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* (actuellement en liquidation)

L'objectif d'investissement du Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (le « Fonds ») consistait 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.

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

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) ;

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). 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.

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.

Présentation de la Société (suite)

Objectifs et politiques d'investissement (suite)

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). 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 »).

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).

Présentation de la Société (suite)

Objectifs et politiques d'investissement (suite)

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). 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.

Présentation de la Société (suite)

Objectifs et politiques d'investissement (suite)

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 3 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 3.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Rapports du Gestionnaire Financier

Loomis Sayles Multisector Income Fund

Performance sur 6 mois	
Loomis Sayles Multisector Income Fund (Classe I/D (USD))*	**0,87 %**
Bloomberg Barclays U.S. Government/Credit Bond Index (Total Return)	**-0,68 %**

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 2024.

- Le Fonds a surperformé son Indice de Référence, principalement en raison de la sélection des titres.
- La sélection des titres au sein des crédits aux entreprises de qualité investment grade a porté ses fruits, notamment dans le secteur de la consommation cyclique.
- Le crédit aux entreprises des marchés émergents a contribué à la performance, en particulier les titres à forte conviction dans le secteur de l'industrie de base.
- Les titres convertibles ont contribué à la performance, sous l'impulsion de certains titres dans les secteurs des communications et de la consommation cyclique.
- Le haut rendement a contribué à la performance, en particulier au sein des secteurs de la consommation non cyclique et de la banque.
- La faible exposition aux actions a 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.
22 août 2024

Loomis Sayles High Income Fund

Performance sur 6 mois	
Loomis Sayles High Income Fund (Classe I/D (USD))*	**1,65 %**
Bloomberg Barclays U.S. Corporate High-Yield Bond Index (Total Return)	**2,58 %**

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 2024.

- Le Fonds a sous-performé son Indice de Référence, principalement en raison de la sélection des titres.
- La sélection des titres dans les crédits aux entreprises à haut rendement a été la principale source de sous-performance, notamment dans le secteur des communications.
- L'allocation à des positions défensives de type réserves et les bons du Trésor américain ont nui à la performance.
- Les titres convertibles ont contribué à la performance, en particulier les titres à forte conviction dans le secteur des communications.
- Le crédit des marchés émergents a contribué à la performance, en particulier au sein du secteur de la consommation non cyclique.

* 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.
22 août 2024

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

Performance sur 6 mois	
Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (Classe I/D (USD))*	**-4,14 %**
Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (Total Return)	**-3,16 %**

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 sous-performé son Indice de Référence au cours du semestre clos le 30 juin 2024.

- Le Fonds a sous-performé son Indice de Référence, principalement en raison de l'allocation en devises, notamment de la sous-pondération du réal brésilien et de la surpondération du yen japonais.
- Le positionnement sur la courbe des taux et en termes de duration a pesé sur la performance relative. La surpondération de la duration aux États-Unis a nui à la performance, les rendements américains ayant fortement progressé pendant la majeure partie de la période, mais ce mauvais résultat a été compensé par la sous-pondération de la duration au Japon, qui a contribué à la performance.
- L'allocation aux crédits aux entreprises de qualité investment grade a contribué de manière positive aux rendements excédentaires, la légère surpondération du bêta de crédit au cours de la période ayant porté ses fruits dans l'environnement de resserrement des spreads, favorisé par les secteurs de la banque, de l'assurance et de l'énergie.
- L'allocation du Fonds aux bons du Trésor mondiaux a pesé sur les rendements excédentaires, en raison de la sous-pondération des obligations d'État italiennes.

* 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.
22 août 2024

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund*

Performance sur 6 mois	
Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (Classe I/A (USD))	**S/O**
Pas d'Indice de Référence	

* Le Fonds ayant été clôturé le 19 mars 2024, il ne dispose pas de données de performance pour la période complète.

Loomis, Sayles & Company, L.P.
22 août 2024

Loomis Sayles Euro High Yield Fund

Performance sur 6 mois	
Loomis Sayles Euro High Yield Fund (Classe I/A (EUR))*	**2,90 %**
85 % ICE BofA BB Euro High Yield Non-Financial Constrained Index (Total Return), 15 % ICE BofA Euro Subordinated Financial Index (Total Return)	**3,02 %**

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 sous-performé son Indice de Référence au cours du semestre clos le 30 juin 2024.

- Le Fonds a sous-performé son Indice de Référence.
- La sélection des titres a contribué de manière positive à la performance.
- Les secteurs qui ont le plus contribué à la performance ont été les banques, l'automobile et les pièces détachées, ainsi que les télécommunications.
- Les secteurs qui ont le plus pesé sur la performance ont été les services aux collectivités, les services financiers, ainsi que le pétrole et le gaz.
- Aroundtown SA, CPI Property Group SA et Poste Italiane SpA ont apporté les principales contributions aux rendements relatifs.
- Pemex Project Funding Master Trust (exclu), British American Tobacco PLC et Fosun International Ltd 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.
22 août 2024

Loomis Sayles Euro Credit Fund

Performance sur 6 mois	
Loomis Sayles Euro Credit Fund (Classe I/A (EUR))*	**0,64 %**
iBoxx Euro Corporates Overall Index (Total Return)	**0,44 %**

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 2024.

- 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'immobilier ainsi que les biens et services industriels.
- Les secteurs qui ont le plus pesé sur la performance ont été les articles personnels et ménagers, les médias, ainsi que les ressources de base.
- Aroundtown SA, KBC Group NV et TenneT Holding BV ont apporté les principales contributions aux rendements relatifs.
- BPCE SA (exclu), Mizuho Financial Group Inc et Assicurazioni Generali SpA 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.
22 août 2024

Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund

Performance sur 6 mois	
Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (Classe I/A (EUR))*	**0,53 %**
iBoxx Euro Corporates Overall Index (Total Return)	**0,44 %**

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 2024.

- 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'immobilier et les télécommunications.
- 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 l'automobile et les pièces détachées.
- Aroundtown SA, KBC Group NV et TenneT Holding BV ont apporté les principales contributions aux rendements relatifs.
- Volkswagen AG (exclu), Enel SpA (exclu) et BPCE SA (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.
22 août 2024

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

État condensé de la situation financière

Au 30 juin 2024

	Notes	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 31 décembre 2023	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 31 décembre 2023	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 31 décembre 2023	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND* USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 31 décembre 2023
ACTIF CIRCULANT									
Avoirs en banque	1(b)	8 203 586	10 585 041	105 585	92 201	5 579 317	299 896	238 721	2 510 298
Dépôts auprès du courtier pour les garanties sur instruments dérivés		–	–	6 606	–	482 987	206 185	–	3 263 956
Créances		6 987 155	9 052 525	126 239	107 358	2 501 527	201 479	51	97 006
Investissements : Actif financier à sa juste valeur par le biais du compte de résultat		501 551 400	541 010 027	6 253 532	6 760 625	231 163 156	15 536 180	135 491	23 916 660
Total de l'actif		516 742 141	560 647 593	6 491 962	6 960 184	239 726 987	16 243 740	374 263	29 787 920
PASSIF CIRCULANT									
Dépôts dus au courtier pour les garanties sur instruments dérivés		(833 670)	(3 374 858)	–	–	–	–	–	–
Dettes - (montants arrivant à échéance dans l'exercice financier)		(4 704 143)	(2 886 519)	(176 072)	(109 009)	(1 561 358)	(139 011)	(374 263)	(96 349)
Investissements : Passif financier à sa juste valeur par le biais du compte de résultat		(1 052 565)	(5 208 855)	–	(46 208)	(756 346)	(85 932)	–	(1 532 955)
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES		510 151 763	549 177 361	6 315 890	6 804 967	237 409 283	16 018 797	–	28 158 616
Au 31 décembre 2023		549 177 361	549 177 361	6 804 967	6 804 967	16 018 797	16 018 797	28 158 616	28 158 616
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

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

Les notes des pages 32 à 59 font partie intégrante des présents états financiers condensés

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

État condensé de la situation financière (suite)

Au 30 juin 2024 (suite)

	Notes	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 31 décembre 2023	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 31 décembre 2023	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 31 décembre 2023	TOTAL USD 30 juin 2024	TOTAL USD 31 décembre 2023
ACTIF CIRCULANT									
Avoirs en banque	1(b)	636 695	1 339 347	4 635 157	1 530 215	19 684 245	5 902 648	40 873 906	23 177 658
Dépôts auprès du courtier pour les garanties sur instruments dérivés		32 775	28 629	259 377	162 260	783 865	605 842	1 642 814	4 350 250
Créances		1 731 360	494 862	2 950 165	2 251 099	18 152 930	12 871 251	34 087 799	26 709 921
Investissements : Actif financier à sa juste valeur par le biais du compte de résultat		33 502 190	31 115 070	138 427 082	121 549 862	842 268 702	842 724 263	1 826 070 258	1 686 780 166
Total de l'actif		35 903 020	32 977 908	146 271 781	125 493 436	880 889 742	862 104 004	1 902 674 777	1 741 017 995
PASSIF CIRCULANT									
Dépôts dus au courtier pour les garanties sur instruments dérivés		–	–	–	–	–	–	(833 670)	(3 374 858)
Dettes - (montants arrivant à échéance dans l'exercice financier)		(1 815 383)	(103 489)	(3 095 586)	(526 009)	(13 930 917)	(3 098 626)	(27 009 627)	(7 349 160)
Investissements : Passif financier à sa juste valeur par le biais du compte de résultat		(33)	–	(164 280)	(173 427)	(923 670)	(1 293 600)	(2 974 957)	(8 494 501)
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES		34 087 604	32 874 419	143 011 915	124 794 000	866 035 155	857 711 778	1 871 856 523	1 721 799 476
Au 31 décembre 2023		32 874 419	32 874 419	124 794 000	124 794 000	857 711 778	857 711 778	1 721 799 476	1 721 799 476
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

Les notes des pages 32 à 59 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 2024

	Notes	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND* USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 30 juin 2023
Produit des investissements		15 510 260	12 821 631	218 617	231 680	2 930 387	577 580	296 671	504 884
Plus-value (moins-value) nette réalisée sur l'actif et le passif financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat		(10 983 536)	4 763 123	(167 495)	118 003	(2 197 621)	1 352 420	(242 670)	1 093 253
Total du produit des investissements		4 526 724	17 584 754	51 122	349 683	732 766	1 930 000	54 001	1 598 137
Charges d'exploitation	3	(3 156 361)	(3 681 968)	(101 473)	(102 515)	(855 515)	(209 179)	(226 274)	(56 152)
Remboursement des charges	3	112 475	128 990	54 253	48 262	633 673	28 143	2 768	–
Charges d'exploitation nettes		(3 043 886)	(3 552 978)	(47 220)	(54 253)	(221 842)	(181 036)	(223 506)	(56 152)
Résultat net issu de l'exploitation avant charges financières		1 482 838	14 031 776	3 902	295 430	510 924	1 748 964	(169 505)	1 541 985
Charges financières									
Distributions aux Détenteurs d'actions participantes remboursables		(2 608 568)	(1 965 848)	(83 274)	(98 911)	(50 191)	(160 913)	–	–
Intérêts de découvert		–	(2 623)	–	–	–	(367)	–	–
Total des charges financières		(2 608 568)	(1 968 471)	(83 274)	(98 911)	(50 191)	(161 280)	–	–
Bénéfice avant impôt		(1 125 730)	12 063 305	(79 372)	196 519	460 733	1 587 684	(169 505)	1 541 985
Impôt retenu à la source		(65 361)	(104 412)	(2 227)	(1 985)	(734)	(4 283)	(816)	(34 903)
(Diminution)/Augmentation nette des actifs nets attribuables aux détenteurs d'actions participantes remboursables résultant de l'exploitation		(1 191 091)	11 958 893	(81 599)	194 534	459 999	1 583 401	(170 321)	1 507 082

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.

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Compte de résultat global condensé (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2024 (suite)

	Notes	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2023	TOTAL USD 30 juin 2024	TOTAL USD 30 juin 2023
Produit des investissements		783 235	632 729	2 362 993	1 620 595	15 441 874	7 503 126	38 877 734	24 780 062
Plus-value (moins-value) nette réalisée sur l'actif et le passif financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat		292 509	588 391	(1 118 806)	1 301 199	(8 626 731)	3 177 936	(23 722 605)	12 855 470
Total du produit des investissements		1 075 744	1 221 120	1 244 187	2 921 794	6 815 143	10 681 062	15 155 129	37 635 532
Charges d'exploitation	3	(134 136)	(100 853)	(555 201)	(409 927)	(3 339 575)	(1 570 265)	(8 657 609)	(6 320 232)
Remboursement des charges	3	68 479	46 171	349 385	271 391	2 024 024	949 849	3 420 262	1 588 140
Charges d'exploitation nettes		(65 657)	(54 682)	(205 816)	(138 536)	(1 315 551)	(620 416)	(5 237 347)	(4 732 092)
Produit d'exploitation net avant charges financières		1 010 087	1 166 438	1 038 371	2 783 258	5 499 592	10 060 646	9 917 782	32 903 440
Charges financières									
Distributions aux Détenteurs d'actions participantes remboursables		–	–	(77 227)	–	(720)	–	(2 825 573)	(2 225 672)
Intérêts de découvert		–	–	–	–	–	–	–	(2 992)
Total des charges financières		–	–	(77 227)	–	(720)	–	(2 825 573)	(2 228 664)
Bénéfice avant impôt		1 010 087	1 166 438	961 144	2 783 258	5 498 872	10 060 646	7 092 209	30 674 776
Impôt retenu à la source		(3 486)	(1 120)	(21 791)	(3 280)	(120 320)	(23 881)	(225 182)	(176 437)
Augmentation nette de l'actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables résultant de l'exploitation		1 006 601	1 165 318	939 353	2 779 978	5 378 552	10 036 765	6 867 027	30 498 339

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.

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 2024

	Notes	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND* USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 30 juin 2023
Actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables au 1er janvier 2024 (2023)		549 177 361	592 786 282	6 804 967	8 627 135	16 018 797	58 732 256	28 158 616	25 045 099
(Diminution)/Augmentation nette des actifs nets attribuables aux détenteurs d'actions participantes remboursables résultant de l'exploitation		(1 191 091)	11 958 893	(81 599)	194 534	459 999	1 583 401	(170 321)	1 507 082
Opérations sur actions									
Produit de la vente des actions participantes remboursables émises[1]	2	57 409 166	57 719 060	118 975	68 780	233 588 027	7 858 394	–	–
Produit du rachat des actions participantes remboursables[2]	2	(95 243 673)	(96 467 327)	(526 453)	(1 847 911)	(12 657 540)	(29 582 343)	(27 988 295)	(80 065)
Hausse/(baisse) totale de l'actif net résultant des opérations sur actions		(37 834 507)	(38 748 267)	(407 478)	(1 779 131)	220 930 487	(21 723 949)	(27 988 295)	(80 065)
Hausse/(baisse) totale de l'actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables		(39 025 598)	(26 789 374)	(489 077)	(1 584 597)	221 390 486	(20 140 548)	(28 158 616)	1 427 017
Écart de conversion		–	–	–	–	–	–	–	–
Actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables au 30 juin 2024 (2023)		510 151 763	565 996 908	6 315 890	7 042 538	237 409 283	38 591 708	–	26 472 116

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

[1] Comprend des distributions réinvesties de 768 996 USD sur le Loomis Sayles Multisector Income Fund (30 juin 2023 : 487 238 USD), 28 242 USD sur le Loomis Sayles High Income Fund (30 juin 2023 : 38 864 USD), 38 451 USD sur le Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (30 juin 2023 : 11 494 USD), 0 USD sur le Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (30 juin 2023 : 0 USD), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro High Yield Fund (30 juin 2023 : 0 EUR), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro Credit Fund (30 juin 2023 : 0 EUR) et 0 EUR sur le Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (30 juin 2023 : 0 EUR).

[2] 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 2023 : 0 USD), 3 640 USD sur le Loomis Sayles High Income Fund (30 juin 2023 : 8 180 USD), 0 USD sur le Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (30 juin 2023 : 50 907 USD), 0 USD sur le Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (30 juin 2023 : 0 USD), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro High Yield Fund (30 juin 2023 : 0 EUR), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro Credit Fund (30 juin 2023 : 0 EUR) et 0 EUR sur le Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (30 juin 2023 : 0 EUR).

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

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

Pour le semestre clos le 30 juin 2024 (suite)

	Notes	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2023	TOTAL USD 30 juin 2024	TOTAL USD 30 juin 2023
Actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables au 1er janvier 2024 (2023)		32 874 419	27 441 986	124 794 000	101 662 770	857 711 778	397 430 952	1 721 799 476	1 247 136 006
Augmentation nette de l'actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables résultant de l'exploitation		1 006 601	1 165 318	939 353	2 779 978	5 378 552	10 036 765	6 867 027	30 498 339
Opérations sur actions									
Produit de la vente des actions participantes remboursables émises[1]	2	13 418 389	2 986 294	32 298 931	28 254 913	360 651 792	181 212 396	726 642 263	297 433 115
Produit du rachat des actions participantes remboursables[2]	2	(13 211 805)	(1 476 235)	(15 020 369)	(22 370 861)	(357 706 967)	(51 919 775)	(550 046 235)	(210 639 302)
Hausse totale de l'actif net résultant des opérations sur actions		206 584	1 510 059	17 278 562	5 884 052	2 944 825	129 292 621	176 596 028	86 793 813
Hausse totale de l'actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables		1 213 185	2 675 377	18 217 915	8 664 030	8 323 377	139 329 386	183 463 055	117 292 152
Écart de conversion		–	–	–	–	–	–	(33 406 008)	12 505 223
Actif net attribuable aux détenteurs d'actions participantes remboursables au 30 juin 2024 (2023)		34 087 604	30 117 363	143 011 915	110 326 800	866 035 155	536 760 338	1 871 856 523	1 376 933 381

[1] Comprend des distributions réinvesties de 768 996 USD sur le Loomis Sayles Multisector Income Fund (30 juin 2023 : 487 238 USD), 28 242 USD sur le Loomis Sayles High Income Fund (30 juin 2023 : 38 864 USD), 38 451 USD sur le Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (30 juin 2023 : 11 494 USD), 0 USD sur le Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (30 juin 2023 : 0 USD), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro High Yield Fund (30 juin 2023 : 0 EUR), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro Credit Fund (30 juin 2023 : 0 EUR) et 0 EUR sur le Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (30 juin 2023 : 0 EUR).

[2] 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 2023 : 0 USD), 3 640 USD sur le Loomis Sayles High Income Fund (30 juin 2023 : 8 180 USD), 0 USD sur le Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (30 juin 2023 : 50 907 USD), 0 USD sur le Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (30 juin 2023 : 0 USD), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro High Yield Fund (30 juin 2023 : 0 EUR), 0 EUR sur le Loomis Sayles Euro Credit Fund (30 juin 2023 : 0 EUR) et 0 EUR sur le Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (30 juin 2023 : 0 EUR).

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

État condensé des flux de trésorerie

Pour le semestre clos le 30 juin 2024

	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND* USD 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 30 juin 2023
Flux de trésorerie résultant des activités d'exploitation								
Achat d'actif financier et règlement de passif financier	(181 728 867)	(208 715 560)	(2 590 853)	(2 456 373)	(295 074 938)	(17 282 364)	(14 482 722)	(67 672 335)
Produit de la vente d'investissements à leur juste valeur par le biais du compte de résultat	209 151 617	221 521 551	2 979 138	4 088 594	79 105 759	38 368 370	36 484 917	68 136 167
Revenu perçu sur les obligations	15 422 948	11 689 419	214 250	251 386	900 941	776 945	178 367	205 267
Revenu perçu sur les intérêts de dépôt	217 153	190 100	3 738	4 517	113 292	18 756	167 164	98 933
Autres revenus perçus	490 998	586 173	(5 334)	(52 299)	(172 409)	(142 287)	50 628	(55 730)
Charges d'exploitation payées	(3 518 921)	(3 499 367)	(54 267)	(64 395)	(26 520)	(209 150)	54 408	(116 443)
Entrée/(sortie) nette du flux de trésorerie résultant des activités d'exploitation	40 034 928	21 772 316	546 672	1 771 430	(215 153 875)	21 530 270	22 452 762	595 859
Flux de trésorerie résultant des activités de financement								
Produit de l'émission d'actions participantes remboursables	57 926 089	57 198 814	90 733	28 777	233 337 357	7 933 361	–	–
Dividendes versés aux détenteurs d'actions participantes remboursables	(2 608 568)	(1 965 848)	(83 274)	(98 911)	(50 191)	(160 913)	–	–
Dividendes réinvestis	768 996	487 238	28 242	38 864	38 451	11 494	–	–
Intérêts de découvert payés	–	(2 623)	–	–	–	(367)	–	–
Paiements sur les rachats des actions participantes remboursables	(95 961 712)	(96 838 285)	(562 383)	(1 693 396)	(12 615 519)	(29 588 817)	(27 988 295)	(80 065)
Entrée/(sortie) du flux de trésorerie résultant des activités de financement	(39 875 195)	(41 120 704)	(526 682)	(1 724 666)	220 710 098	(21 805 242)	(27 988 295)	(80 065)
Augmentation/(diminution) nette des liquidités et des quasi-liquidités pour la période	159 733	(19 348 388)	19 990	46 764	5 556 223	(274 972)	(5 535 533)	515 794
Liquidités et quasi-liquidités au 1er janvier 2024 (2023)	7 210 183	6 173 266	92 201	242 955	506 081	1 280 884	5 774 254	5 090 171
Écart de conversion	–	–	–	–	–	–	–	–
Liquidités et quasi-liquidités au 30 juin 2024 (2023)	7 369 916	(13 175 122)	112 191	289 719	6 062 304	1 005 912	238 721	5 605 965

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

Les notes des pages 32 à 59 font partie intégrante des présents états financiers condensés

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

État condensé des flux de trésorerie (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2024 (suite)

	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2023	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2024	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 30 juin 2023	TOTAL USD 30 juin 2024	TOTAL USD 30 juin 2023
Flux de trésorerie résultant des activités d'exploitation								
Achat d'actif financier et règlement de passif financier	(24 850 517)	(20 068 815)	(127 396 736)	(97 579 425)	(736 210 604)	(504 871 509)	(1 446 082 088)	(975 295 678)
Produit de la vente d'investissements à leur juste valeur par le biais du compte de résultat	23 203 413	18 359 843	110 999 660	92 008 132	733 526 015	376 824 424	1 257 710 081	863 641 589
Revenu perçu sur les obligations	769 032	616 015	2 232 033	1 522 949	15 568 421	6 231 154	36 618 352	22 054 816
Revenu perçu sur les intérêts de dépôt	18 261	11 772	39 272	20 355	185 260	93 139	761 560	448 971
Autres revenus perçus	25 364	(31 083)	32 915	(50 098)	(8 190)	(164 231)	417 566	68 113
Charges d'exploitation payées	(107 761)	(58 221)	(302 800)	(145 495)	(1 459 338)	(645 660)	(5 549 364)	(4 816 023)
Entrée/(sortie) nette du flux de trésorerie résultant des activités d'exploitation	(942 208)	(1 170 489)	(14 395 656)	(4 223 582)	11 601 564	(122 532 683)	(156 123 893)	(93 898 212)
Flux de trésorerie résultant des activités de financement								
Produit de l'émission d'actions participantes remboursables	13 445 148	2 895 637	32 773 702	28 214 412	359 430 385	178 750 321	726 108 747	294 118 616
Dividendes versés aux détenteurs d'actions participantes remboursables	–	–	(77 227)	–	(720)	–	(2 825 573)	(2 225 672)
Dividendes réinvestis	–	–	–	–	–	–	835 689	537 596
Intérêts de découvert payés	–	–	–	–	–	–	–	(2 992)
Paiements sur les rachats des actions participantes remboursables	(13 201 446)	(1 483 770)	(15 098 760)	(22 385 549)	(357 071 609)	(50 323 571)	(550 150 152)	(209 145 006)
Entrée du flux de trésorerie résultant des activités de financement	243 702	1 411 867	17 597 715	5 828 863	2 358 056	128 426 750	173 968 711	83 282 542
Hausse/(baisse) nette des liquidités et des quasi-liquidités pour la période	(698 506)	241 378	3 202 059	1 605 281	13 959 620	5 894 067	17 844 818	(10 615 670)
Liquidités et quasi-liquidités au 1er janvier 2024 (2023)	1 367 976	1 223 219	1 692 475	1 725 545	6 508 490	6 515 071	24 153 049	22 887 556
Écart de conversion	–	–	–	–	–	–	(314 817)	224 764
Liquidités et quasi-liquidités au 30 juin 2024 (2023)	669 470	1 464 597	4 894 534	3 330 826	20 468 110	12 409 138	41 683 050	12 496 650

Les notes des pages 32 à 59 font partie intégrante des présents états financiers condensés

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Notes relatives aux états financiers condensés au 30 juin 2024

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 2023.

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 2023. 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 Loomis, Sayles & Company, L.P. est agréé et réglementé par la Securities and Exchange Commission (« SEC ») aux États-Unis en tant que conseiller en investissements. Le Gestionnaire Financier Loomis Sayles (Netherlands) B.V. est agréé et réglementé par l'Autorité néerlandaise des marchés financiers (l'« AFM »). 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. Les états financiers du Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund ont été préparés selon l'hypothèse de la continuité de l'exploitation.

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.

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 2024 et au 31 décembre 2023, ont été utilisés pour convertir l'actif et le passif libellés dans des devises autres que le dollar américain :

		30 juin 2024	31 décembre 2023		30 juin 2024	31 décembre 2023
1 USD =	AUD	1,4973	1,4655	JPY	160,8600	140,9800
	BRL	5,5545	4,8576	KRW	1 376,5000	1 287,9000
	CAD	1,3684	1,3186	MXN	18,2855	16,9345
	CHF	0,8986	0,8417	MYR	4,7175	4,5950
	CLP	S/O	873,2850	NOK	10,6475	10,1557
	CNH	7,3009	7,1206	NZD	1,6411	1,5794
	CNY	7,2661	7,0922	PLN	4,0201	3,9323
	COP	4 144,1500	3 874,0000	RUB	86,2500	89,4000
	DKK	6,9582	6,7484	SAR	3,7516	3,7500
	EGP	48,0300	30,9250	SEK	10,5902	10,0779
	EUR	0,9331	0,9053	SGD	1,3553	1,3191
	GBP	0,7911	0,7844	THB	36,6975	34,1325
	HKD	7,8074	7,8086	TRY	32,7835	29,5340
	HUF	368,4862	346,0056	TWD	32,4415	30,6905
	IDR	16 375,0000	15 397,0000	UYU	S/O	39,0400
	ILS	3,7672	3,6009	ZAR	18,2600	18,2875
	INR	83,3875	83,2138			

		30 juin 2024	31 décembre 2023
1 EUR =	CHF	0,9631	0,9297
	USD	1,0718	1,1047

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 2024, 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 l'exercice clos le 30 juin 2024, 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 2024, 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 2023 : 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 nominees. 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.

2. CAPITAL SOCIAL (suite)

Nombre d'actions émises et entièrement libérées

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

	Actions en circulation au 1er janvier 2024	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation au 30 juin 2024
Classe d'Actions C/A (USD)	588 431	–	–	(55 834)	532 597
Classe d'Actions C/D (USD)	360 734	–	3 622	(36 090)	328 266
Classe d'Actions CT/A (USD)	28 231	7 057	–	(21 915)	13 373
Classe d'Actions CT/DG (USD)	1 060	–	25	–	1 085
Classe d'Actions CT/DM (USD)	221 171	14 957	–	(20 277)	215 851
Classe d'Actions F/A (USD)	59 200	–	–	(1 767)	57 433
Classe d'Actions F/DM (USD)	55 149	–	1 243	–	56 392
Classe d'Actions H-I/A (EUR)	220 016	475	–	(43 390)	177 101
Classe d'Actions H-I/D (EUR)	88 141	–	–	(7 035)	81 106
Classe d'Actions H-I/D (GBP)	137 484	–	–	–	137 484
Classe d'Actions H-N/A (CHF)	750	–	–	–	750
Classe d'Actions H-N/A (EUR)	215 229	–	–	(441)	214 788
Classe d'Actions H-N1/A (EUR)	467 391	76 236	–	(174 688)	368 939
Classe d'Actions H-R/A (EUR)	1 412 458	108 728	–	(423 572)	1 097 614
Classe d'Actions H-R/A (SGD)	2 593 149	138 659	–	(1 582 820)	1 148 988
Classe d'Actions H-R/D (SGD)	450 461	28 793	2 966	(8 694)	473 526
Classe d'Actions H-RE/DM (AUD)	97 246	160	–	(3 614)	93 792
Classe d'Actions H-S/D (EUR)	72 500	–	–	–	72 500
Classe d'Actions I/A (EUR)	69 702	–	–	(50 022)	19 680
Classe d'Actions I/A (USD)	4 052 159	162 281	–	(772 409)	3 442 031
Classe d'Actions I/D (GBP)	9 990	–	–	–	9 990
Classe d'Actions I/D (USD)	3 402 352	553 760	36 905	(384 253)	3 608 764
Classe d'Actions I/DG (USD)	1 060	–	25	–	1 085
Classe d'Actions N/A (EUR)	405 992	1 558	–	(406 005)	1 545
Classe d'Actions N1/A (USD)	854 359	16 244	–	(211 176)	659 427
Classe d'Actions N1/D (USD)	519 809	–	2 281	(1 214)	520 876
Classe d'Actions R/A (EUR)	1 381 324	311 249	–	(800 376)	892 197
Classe d'Actions R/A (SGD)	63 993	4 791	–	(61 318)	7 466
Classe d'Actions R/A (USD)	4 492 522	68 120	–	(454 392)	4 106 250
Classe d'Actions R/D (EUR)	46 010	–	984	–	46 994
Classe d'Actions R/D (GBP)	102 241	577	–	(1 943)	100 875
Classe d'Actions R/D (SGD)	221 962	4 209	260	(32 465)	193 966
Classe d'Actions R/D (USD)	3 087 115	34 944	21 808	(225 938)	2 917 929
Classe d'Actions R/DG (USD)	4 400	10 723	–	(1 724)	13 399
Classe d'Actions R/DM (USD)	1 898 733	40 306	1 105	(280 830)	1 659 314
Classe d'Actions RE/A (EUR)	196 665	20 459	–	(45 746)	171 378
Classe d'Actions RE/A (USD)	5 470 337	147 352	–	(497 681)	5 120 008
Classe d'Actions RE/D (USD)	97	–	–	–	97
Classe d'Actions RE/DM (USD)	97	–	–	–	97
Classe d'Actions S/A (USD)	3 808 468	1 647 556	–	(156 607)	5 299 417
Classe d'Actions S/D (GBP)	678	–	1	–	679
Classe d'Actions S/D (USD)	38 300	–	–	–	38 300

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

	Actions en circulation au 1er janvier 2024	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation au 30 juin 2024
Classe d'Actions H-I/A (EUR)	79 254	–	–	(877)	78 377
Classe d'Actions H-N/D (EUR)	431	–	6	–	437
Classe d'Actions I/A (EUR)	7 850	–	–	–	7 850
Classe d'Actions I/A (USD)	141	–	–	–	141
Classe d'Actions I/D (USD)	180 062	–	5 384	–	185 446
Classe d'Actions R/A (EUR)	55 326	3 135	–	(3 456)	55 005
Classe d'Actions R/A (USD)	4 280	–	–	–	4 280
Classe d'Actions R/D (USD)	233 855	4 732	642	(22 033)	217 196
Classe d'Actions R/DM (USD)	171 889	–	–	(44 511)	127 378
Classe d'Actions S/A (USD)	3 100	–	–	–	3 100

2. CAPITAL SOCIAL (suite)

Nombre d'Actions émises et entièrement libérées (suite)

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

	Actions en circulation au 1er janvier 2024	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation au 30 juin 2024
Classe d'Actions C/A (USD)	12 930	–	–	–	12 930
Classe d'Actions H-F/A (GBP)	300	16 988 979	–	(815 761)	16 173 518
Classe d'Actions H-F/D (GBP)	300	477 054	1 766	(60 792)	418 328
Classe d'Actions H-I/A (AUD)	–	10 000	–	–	10 000
Classe d'Actions H-N/D (EUR)	393	–	4	–	397
Classe d'Actions H-R/A (EUR)	41 208	1 338	–	(3 725)	38 821
Classe d'Actions I/A (USD)	756 025	–	–	(37 919)	718 106
Classe d'Actions I/D (USD)	56 609	–	753	(5 273)	52 089
Classe d'Actions N/A (EUR)	6	–	–	–	6
Classe d'Actions N1/A (USD)	–	146 334	–	–	146 334
Classe d'Actions R/A (EUR)	161 428	96	–	(15 201)	146 323
Classe d'Actions R/A (USD)	29 020	–	–	(5 863)	23 157
Classe d'Actions R/D (GBP)	14 429	216	–	(1 898)	12 747
Classe d'Actions R/D (USD)	117 172	1 528	827	(6 310)	113 217

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND*

	Actions en circulation au 1er janvier 2024	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation au 30 juin 2024
Classe d'Actions H-I/A (EUR)	3 000	–	–	(3 000)	–
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 au 1er janvier 2024	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation au 30 juin 2024
Classe d'Actions G/A (EUR)	–	500 000	–	–	500 000
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)	52 010	57 053	–	–	109 063
Classe d'Actions N/A (EUR)	10	–	–	–	10
Classe d'Actions Q/A (EUR)	1 711 797	–	–	(980 406)	731 391
Classe d'Actions R/A (EUR)	205	–	–	–	205
Classe d'Actions RE/A (EUR)	1 908	–	–	(537)	1 371
Classe d'Actions S/A (EUR)	10	–	–	–	10
Classe d'Actions S2/A (EUR)	1 493 494	771 678	–	(306 492)	1 958 680

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

	Actions en circulation au 1er janvier 2024	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation au 30 juin 2024
Classe d'Actions H-I/A (USD)	70 000	–	–	(70 000)	–
Classe d'Actions I/A (EUR)	57 079	76 612	–	(9 020)	124 671
Classe d'Actions I/D (EUR)	129 500	69 900	–	–	199 400
Classe d'Actions N/A (EUR)	10	–	–	–	10
Classe d'Actions Q/A (EUR)	573 523	–	–	(573 523)	–
Classe d'Actions R/A (EUR)	3 649	–	–	–	3 649
Classe d'Actions RE/A (EUR)	300	–	–	–	300
Classe d'Actions S/A (EUR)	2 915 761	1 420 875	–	(142 634)	4 194 002
Classe d'Actions S/D (EUR)	330 948	47 122	–	(10 055)	368 015
Classe d'Actions S1/A (EUR)	2 126 620	–	–	–	2 126 620
Classe d'Actions S2/A (EUR)	6 750 768	1 809 387	–	(785 568)	7 774 587
Classe d'Actions S3/A (EUR)	–	350	–	–	350
Classe d'Actions S3/D (EUR)	–	350	–	–	350

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

2. CAPITAL SOCIAL (suite)

Nombre d'Actions émises et entièrement libérées (suite)

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

	Actions en circulation au 1er janvier 2024	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation au 30 juin 2024
Classe d'Actions G/A (EUR)	11 600 194	17 902 552	–	(2 315 791)	27 186 955
Classe d'Actions I/A (EUR)	1 656 134	3 132 732	–	(2 323 446)	2 465 420
Classe d'Actions I/D (EUR)	–	23 100	–	–	23 100
Classe d'Actions N/A (EUR)	6 250	–	–	–	6 250
Classe d'Actions Q/A (EUR)	15 292 711	535 166	–	(14 827 138)	1 000 739
Classe d'Actions R/A (EUR)	809 682	1 120 413	–	(16 104)	1 913 991
Classe d'Actions RE/A (EUR)	299	–	–	–	299
Classe d'Actions S/A (EUR)	2 111 611	3 034 234	–	(153 131)	4 992 714
Classe d'Actions S2/A (EUR)	41 035 266	10 516 088	–	(5 737 084)	45 814 270
Classe d'Actions S3/A (EUR)	16 488 145	343 952	–	(11 864 162)	4 967 935
Classe d'Actions S3/D (EUR)	300	–	–	–	300

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

	Actions en circulation au 1er janvier 2023	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation 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

2. CAPITAL SOCIAL (suite)

Nombre d'Actions émises et entièrement libérées (suite)

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

	Actions en circulation au 1er janvier 2023	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation 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

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

	Actions en circulation au 1er janvier 2023	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation 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 au 1er janvier 2023	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation 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 au 1er janvier 2023	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation 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

2. CAPITAL SOCIAL (suite)

Nombre d'Actions émises et entièrement libérées (suite)

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

	Actions en circulation au 1er janvier 2023	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation 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

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

	Actions en circulation au 1er janvier 2023	Actions émises	Actions réinvesties	Actions rachetées	Actions en circulation 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/A (EUR)	625 458	812 916	–	(21 555)	1 416 819
Classe d'Actions S2/A (EUR)	23 170 387	5 222 935	–	(2 326 179)	26 067 143
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

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.

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 7 552 858 USD au cours du semestre clos le 30 juin 2024 (30 juin 2023 : 5 174 106 USD) dont 1 338 345 USD étaient en souffrance au 30 juin 2024 (30 juin 2023 : 1 152 284 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 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
Classe F	1,05 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
Classe G	S/O	S/O	S/O	S/O	0,75 %	S/O	0,75 %
Classe H-F	S/O	S/O	1,05 %	S/O	S/O	S/O	S/O
Classe H-I	0,75 %	0,75 %	0,75 %	0,75 %	0,75 %	0,75 %	S/O
Classe H-N	0,75 %	0,75 %	0,75 %	S/O	0,75 %	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 %	1,65 %	1,25 %	S/O	1,25 %	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 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 %	0,75 %
Classe RE	1,60 %	S/O	S/O	S/O	1,60 %	1,60 %	0,75 %
Classe S	0,75 %	0,75 %	S/O	S/O	0,75 %	0,75 %	0,75 %
Classe S1	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	0,75 %	S/O
Classe S2	S/O	S/O	S/O	S/O	0,75 %	0,75 %	0,75 %
Classe S3	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	0,75 %	0,75 %

* Les classes d'actions qui ne présentent aucun plafond de frais sont soit inactives, soit non financées.
** Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

Les commissions de distribution pour la Classe CT sont incluses dans les commissions de gestion financière et se sont élevées à 16 241 USD pour le Fonds Loomis Sayles Multisector Income Fund pour le semestre clos le 30 juin 2024 (30 juin 2023 : 233 USD).

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 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
Classe F	1,25 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
Classe G	S/O	S/O	S/O	S/O	0,45 %	S/O	0,25 %
Classe H-F	S/O	S/O	0,20 %	S/O	S/O	S/O	S/O
Classe H-I	0,90 %	0,90 %	0,90 %	1,00 %	0,65 %	0,50 %	S/O
Classe H-N	0,90 %	0,90 %	0,90 %	S/O	0,75 %	S/O	S/O
Classe H-N1	0,80 %	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 %	S/O	S/O
Classe H-RE	1,80 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
Classe H-S	0,60 %	S/O	0,55 %	S/O	S/O	S/O	S/O
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 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	S/O	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 S1	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	0,35 %	S/O
Classe S2	S/O	S/O	S/O	S/O	0,45 %	0,30 %	0,30 %
Classe S3	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	0,25 %	0,25 %

* Les classes d'actions qui ne présentent aucun plafond de frais sont soit inactives, soit non financées.
** Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

3. COMMISSIONS (suite)

Des montants de 112 475 USD, 54 253 USD, 633 673 USD, 2 769 USD, 68 479 EUR, 349 385 EUR et 2 024 025 EUR ont été remboursés aux 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 2024 (30 juin 2023 : 128 990 USD, 48 262 USD, 28 143 USD, 0 USD, 46 170 EUR, 271 392 EUR et 949 849 EUR respectivement).

La Société verse à l'Agent administratif et au Dépositaire une commission mensuelle d'un total de 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 0 USD pour le semestre clos le 30 juin 2024 (30 juin 2023 : 79 413 USD), dont 0 USD (30 juin 2023 : 0 USD) était 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 163 154 USD pour le semestre clos le 30 juin 2024 (30 juin 2023 : 65 424 USD), dont 135 301 USD (30 juin 2023 : 278 424 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 0 USD pour le semestre clos le 30 juin 2024 (30 juin 2023 : 24 171 USD), dont 0 USD (30 juin 2023 : 0 USD) était toujours en cours à la clôture de la période.

Les coûts de transaction se sont élevés à 5 101 USD, 0 USD, 0 USD, 8 453 USD, 0 EUR, 0 EUR, 0 EUR (30 juin 2023 : 950 USD, 0 USD, 833 USD, 21 476 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 2024.

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

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 International, Société de gestion et Distributeur de la Société, sont présentés en page 3. Loomis, Sayles & Company, L.P. et Loomis Sayles (Netherlands) B.V. sont les Gestionnaires Financiers de la Société. La Société de gestion est tenue de payer les frais et dépenses du Gestionnaire Financier à partir de ses propres commissions.

À compter du 1er avril 2024, Natixis Investment Managers International a remplacé Natixis Investment Managers S.A. en tant que Société de gestion et Distributeur de la Société et Loomis Sayles (Netherlands) B.V. a remplacé Loomis, Sayles & Company, L.P. en tant que Gestionnaire Financier des Fonds Loomis Sayles Euro High Yield Fund, Loomis Sayles Euro Credit Fund et Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund.

Natixis Investment Managers International, Natixis Investment Managers S.A., Loomis, Sayles & Company, L.P. et Loomis Sayles (Netherlands) B.V. sont des filiales de Natixis Global Asset Management, groupe international de gestion d'actif basé à Paris (France), lui-même contrôlé par Natixis, Paris, 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., un des Gestionnaires Financiers de la Société. M. Christopher Yiannakou est Administrateur de la Société et également cadre de Loomis Sayles Investments Limited, UK (une filiale à 100 % de l'un des Gestionnaires Financiers de la Société).

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 2024, et pour comparaison au 31 décembre 2023, les entités suivantes avaient des intérêts excédant 20 % du capital social émis du Fonds.

	30 juin 2024		31 décembre 2023	
Actions participantes remboursables	**Nbre d'Actions**	**% du Fonds**	**Nbre d'Actions**	**% du Fonds**
Loomis Sayles High Income Fund				
RBC cees Nominees Ltd	185 446	27 %	180 062	24 %
Agent taïwanais - Natixis	191 596	28 %	236 488	32 %

	30 juin 2024		31 décembre 2023	
Actions participantes remboursables	**Nbre d'Actions**	**% du Fonds**	**Nbre d'Actions**	**% du Fonds**
Loomis Sayles Global Opportunistic Fund				
CACEIS UK Nominees - Natixis	11 613 108	65 %	–	–
Agent taïwanais - Natixis	–	–	642 031	54 %
UBS Natixis	–	–	279 974	24 %

	30 juin 2024		31 décembre 2023	
Actions participantes remboursables	**Nbre d'Actions**	**% du Fonds**	**Nbre d'Actions**	**% du Fonds**
Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund*				
Kennedy Fin Lux S.à.r.l.-Natixis Dub	–	–	2 257 517	100 %**

	30 juin 2024		31 décembre 2023	
Actions participantes remboursables	**Nbre d'Actions**	**% du Fonds**	**Nbre d'Actions**	**% du Fonds**
Loomis Sayles Euro High Yield Fund				
Clearstream Banking S.A.-Natixis	1 736 971	53 %	1 230 000	38 %
Kennedy Fin Lux S.a.r.l.-Natixis Dub	731 391	22 %	1 711 797	53 %

	30 juin 2024		31 décembre 2023	
Actions participantes remboursables	**Nbre d'Actions**	**% du Fonds**	**Nbre d'Actions**	**% du Fonds**
Loomis Sayles Euro Credit Fund				
Clearstream Banking S.A.-Natixis	3 264 377	22 %	–	–
FundSettle EOC Nominees	3 826 678	26 %	3 405 457	26 %
International Fund Services&Asset Mgt SA	4 740 536	32 %	4 878 869	38 %

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.
** plus de 99 %.

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

Le Fonds Loomis Sayles Multisector Income Fund est autorisé à la distribution publique à Hong Kong. Aucune transaction du fonds n'a été effectuée par l'intermédiaire d'un courtier qui est une personne liée à la société de gestion, au délégué à l'investissement, aux administrateurs du fonds ou au fiduciaire/dépositaire au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

Toutes les transactions entre la Société et/ou les Fonds et ses parties liées ont été conclues dans le cadre de la marche normale des affaires et dans des conditions commerciales normales.

5. PERSONNES LIÉES

Natixis Investment Managers International, Natixis Investment Managers S.A. (société dissoute le 31 mars 2024), Loomis, Sayles & Company, L.P. et Loomis Sayles (Netherlands) B.V. sont des filiales de Natixis Investment Managers, un groupe international de gestion d'actifs. Natixis Investment Managers, dont le siège se trouve à Paris, est une filiale en propriété exclusive de Natixis, laquelle est contrôlée par BPCE.

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 2023, 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.

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 2024 et au 31 décembre 2023 :

Au 30 juin 2024

Actif	**Niveau 1**	**Niveau 2**	**Niveau 3**	**Total**
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	482 400 376	–	482 400 376
Actions	4 241 137	–	–	4 241 137
Fonds d'investissement	12 198 632	–	–	12 198 632
Actions privilégiées	893 324	294 737	75 663	1 263 724
Contrats à terme de gré à gré	–	64 194	–	64 194
Contrats à terme normalisés	1 383 337	–	–	1 383 337
Passif				
Passif financier détenu à des fins de trading :				
Contrats à terme de gré à gré	–	(5 082)	–	(5 082)
Contrats à terme normalisés	(1 047 483)	–	–	(1 047 483)
Total de l'actif	17 668 947	482 754 225	75 663	500 498 835

6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

Estimation de la juste valeur (suite)

Loomis Sayles Multisector Income Fund (suite)

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.

Au 31 décembre 2023

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	514 013 614	–	514 013 614
Actions	2 448 769	–	–	2 448 769
Fonds d'investissement	11 489 676	–	–	11 489 676
Actions privilégiées	3 005 118	298 595	73 242	3 376 955
Contrats à terme de gré à gré	–	2 478 078	–	2 478 078
Contrats à terme normalisés	7 202 935	–	–	7 202 935
Passif				
Passif financier détenu à des fins de trading :				
Contrats à terme de gré à gré	–	(1 369 285)	–	(1 369 285)
Contrats à terme normalisés	(3 839 570)	–	–	(3 839 570)
Total de l'actif	20 306 928	515 421 002	73 242	535 801 172

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.

Les tableaux suivants présentent les mouvements au sein du niveau 3 pour la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023 par catégorie d'instrument financier.

Au 30 juin 2024

	Obligations	Actions privilégiées	Total
Solde à l'ouverture au 1er janvier 2024	**–**	**73 242**	**73 242**
Achats	–	–	–
Ventes	–	–	–
Décotes accumulées (primes)	–	–	–
Transferts vers le niveau 3	–	–	–
Transferts hors du niveau 3	–	–	–
Gains et pertes constatés dans le compte de résultat	–	2 421	2 421
Solde à la clôture au 30 juin 2024	**–**	**75 663**	**75 663**
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	–	2 421	2 421

Au 31 décembre 2023

	Obligations	Actions privilégiées	Total
Solde à l'ouverture au 1er janvier 2023	**15 000**	**76 582**	**91 582**
Achats	–	–	–
Ventes	(110 000)	–	(110 000)
Décotes accumulées (primes)	110 000	–	110 000
Transferts vers le niveau 3	–	–	–
Transferts hors du niveau 3	(15 000)	–	(15 000)
Gains et pertes constatés dans le compte de résultat	–	(3 340)	(3 340)
Solde à la clôture au 31 décembre 2023	**–**	**73 242**	**73 242**
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	**–**	(3 340)	(3 340)

6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

Estimation de la juste valeur (suite)

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 2024 et au 31 décembre 2023 :

Au 30 juin 2024

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	6 024 403	–	6 024 403
Actions	691	–	–	691
Fonds d'investissement	162 643	–	–	162 643
Actions privilégiées	8 430	–	46 012	54 442
Contrats à terme de gré à gré	–	3 199	–	3 199
Indices de swap de défaillance de crédit	8 154	–	–	8 154
Total de l'actif	179 918	6 027 602	46 012	6 253 532

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 2023

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	6 450 801	–	6 450 801
Actions	1 989	–	–	1 989
Fonds d'investissement	153 191	–	–	153 191
Actions privilégiées	20 704	–	44 539	65 243
Contrats à terme de gré à gré	–	89 401	–	89 401
Passif				
Passif financier détenu à des fins de trading :				
Contrats à terme de gré à gré	–	(46 208)	–	(46 208)
Total de l'actif	175 884	6 493 994	44 539	6 714 417

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 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023 par catégorie d'instrument financier.

Au 30 juin 2024

	Actions privilégiées	Total
Solde à l'ouverture au 1er janvier 2024	**44 539**	**44 539**
Achats	–	–
Ventes	–	–
Décotes accumulées (primes)	–	–
Transferts vers le niveau 3	–	–
Transferts hors du niveau 3	–	–
Gains et pertes constatés dans le compte de résultat	1 473	1 473
Solde à la clôture au 30 juin 2024	**46 012**	**46 012**
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	1 473	1 473

6. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

Estimation de la juste valeur (suite)

Loomis Sayles High Income Fund (suite)

Au 31 décembre 2023

	Actions privilégiées	Total
Solde à l'ouverture au 1er janvier 2023	**46 570**	**46 570**
Achats	–	–
Ventes	–	–
Décotes accumulées (primes)	–	–
Transferts vers le niveau 3	–	–
Transferts hors du niveau 3	–	–
Gains et pertes constatés dans le compte de résultat	(2 031)	(2 031)
Solde à la clôture au 31 décembre 2023	**44 539**	**44 539**
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	(2 031)	(2 031)

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 2024 et au 31 décembre 2023 :

Au 30 juin 2024

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	230 929 996	–	230 929 996
Contrats à terme de gré à gré	–	124 912	–	124 912
Contrats à terme normalisés	108 248	–	–	108 248
Passif				
Passif financier détenu à des fins de trading :				
Contrats à terme de gré à gré	–	(708 612)	–	(708 612)
Contrats à terme normalisés	(47 734)	–	–	(47 734)
Total de l'actif	60 514	230 346 296	–	230 406 810

Au 31 décembre 2023

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	15 443 164	–	15 443 164
Contrats à terme de gré à gré	–	41 757	–	41 757
Contrats à terme normalisés	51 259	–	–	51 259
Passif				
Passif financier détenu à des fins de trading :				
Contrats à terme de gré à gré	–	(39 221)	–	(39 221)
Contrats à terme normalisés	(46 711)	–	–	(46 711)
Total de l'actif	4 548	15 445 700	–	15 450 248

Au 30 juin 2024, 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 2023 : néant).

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 2024 et au 31 décembre 2023 :

Au 30 juin 2024

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	135 491	–	135 491
Total de l'actif	–	135 491	–	135 491

Au 31 décembre 2023

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	11 122 279	–	11 122 279
Actions	10 642 680	–	–	10 642 680
Contrats à terme de gré à gré	–	1 365 366	–	1 365 366
Contrats à terme normalisés	338 731	–	–	338 731
Indices de swap de défaillance de crédit	447 604	–	–	447 604
Passif				
Passif financier détenu à des fins de trading :				
Contrats à terme de gré à gré	–	(807 681)	–	(807 681)
Contrats à terme normalisés	(674 607)	–	–	(674 607)
Indices de swap de défaillance de crédit	(50 667)	–	–	(50 667)
Total de l'actif	10 703 741	11 679 964	–	22 383 705

Au 30 juin 2024, au sein du Loomis Sayles Alternative Risk Premia 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 2023 : néant).

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

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 2024 et au 31 décembre 2023 :

Au 30 juin 2024

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	33 491 450	–	33 491 450
Contrats à terme normalisés	10 740	–	–	10 740
Passif				
Passif financier détenu à des fins de trading :				
Contrats à terme de gré à gré	–	(33)	–	(33)
Total de l'actif	10 740	33 491 417	–	33 502 157

Au 31 décembre 2023

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	31 101 256	–	31 101 256
Contrats à terme de gré à gré	–	139	–	139
Contrats à terme normalisés	13 675	–	–	13 675
Total de l'actif	13 675	31 101 395	–	31 115 070

Au 30 juin 2024, 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 2023 : néant).

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 2024 et au 31 décembre 2023 :

Au 30 juin 2024

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	138 283 052	–	138 283 052
Contrats à terme normalisés	144 030	–	–	144 030
Passif				
Passif financier détenu à des fins de trading :				
Contrats à terme normalisés	(164 280)	–	–	(164 280)
Total de l'actif	(20 250)	138 283 052	–	138 262 802

Au 31 décembre 2023

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	121 332 450	–	121 332 450
Contrats à terme de gré à gré	–	19 232	–	19 232
Contrats à terme normalisés	198 180	–	–	198 180
Passif				
Passif financier détenu à des fins de trading :				
Contrats à terme de gré à gré	–	(34 827)	–	(34 827)
Contrats à terme normalisés	(138 600)	–	–	(138 600)
Total de l'actif	59 580	121 316 855	–	121 376 435

Au 30 juin 2024, 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 2023 : néant).

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 2024 et au 31 décembre 2023 :

Au 30 juin 2024

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	841 500 712	–	841 500 712
Contrats à terme normalisés	767 990	–	–	767 990
Passif				
Passif financier détenu à des fins de trading :				
Contrats à terme normalisés	(923 670)	–	–	(923 670)
Total de l'actif	(155 680)	841 500 712	–	841 345 032

Au 31 décembre 2023

Actif	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actif financier détenu à des fins de trading :				
Obligations	–	841 442 328	–	841 442 328
Contrats à terme normalisés	1 281 935	–	–	1 281 935
Passif				
Passif financier détenu à des fins de trading :				
Contrats à terme normalisés	(1 293 600)	–	–	(1 293 600)
Total de l'actif	(11 665)	841 442 328	–	841 430 663

Au 30 juin 2024, 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 2023 : néant).

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 2024, 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 2024 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 2024

Fonds	Charges liées aux commissions sur les contrats à terme normalisés	Plus-value/(moins-value) réalisée	Variation des plus-values/(moins-values) latentes
Loomis Sayles Multisector Income Fund	23 918 USD	678 533 USD	(3 027 512) USD
Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund	5 794 USD	(407 106) USD	55 966 USD
Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund*	1 748 USD	(73 397) USD	335 877 USD
Loomis Sayles Euro High Yield Fonds	84 EUR	(31 005) EUR	(2 935) EUR
Loomis Sayles Euro Credit Fonds	1 392 EUR	81 630 EUR	(79 830) EUR
Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund	9 527 EUR	968 600 EUR	(144 015) EUR

Au 31 décembre 2023

Fonds	Charges liées aux commissions sur les contrats à terme normalisés	Plus-value/(moins-value) réalisée	Variation des plus-values/(moins-values) latentes
Loomis Sayles Multisector Income Fund	32 470 USD	(6 187 470) USD	3 857 863 USD
Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund	725 USD	(110 081) USD	5 834 USD
Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund	58 871 USD	333 919 USD	(348 388) USD
Loomis Sayles Euro High Yield Fund	508 EUR	(13 937) EUR	38 987 EUR
Loomis Sayles Euro Credit Fund	2 128 EUR	(294 273) EUR	385 813 EUR
Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund	13 075 EUR	(741 023) EUR	780 893 EUR

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

8. ACCORDS DE COMMISSIONS EN NATURE

Aucun accord de commissions en nature n'a été conclu entre la Société de gestion ou un Gestionnaire Financier sur l'un des Fonds pour la période allant du 1er janvier au 30 juin 2024 (31 décembre 2023 : néant).

9. TABLEAU DE COMPARAISON DES VALEURS D'INVENTAIRE NETTES

	Au 30 juin 2024		Au 31 décembre 2023		Au 30 juin 2023	
	Actions	USD	Actions	USD	Actions	USD
LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND						
- Classe d'Actions C/A (USD)	532 597	22,24	588 431	22,19	699 436	21,24
- Classe d'Actions C/D (USD)	328 266	12,02	360 734	12,21	422 523	11,86
- Classe d'Actions CT/A (USD)	13 373	10,21	28 231	10,20	7 065	9,78
- Classe d'Actions CT/DG (USD)	1 085	9,58	1 060	9,80	1 037	9,56
- Classe d'Actions CT/DM (USD)	215 851	9,31	221 171	9,46	6 557	9,19
- Classe d'Actions F/A (USD)	57 433	14,90	59 200	14,80	82 155	14,10
- Classe d'Actions F/DM (USD)	56 392	8,07	55 149	8,19	54 016	7,97
- Classe d'Actions H-I/A (EUR)	177 101	17,33	220 016	17,87	259 009	16,95
- Classe d'Actions H-I/D (EUR)	81 106	9,34	88 141	9,85	88 141	9,55
- Classe d'Actions H-I/D (GBP)	137 484	12,88	137 484	13,21	143 494	12,84
- Classe d'Actions H-N/A (CHF)	750	10,30	750	11,13	750	10,18
- Classe d'Actions H-N/A (EUR)	214 788	10,16	215 229	10,47	214 822	9,93
- Classe d'Actions H-N1/A (EUR)	368 939	10,29	467 391	10,60	308 794	10,07
- Classe d'Actions H-R/A (EUR)	1 097 614	10,71	1 412 458	11,07	2 236 003	10,53
- Classe d'Actions H-R/A (SGD)	1 148 988	7,99	2 593 149	8,23	2 648 053	7,72
- Classe d'Actions H-R/D (SGD)	473 526	5,80	450 461	6,11	529 151	5,83
- Classe d'Actions H-RE/DM (AUD)	93 792	5,71	97 246	5,96	97 105	5,71
- Classe d'Actions H-S/D (EUR)	72 500	7,48	72 500	7,90	73 984	7,65
- Classe d'Actions I/A (EUR)	19 680	36,47	69 702	36,16	73 463	34,41
- Classe d'Actions I/A (USD)	3 442 031	19,14	4 052 159	18,98	4 916 886	18,06
- Classe d'Actions I/D (GBP)	9 990	13,73	9 990	13,93	9 990	13,53
- Classe d'Actions I/D (USD)	3 608 764	11,17	3 402 352	11,34	3 411 134	11,01
- Classe d'Actions I/DG (USD)	1 085	9,75	1 060	9,90	1 037	9,62
- Classe d'Actions N/A (EUR)	1 545	11,53	405 992	11,44	456 287	10,88
- Classe d'Actions N/A (USD)	–	–	–	–	4 882	10,26
- Classe d'Actions N/DM (USD)	–	–	–	–	47 510	8,47
- Classe d'Actions N1/A (USD)	659 427	10,99	854 359	10,89	748 132	10,36
- Classe d'Actions N1/D (USD)	520 876	8,73	519 809	8,86	568 926	8,61
- Classe d'Actions R/A (EUR)	892 197	24,79	1 381 324	24,65	1 095 712	23,51
- Classe d'Actions R/A (SGD)	7 466	9,00	63 993	8,94	70 403	8,53
- Classe d'Actions R/A (USD)	4 106 250	17,00	4 492 522	16,90	5 183 928	16,12
- Classe d'Actions R/D (EUR)	46 994	10,01	46 010	10,16	45 200	9,86
- Classe d'Actions R/D (GBP)	100 875	18,22	102 241	18,50	112 526	17,96
- Classe d'Actions R/D (SGD)	193 966	6,29	221 962	6,39	233 974	6,21
- Classe d'Actions R/D (USD)	2 917 929	11,18	3 087 115	11,35	3 338 915	11,02
- Classe d'Actions R/DG (USD)	13 399	9,62	4 400	9,83	1 963	9,61
- Classe d'Actions R/DM (USD)	1 659 314	12,88	1 898 733	13,08	2 008 984	12,72
- Classe d'Actions RE/A (EUR)	171 378	22,01	196 665	21,92	226 220	20,95
- Classe d'Actions RE/A (USD)	5 120 008	15,58	5 470 337	15,52	5 680 172	14,83
- Classe d'Actions RE/D (USD)	97	10,72	97	10,68	97	10,21
- Classe d'Actions RE/DM (USD)	97	10,69	97	10,65	106	10,18
- Classe d'Actions S/A (USD)	5 299 417	19,24	3 808 468	19,06	3 925 364	18,11
- Classe d'Actions S/D (GBP)	679	13,90	678	14,04	678	13,56
- Classe d'Actions S/D (USD)	38 300	13,58	38 300	13,79	38 300	13,40

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

	Au 30 juin 2024		Au 31 décembre 2023		Au 30 juin 2023	
	Actions	**USD**	**Actions**	**USD**	**Actions**	**USD**
LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND						
- Classe d'Actions H-I/A (EUR)	78 377	23,76	79 254	24,31	80 106	22,65
- Classe d'Actions H-N/D (EUR)	437	7,44	431	7,71	426	7,28
- Classe d'Actions H-R/A (EUR)	–	–	–	–	1 161	9,48
- Classe d'Actions I/A (EUR)	7 850	21,93	7 850	21,60	7 850	20,19
- Classe d'Actions I/A (USD)	141	25,92	141	25,52	141	23,85
- Classe d'Actions I/D (USD)	185 446	4,56	180 062	4,62	241 044	4,44
- Classe d'Actions N/DM (USD)	–	–	–	–	434	7,03
- Classe d'Actions R/A (EUR)	55 005	20,22	55 326	20,02	56 292	18,81
- Classe d'Actions R/A (USD)	4 280	10,89	4 280	10,78	4 280	10,13
- Classe d'Actions R/D (USD)	217 196	6,11	233 855	6,20	239 187	5,96
- Classe d'Actions R/DM (USD)	127 378	6,88	171 889	6,98	206 652	6,72
- Classe d'Actions S/A (USD)	3 100	21,87	3 100	21,52	3 100	20,10

	Au 30 juin 2024		Au 31 décembre 2023		Au 30 juin 2023	
	Actions	**USD**	**Actions**	**USD**	**Actions**	**USD**
LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND						
- Classe d'Actions C/A (USD)	12 930	12,42	12 930	13,03	12 930	12,61
- Classe d'Actions H-F/A (GBP)	16 173 518	13,36	300	13,59	–	–
- Classe d'Actions H-F/D (GBP)	418 328	13,17	300	13,59	–	–
- Classe d'Actions H-I/A (AUD)	10 000	6,76	–	–	–	–
- Classe d'Actions H-I/A (SGD)	–	–	–	–	149 501	7,06
- Classe d'Actions H-N/D (EUR)	397	8,23	393	8,72	390	8,45
- Classe d'Actions H-R/A (EUR)	38 821	9,06	41 208	9,54	43 428	9,20
- Classe d'Actions I/A (USD)	718 106	12,95	756 025	13,51	2 395 517	12,99
- Classe d'Actions I/D (USD)	52 089	9,51	56 609	10,07	58 954	9,82
- Classe d'Actions N/A (EUR)	6	10,68	6	11,24	6	10,87
- Classe d'Actions N1/A (USD)	146 334	9,31	–	–	15 008	9,08
- Classe d'Actions R/A (EUR)	146 323	17,47	161 428	18,28	185 621	17,62
- Classe d'Actions R/A (USD)	23 157	9,30	29 020	9,73	29 020	9,38
- Classe d'Actions R/D (GBP)	12 747	16,68	14 429	17,67	13 784	17,21
- Classe d'Actions R/D (USD)	113 217	9,47	117 172	10,03	137 928	9,77

	Au 30 juin 2024		Au 31 décembre 2023		Au 30 juin 2023	
	Actions	**USD**	**Actions**	**USD**	**Actions**	**USD**
LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND*						
- Classe d'Actions H-I/A (EUR)	–	–	3 000	11,71	41 398	10,88
- Classe d'Actions H-Q/A (EUR)	–	–	2 257 517	12,45	2 257 517	11,52
- Classe d'Actions I/A (USD)	–	–	287	11,57	287	10,76
- Classe d'Actions R/A (USD)	–	–	287	11,40	287	10,63

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

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

	Au 30 juin 2024		Au 31 décembre 2023		Au 30 juin 2023	
	Actions	**EUR**	**Actions**	**EUR**	**Actions**	**EUR**
LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND						
- Classe d'Actions G/A (EUR)	500 000	10,19	–	–	–	–
- Classe d'Actions H-I/A (CHF)	300	10,60	300	10,81	300	9,76
- Classe d'Actions H-N/A (CHF)	300	10,58	300	10,78	300	9,75
- Classe d'Actions H-R/A (CHF)	300	10,46	300	10,69	300	9,68
- Classe d'Actions I/A (EUR)	109 063	10,64	52 010	10,35	10	9,69
- Classe d'Actions N/A (EUR)	10	10,53	10	10,22	10	9,56
- Classe d'Actions Q/A (EUR)	731 391	10,47	1 711 797	10,16	1 762 817	9,50
- Classe d'Actions R/A (EUR)	205	10,47	205	10,21	205	9,61
- Classe d'Actions RE/A (EUR)	1 371	10,07	1 908	9,83	300	9,25
- Classe d'Actions S/A (EUR)	10	10,67	10	10,35	10	9,69
- Classe d'Actions S2/A (EUR)	1 958 680	10,29	1 493 494	9,99	1 427 437	9,36

	Au 30 juin 2024		Au 31 décembre 2023		Au 30 juin 2023	
	Actions	**EUR**	**Actions**	**EUR**	**Actions**	**EUR**
LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND						
- Classe d'Actions H-I/A (USD)	–	–	70 000	9,72	70 000	9,19
- Classe d'Actions I/A (EUR)	124 671	9,41	57 079	9,35	38 890	8,81
- Classe d'Actions I/D (EUR)	199 400	10,44	129 500	10,53	129 500	10,03
- Classe d'Actions N/A (EUR)	10	9,52	10	9,42	10	8,83
- Classe d'Actions Q/A (EUR)	–	–	573 523	9,43	2 207 934	8,87
- Classe d'Actions R/A (EUR)	3 649	9,32	3 649	9,28	3 649	8,77
- Classe d'Actions RE/A (EUR)	300	9,25	300	9,22	300	8,72
- Classe d'Actions S/A (EUR)	4 194 002	9,41	2 915 761	9,34	1 114 506	8,80
- Classe d'Actions S/D (EUR)	368 015	10,37	330 948	10,46	–	–
- Classe d'Actions S1/A (EUR)	2 126 620	10,73	2 126 620	10,65	1 479 620	10,02
- Classe d'Actions S2/A (EUR)	7 774 587	9,47	6 750 768	9,40	7 212 964	8,84
- Classe d'Actions S3/A (EUR)	350	10,02	–	–	–	–
- Classe d'Actions S3/D (EUR)	350	10,02	–	–	–	–

	Au 30 juin 2024		Au 31 décembre 2023		Au 30 juin 2023	
	Actions	**EUR**	**Actions**	**EUR**	**Actions**	**EUR**
LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND						
- Classe d'Actions G/A (EUR)	27 186 955	10,35	11 600 194	10,28	–	–
- Classe d'Actions I/A (EUR)	2 465 420	9,49	1 656 134	9,44	439 237	8,89
- Classe d'Actions I/D (EUR)	23 100	10,09	–	–	–	–
- Classe d'Actions N/A (EUR)	6 250	9,45	6 250	9,40	14 900	8,87
- Classe d'Actions Q/A (EUR)	1 000 739	9,60	15 292 711	9,52	16 419 337	8,96
- Classe d'Actions R/A (EUR)	1 913 991	9,39	809 682	9,35	2 560	8,83
- Classe d'Actions RE/A (EUR)	299	9,41	299	9,37	299	8,84
- Classe d'Actions S/A (EUR)	4 992 714	9,52	2 111 611	9,46	1 416 819	8,91
- Classe d'Actions S2/A (EUR)	45 814 270	9,54	41 035 266	9,48	26 067 143	8,93
- Classe d'Actions S3/A (EUR)	4 967 935	9,82	16 488 145	9,75	15 277 654	9,18
- Classe d'Actions S3/D (EUR)	300	10,00	300	9,94	300	9,36

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

Le Prospectus en vigueur a été approuvé par la Banque centrale d'Irlande le 1er avril 2024 et a remplacé le Prospectus daté au 21 janvier 2022.

Changement de société de gestion

La Société a nommé Natixis Investment Managers S.A. (« NIM SA ») en tant que société de gestion le 21 janvier 2022. NIM SA est une société luxembourgeoise agréée et réglementée par la Commission de Surveillance du Secteur Financier en tant que société de gestion conformément au chapitre 15 de la loi luxembourgeoise du 17 décembre 2010 sur les organismes de placement collectif, dans sa version modifiée. Son activité principale est la gestion collective de portefeuille.

L'ensemble du groupe de sociétés Natixis a entrepris une révision de son modèle opérationnel afin de rationaliser son organisation, d'accroître son efficacité opérationnelle et de simplifier les structures existantes au sein de l'organisation. Dans le cadre de cet examen, il a été prévu de fusionner NIM SA avec une autre société de gestion du groupe Natixis, Natixis Investment Managers International (« NIMI »).

NIMI est immatriculée au Registre du commerce et des sociétés de Paris sous le numéro 329 450 738, son siège social étant sis 43, avenue Pierre Mendès-France, 75013 Paris. NIMI est agréée par l'Autorité des marchés financiers (« AMF »), l'organisme de réglementation financière français, en tant que société de gestion d'OPCVM et de GFIA. NIMI a été approuvée par la Banque centrale d'Irlande pour fournir des services et des activités en Irlande sur une base transfrontalière, en tant que société de gestion d'OPCVM.

Les Administrateurs de la Société ont approuvé la nomination de NIMI, après la fusion des deux sociétés de gestion du groupe Natixis, en tant que société de gestion de la Société, en remplacement de la société de gestion précédente, NIM S.A. Le changement effectif a eu lieu le 1er avril 2024.

La nomination de Loomis Sayles (Netherlands) B.V en qualité de gestionnaire financier à compter du 1er avril 2024.

NIMI a désigné une nouvelle filiale du Gestionnaire Financier, Loomis Sayles L.P., pour fournir des services de gestion de portefeuille individuels aux Fonds Loomis Sayles Euro Credit Fund, Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund et Loomis Sayles Euro High Yield Fund.

Loomis Sayles (Netherlands) B.V., basée aux Pays-Bas, a été désignée pour fournir des services de gestion de portefeuille individuels aux Fonds Loomis Sayles Euro Credit Fund, Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund et Loomis Sayles Euro High Yield Fund.

Loomis Sayles (Netherlands) B.V. a été agréée par l'Autorité néerlandaise des marchés financiers (l'AFM) le 31 août 2023 en tant que GFIA pour gérer des fonds d'investissement alternatifs. Loomis Sayles (Netherlands) B.V. est également approuvée par l'AFM pour fournir des services de gestion de portefeuille individuels, ainsi que des services non essentiels (y compris des conseils en investissement, la distribution et le marketing).

Liquidation du Fonds Loomis Sayles Alternative Risk Premia

En concertation avec la Société de gestion, les Administrateurs ont déterminé que le Fonds n'a pas accumulé suffisamment d'actifs pour être économiquement viable depuis son lancement en octobre 2020 et que ses perspectives de croissance future sont limitées. Par conséquent, le Conseil a décidé de liquider le Fonds conformément au Prospectus, pour servir au mieux les intérêts des actionnaires.

Les actionnaires ont reçu un avis les informant que leurs Actions ont été automatiquement rachetées le 19 mars 2024.

Un nouveau prospectus est entré en vigueur en date du 1er avril 2024, introduisant, entre autres, le changement de la Société de gestion qui est passée de Natixis Investment Managers S.A. à Natixis Investment Managers International et annonçant la clôture et la suppression du Fonds Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund.

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

11. CHARGES FINANCIÈRES

Au cours du semestre clos le 30 juin 2024 et pour l'exercice clos le 31 décembre 2023, la Société a déclaré et payé les dividendes suivants :

Loomis Sayles Multisector Income Fund

Date	Montant des distributions sur le résultat USD	Montant des distributions sur les capitaux propres USD	Montant total USD
30 juin 2024	(1 448 189)	(1 160 379)	(2 608 568)

Date	Montant des distributions sur le résultat USD	Montant des distributions sur les capitaux propres USD	Montant total USD
31 décembre 2023	(3 357 208)	(842 379)	(4 199 587)

Loomis Sayles High Income Fund

Date	Montant des distributions sur le résultat USD	Montant des distributions sur les capitaux propres USD	Montant total USD
30 juin 2024	(49 314)	(33 960)	(83 274)

Date	Montant des distributions sur le résultat USD	Montant des distributions sur les capitaux propres USD	Montant total USD
31 décembre 2023	(147 679)	(40 884)	(188 563)

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

Date	Montant des distributions sur le résultat USD	Montant des distributions sur les capitaux propres USD	Montant total USD
30 juin 2024	(35 053)	(15 138)	(50 191)

Date	Montant des distributions sur le résultat USD	Montant des distributions sur les capitaux propres USD	Montant total USD
31 décembre 2023	(33 858)	(150 226)	(184 084)

Loomis Sayles Euro Credit Fund

Date	Montant des distributions sur le résultat EUR	Montant des distributions sur les capitaux propres EUR	Montant total EUR
30 juin 2024	(39 600)	(37 627)	(77 227)

Date	Montant des distributions sur le résultat EUR	Montant des distributions sur les capitaux propres EUR	Montant total EUR
31 décembre 2023	(17 269)	–	(17 269)

11. CHARGES FINANCIÈRES (suite)

Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund

Date	Montant des distributions sur le résultat EUR	Montant des distributions sur les capitaux propres EUR	Montant total EUR
30 juin 2024	(718)	(2)	(720)

Date	Montant des distributions sur le résultat EUR	Montant des distributions sur les capitaux propres EUR	Montant total EUR
31 décembre 2023	(2)	–	(2)

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 participantes remboursables	Distributions sur le résultat Montant USD	Distributions sur les capitaux Montant USD
1er juillet 2024	10 572 172	1 088 538	–

Loomis Sayles High Income Fund

Date	Nombre d'Actions participantes remboursables	Distributions sur le résultat Montant USD	Distributions sur les capitaux Montant USD
1er juillet 2024	530 457	32 175	–

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

Date	Nombre d'Actions participantes remboursables	Distributions sur le résultat Montant USD	Distributions sur les capitaux Montant USD
1er juillet 2024	596 777	66 713	–

Loomis Sayles Euro Credit Fund

Date	Nombre d'Actions participantes remboursables	Distributions sur le résultat Montant EUR	Distributions sur les capitaux Montant EUR
1er juillet 2024	567 765	46 130	–

Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund

Date	Nombre d'Actions participantes remboursables	Distributions sur le résultat Montant EUR	Distributions sur les capitaux Montant EUR
1er juillet 2024	23 400	1 780	–

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 22 août 2024.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

Calendrier des investissements	**Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	**Juste valeur USD**	**% de l'actif net**
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME – 94,56 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 93,60 %)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 90,10 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 88,79 %)				
Aérospatiale/Défense - 0,61 % (31 décembre 2023 : 0,69 %)				
Embraer Netherlands Finance BV, 7,000 %, 28/07/30 144A (i) (ii)	USD	1 110 000	1 158 311	0,23
RTX Corp, 2,375 %, 15/03/32	USD	190 000	155 730	0,03
RTX Corp, 5,150 %, 02/27/33	USD	1 480 000	1 464 628	0,29
TransDigm Inc, 6,750 %, 15/08/28 144A (i)	USD	320 000	323 912	0,06
			3 102 581	0,61
Compagnies aériennes - 0,94 % (31 décembre 2023 : 0,94 %)				
American Airlines, 3,700 %, 15/10/25	USD	619 546	602 936	0,12
American Airlines, 3,750 %, 15/10/25	USD	1 863 721	1 792 716	0,35
American Airlines, 4,950 %, 15/02/25	USD	793 678	785 266	0,15
United Airlines, 3,650 %, 07/10/25	USD	567 407	545 810	0,11
United Airlines, 4,000 %, 11/04/26	USD	1 108 276	1 073 960	0,21
			4 800 688	0,94
Automobile - 1,16 % (31 décembre 2023 : 2,69 %)				
General Motors Financial Co Inc, 6,000 %, 01/09/28	USD	1 755 000	1 783 772	0,35
General Motors Financial Co Inc, 6,400 %, 01/09/33	USD	2 245 000	2 329 978	0,46
ZF North America Capital Inc, 6,750 %, 23/04/30 144A (i)	USD	395 000	402 284	0,08
ZF North America Capital Inc, 6,875 %, 14/04/28 144A (i)	USD	380 000	387 552	0,07
ZF North America Capital Inc, 6,875 %, 23/04/32 144A (i)	USD	600 000	620 313	0,12
ZF North America Capital Inc, 7,125 %, 14/04/30 144A (i)	USD	400 000	413 843	0,08
			5 937 742	1,16
Activités bancaires - 9,03 % (31 décembre 2023 : 8,94 %)				
AIB Group PLC, 6,608 %, 13/09/29 144A (i) (ii) (iii)	USD	260 000	268 378	0,05
Bank of America Corp, 4,376 %, 27/04/28 (iii)	USD	940 000	917 478	0,18
Bank of America Corp, 5,288 %, 25/04/34 (iii)	USD	570 000	564 017	0,11
Bank of America Corp, 5,872 %, 09/15/34 (iii)	USD	1 415 000	1 455 604	0,29
Bank of America Corp, 6,110 %, 01/29/37	USD	810 000	841 599	0,16
Barclays PLC, 4,375 % (ii) (iii) (iv)	USD	1 915 000	1 608 033	0,31
Barclays PLC, 6,224 %, 09/05/34 (ii) (iii)	USD	2 695 000	2 761 379	0,54
Barclays PLC, 7,119 %, 27/06/34 (ii) (iii)	USD	4 965 000	5 267 585	1,03
BNP Paribas SA, 5,176 %, 09/01/30 144A (i) (ii) (iii)	USD	765 000	756 987	0,15
BNP Paribas SA, 5,198 %, 10/01/30 144A (i) (ii) (iii)	USD	1 280 000	1 262 610	0,25
CaixaBank SA, 6,840 %, 13/09/34 144A (i) (ii) (iii)	USD	740 000	781 694	0,15
Crédit Agricole SA, 4,000 %, 10/01/33 EMTN (ii) (iii)	USD	940 000	872 338	0,17
Crédit Agricole SA, 6,251 %, 10/01/35 144A (i) (ii) (iii)	USD	3 205 000	3 224 253	0,63
Deutsche Bank AG, 7,079 %, 10/02/34 (ii) (iii)	USD	2 795 000	2 845 487	0,56
Goldman Sachs Group Inc, 6,125 %, 15/02/33	USD	45 000	47 745	0,01
ING Groep NV, 6,114 %, 11/09/34 (ii) (iii)	USD	380 000	391 779	0,08
Intesa Sanpaolo SpA, 6,625 %, 20/06/33 144A (i) (ii)	USD	580 000	597 887	0,12
Intesa Sanpaolo SpA, 7,200 %, 28/11/33 144A (i) (ii)	USD	1 170 000	1 254 260	0,25

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Activités bancaires – 9,03 % (31 décembre 2023 : 8,94 %) (suite)				
JPMorgan Chase & Co, 5,350 %, 01/06/34 (iii)	USD	3 790 000	3 773 205	0,74
Morgan Stanley, 4,350 %, 08/09/26	USD	825 000	806 917	0,16
Morgan Stanley, 4,431 %, 01/23/30 (iii)	USD	915 000	885 161	0,17
Morgan Stanley, 5,424 %, 07/21/34 (iii)	USD	835 000	830 794	0,16
Morgan Stanley, 5,831 %, 04/19/35 (iii)	USD	950 000	973 821	0,19
Morgan Stanley, 5,948 %, 01/19/38 (iii)	USD	1 285 000	1 277 514	0,25
NatWest Group PLC, 5808 %, 13/09/29 (ii) (iii)	USD	740 000	749 671	0,15
Société Générale SA, 6,066 %, 19/01/35 144A (i) (ii) (iii)	USD	1 605 000	1 588 936	0,31
Standard Chartered PLC, 6,296 %, 06/07/34 144A (i) (ii) (iii)	USD	3 670 000	3 783 419	0,74
Synchrony Bank, 5,400 %, 22/08/25	USD	470 000	466 426	0,09
UBS Group AG, 5,617 %, 13/09/30 144A (i) (ii) (iii)	USD	335 000	336 427	0,07
UBS Group AG, 5,699 %, 08/02/35 144A (i) (ii) (iii)	USD	1 015 000	1 013 965	0,20
UBS Group AG, 6,537 %, 12/08/33 144A (i) (ii) (iii)	USD	1 000 000	1 049 388	0,21
UBS Group AG, 9,016 %, 15/11/33 144A (i) (ii) (iii)	USD	850 000	1 024 469	0,20
UniCredit SpA, 5,459 %, 30/06/35 144A (i) (ii) (iii)	USD	1 925 000	1 803 292	0,35
			46 082 518	9,03
Boissons - 0,25 % (31 décembre 2023 : 0,24 %)				
Bacardi Ltd/Bacardi-Martini BV, 5,400 %, 15/06/33 144A (i) (ii)	USD	1 305 000	1 272 331	0,25
			1 272 331	0,25
Matériaux de construction - 2,34 % (31 décembre 2023 : 1,78 %)				
Carrier Global Corp, 5,900 %, 15/03/34	USD	245 000	255 699	0,05
Cemex SAB de CV, 3,875 %, 11/07/31 144A (i) (ii)	USD	3 110 000	2 741 965	0,54
Cemex SAB de CV, 9,125 % 144A (i) (ii) (iii) (iv)	USD	5 150 000	5 493 968	1,08
JELD-WEN Inc, 4,875 %, 15/12/27 144A (i)	USD	890 000	840 553	0,16
Masco Corp, 6,500 %, 15/08/32	USD	112 000	119 157	0,02
Masco Corp, 7,750 %, 01/08/29	USD	464 000	510 842	0,10
Owens Corning, 5,700 %, 15/06/34	USD	1 950 000	1 967 947	0,39
			11 930 131	2,34
Chimie - 0,71 % (31 décembre 2023 : 0,80 %)				
Braskem Netherlands Finance BV, 4,500 %, 31/01/30 144A (i) (ii)	USD	220 000	186 025	0,04
Braskem Netherlands Finance BV, 5,875 %, 31/01/50 144A (i) (ii)	USD	850 000	627 975	0,12
Celanese US Holdings LLC, 6,330 %, 15/07/29	USD	510 000	524 532	0,10
Celanese US Holdings LLC, 6,379 %, 15/07/32	USD	330 000	339 103	0,07
Celanese US Holdings LLC, 6,550 %, 15/11//30	USD	370 000	386 647	0,08
Celanese US Holdings LLC, 6,700 %, 15/11//33	USD	1 470 000	1 544 749	0,30
			3 609 031	0,71
CMBS - 0,29 % (31 décembre 2023 : 0,35 %)				
GS Mortgage Securities Corp Trust, 3,668 %, 05/03/33 144A (i) (iii)	USD	405 000	346 328	0,07

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
CMBS – 0,29 % (31 décembre 2023 : 0,35 %) (suite)				
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, 3,686 %, 15/12/47 144A (i) (iii)	USD	472 950	435 582	0,09
MSBAM Commercial Mortgage Securities Trust, 3,277 %, 15/10/30 144A (i)	USD	139 660	127 091	0,02
WFRBS Commercial Mortgage Trust, 4,378 %, 15/05/47	USD	665 000	580 342	0,11
			1 489 343	0,29
Services commerciaux - 1,76 % (31 décembre 2023 : 1,58 %)				
Ashtead Capital Inc, 5,500 %, 11/08/32 144A (i)	USD	240 000	234 144	0,05
Ashtead Capital Inc, 5,550 %, 30/05/33 144A (i)	USD	385 000	375 130	0,07
Ashtead Capital Inc, 5,800 %, 15/04/34 144A (i)	USD	200 000	198 480	0,04
Ashtead Capital Inc, 5,950 %, 15/10/33 144A (i)	USD	2 210 000	2 214 172	0,43
Block Inc, 3,500 % 01/06/31	USD	960 000	828 149	0,16
Boost Newco Borrower LLC, 7,500 %, 15/01/31 144A (i)	USD	1 075 000	1 120 851	0,22
Equifax Inc, 7,000 %, 01/07/37	USD	370 000	411 016	0,08
Global Payments Inc 5,400 %, 15/08/32	USD	1 845 000	1 807 743	0,35
TriNet Group Inc, 3,500 %, 01/03/29 144A (i)	USD	620 000	551 861	0,11
United Rentals North America Inc, 6,125 %, 15/03/34 144A (i)	USD	1 260 000	1 255 405	0,25
			8 996 951	1,76
Ordinateurs - 1,21 % (31 décembre 2023 : 1,03 %)				
Dell International LLC/EMC Corp, 8,100 %, 15/07/36	USD	1 460 000	1 741 164	0,34
Dell International LLC/EMC Corp, 8,350 %, 15/07/46	USD	207 000	261 769	0,05
Gartner Inc, 3,625 %, 15/06/29 144A (i)	USD	595 000	544 883	0,11
Gartner Inc, 3,750 %, 01/10/30 144A (i)	USD	110 000	98 652	0,02
Leidos Inc, 4,375 %, 15/05/30	USD	140 000	132 351	0,03
Leidos Inc, 5,750 %, 15/03/33	USD	1 445 000	1 457 609	0,29
Seagate HDD Cayman, 4,091 %, 01/06/29 (ii)	USD	85 000	78 682	0,01
Seagate HDD Cayman, 9,625 %, 12/01/32 (ii)	USD	61 200	69 807	0,01
Western Digital Corp, 2,850 %, 01/02/29	USD	745 000	646 526	0,13
Western Digital Corp, 4,750 %, 15/02/26	USD	1 160 000	1 135 688	0,22
			6 167 131	1,21
Électricité - 0,54 % (31 décembre 2023 : 0,44 %)				
Enel Finance International NV, 6,000 %, 07/10/39 (ii)	USD	1 300 000	1 280 539	0,25
Pacific Gas & Electric Co, 5,450 %, 15/06/27	USD	405 000	405 206	0,08
Southern Co, 5,700 %, 15/03/34	USD	1 055 000	1 072 605	0,21
			2 758 350	0,54
Électronique - 0,69 % (31 décembre 2023 : 0,94 %)				
Amphenol Corp, 5,250 %, 05/04/34	USD	325 000	323 981	0,06
Sensata Technologies BV, 4,000 %, 15/04/29 144A (i) (ii)	USD	855 000	784 976	0,15
Sensata Technologies BV, 5,875 %, 01/09/30 144A (i) (ii)	USD	200 000	195 859	0,04
Sensata Technologies Inc, 3,750 %, 15/02/31 144A (i)	USD	95 000	82 802	0,02
TD SYNNEX Corp, 6,100 %, 12/04/34	USD	760 000	762 114	0,15

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Électronique – 0,69 % (31 décembre 2023 : 0,94 %) (suite)				
Trimble Inc, 6,100 %, 15/03/33	USD	1 330 000	1 377 225	0,27
			3 526 957	0,69
Ingénierie et construction - 0,11 % (31 décembre 2023 : 0,26 %)				
TopBuild Corp, 4,125 %, 15/02/32 144A (i)	USD	655 000	576 803	0,11
			576 803	0,11
Divertissements - 0,17 % (31 décembre 2023 : 0,88 %)				
Light & Wonder International Inc, 7,000 %, 15/05/28 144A (i)	USD	555 000	557 868	0,11
Light & Wonder International Inc, 7,250 %, 15/11/29 144A (i)	USD	45 000	45 959	0,01
Light & Wonder International Inc, 7,500 %, 01/09/31 144A (i)	USD	275 000	284 135	0,05
			887 962	0,17
Gestion de l'environnement - 0,28 % (31 décembre 2023 : 0,27 %)				
Veralto Corp, 5,450 %, 18/09/33 144A (i)	USD	1 440 000	1 437 256	0,28
			1 437 256	0,28
Finance - 5,92 % (31 décembre 2023 : 6,48 %)				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 5,750 %, 06/06/28 (ii)	USD	202 000	204 107	0,04
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 6,150 %, 30/09/30 (ii)	USD	4 585 000	4 740 122	0,93
AGFC Capital Trust I, 7,340 %, 15/01/67 (iii)	USD	400 000	254 639	0,05
Air Lease Corp, 4,625 %, 01/10/28	USD	847 000	821 321	0,16
Air Lease Corp, 4,650 % (iii) (iv)	USD	1 890 000	1 794 023	0,35
Aircastle Ltd, 5,950 %, 15/02/29 144A (i) (ii)	USD	330 000	329 905	0,06
Aircastle Ltd, 6,500 %, 18/07/28 144A (i) (ii)	USD	1 245 000	1 268 336	0,25
Aviation Capital Group LLC, 6,250 %, 15/04/28 144A (i)	USD	1 085 000	1 106 686	0,22
Aviation Capital Group LLC, 6,375 %, 15/07/30 144A (i)	USD	1 225 000	1 266 298	0,25
Aviation Capital Group LLC, 6,750 %, 25/10/28 144A (i)	USD	945 000	984 839	0,19
Blue Owl Finance LLC, 6,250 %, 18/04/34 144A (i)	USD	1 415 000	1 418 736	0,28
Jefferies Financial Group Inc, 5,875 %, 21/07/28	USD	370 000	373 716	0,07
Jefferies Financial Group Inc, 6,200 %, 14/04/34	USD	125 000	126 602	0,02
Jefferies Financial Group Inc, 6,250 %, 15/01/36	USD	1 970 000	1 989 320	0,39
Macquarie Airfinance Holdings Ltd, 6,400 %, 26/03/29 144A (i) (ii)	USD	75 000	76 269	0,02
Macquarie Airfinance Holdings Ltd, 6,500 %, 26/03/31 144A (i) (ii)	USD	155 000	159 389	0,03
Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5,000 %, 01/02/26 144A (i)	USD	540 000	528 532	0,10
Navient Corp, 5,000 %, 15/03/27	USD	445 000	424 761	0,08
Navient Corp, 6,750 %, 15/06/26	USD	320 000	321 111	0,06
OneMain Finance Corp, 3,500 %, 15/01/27	USD	95 000	89 010	0,02
OneMain Finance Corp, 3,875 %, 15/09/28	USD	105 000	94 145	0,02
OneMain Finance Corp, 4,000 %, 15/09/30	USD	280 000	240 308	0,05
OneMain Finance Corp, 5,375 %, 15/11/29	USD	380 000	356 385	0,07

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Finance - 5,92 % (31 décembre 2023 : 6,48 %) (suite)				
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 2,875 %, 15/10/26 144A (i)	USD	4 460 000	4 165 135	0,82
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 3,625 %, 01/03/29 144A (i)	USD	1 585 000	1 437 794	0,28
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 3,875 %, 01/03/31 144A (i)	USD	4 030 000	3 512 076	0,69
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 4,000 %, 15/10/33 144A (i)	USD	2 535 000	2 136 217	0,42
			30 219 782	5,92
Gaz - 0,06 % (31 décembre 2023 : 0,06 %)				
Southern Co Gas Capital Corp, 5,750 %, 15/09/33	USD	305 000	312 544	0,06
			312 544	0,06
Santé - 2,30 % (31 décembre 2023 : 1,86 %)				
Alcon Finance Corp, 5,375 %, 06/12/32 144A (i)	USD	575 000	576 124	0,11
Bausch + Lomb Corp, 8,375 %, 01/10/28 144A (i)	USD	15 000	15 356	0,00
Centene Corp, 2,500 %, 01/03/31	USD	1 545 000	1 267 952	0,25
Centene Corp, 3,000 %, 15/10/30	USD	1 055 000	902 098	0,18
Centene Corp, 3,375 %, 15/02/30	USD	375 000	332 855	0,07
Centene Corp, 4,625 %, 15/12/29	USD	1 295 000	1 224 844	0,24
HCA Inc, 5,500 %, 01/06/33	USD	2 100 000	2 082 813	0,41
HCA Inc, 5,600 %, 01/04/34	USD	1 420 000	1 411 438	0,28
Hologic Inc, 3,250 %, 15/02/29 144A (i)	USD	465 000	417 156	0,08
Icon Investments Six DAC, 6,000 %, 08/05/34 (ii)	USD	200 000	204 314	0,04
Medline Borrower LP/Medline Co-Issuer Inc, 6,250 %, 01/04/29 144A (i)	USD	665 000	672 526	0,13
Molina Healthcare Inc, 3,875 %, 15/05/32 144A (i)	USD	440 000	381 258	0,08
Molina Healthcare Inc, 4,375 %, 15/06/28 144A (i)	USD	860 000	809 463	0,16
Solventum Corp, 5,900 %, 30/04/54 144A (i)	USD	605 000	578 295	0,11
Star Parent Inc, 9,000 %, 01/10/30 144A (i)	USD	790 000	829 418	0,16
			11 705 910	2,30
Constructeurs de logements - 1,28 % (31 décembre 2023 : 1,13 %)				
Beazer Homes USA Inc, 7,250 %, 15/10/29	USD	1 555 000	1 557 172	0,31
MDC Holdings Inc, 6,000 %, 15/01/43	USD	3 335 000	3 507 535	0,69
PulteGroup Inc, 6,375 %, 15/05/33	USD	1 385 000	1 454 790	0,28
			6 519 497	1,28
Assurance - 2,58 % (31 décembre 2023 : 2,20 %)				
Arthur J Gallagher & Co, 5,450 %, 15/07/34	USD	300 000	297 545	0,06
Athene Global Funding, 3,205 %, 08/03/27 144A (i)	USD	1 575 000	1 470 517	0,29
Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, 22/06/47	USD	577 000	447 695	0,09
Brighthouse Financial Inc, 5,625 %, 15/05/30	USD	2 880 000	2 880 954	0,56
HUB International Ltd, 7,250 %, 15/06/30 144A (i)	USD	990 000	1 014 880	0,20
MBIA Insurance Corp, 16,850 %, 15/01/33	USD	150 000	7 500	0,00

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Assurance - 2,58 % (31 décembre 2023 : 2,20 %) (suite)				
Panther Escrow Issuer LLC, 7,125 %, 01/06/31 144A (i)	USD	805 000	814 204	0,16
Penn Mutual Life Insurance Co, 7,625 %, 15/06/40 *	USD	4 225 000	4 711 267	0,92
Stewart Information Services Corp, 3,600 %, 15/11/31	USD	1 845 000	1 525 303	0,30
			13 169 865	2,58
Internet - 3,37 % (31 décembre 2023 : 3,37 %)				
Expedia Group Inc, 3,250 %, 15/02/30	USD	1 125 000	1 014 054	0,20
Netflix Inc, 4,875 %, 15/06/30 144A (i)	USD	2 395 000	2 357 340	0,46
Netflix Inc, 5,375 %, 15/11/29 144A (i)	USD	295 000	297 880	0,06
Netflix Inc, 6,375 %, 15/05/29	USD	1 965 000	2 069 974	0,41
Uber Technologies Inc, 4,500 %, 15/08/29 144A (i)	USD	6 430 000	6 126 438	1,20
Uber Technologies Inc, 7,500 %, 15/09/27 144A (i)	USD	5 025 000	5 123 585	1,00
Uber Technologies Inc, 8,000 %, 01/11/26 144A (i)	USD	175 000	176 518	0,04
			17 165 789	3,37
Sociétés d'investissement - 3,18 % (31 décembre 2023 : 2,55 %)				
Antares Holdings LP, 7,950 %, 11/08/28 144A (i)	USD	2 295 000	2 377 847	0,47
Ares Capital Corp, 5,875 %, 01/03/29	USD	3 765 000	3 710 785	0,73
Blue Owl Capital Corp, 4,250 %, 15/01/26	USD	3 140 000	3 045 626	0,60
Blue Owl Technology Finance Corp, 4,750 %, 15/12/25 144A (i)	USD	4 075 000	3 945 620	0,77
Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 4,375 %, 01/02/29	USD	3 660 000	3 129 452	0,61
Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 5,250 %, 15/05/27	USD	5 000	4 693	0,00
			16 214 023	3,18
Fer/Acier - 0,44 % (31 décembre 2023 : 0,38 %)				
ArcelorMittal SA, 6,750 %, 01/03/41 (ii)	USD	590 000	601 799	0,12
ArcelorMittal SA, 6,800 %, 29/11/32 (ii)	USD	1 355 000	1 427 443	0,28
Steel Dynamics Inc, 5,375 %, 15/08/34	USD	240 000	235 893	0,04
			2 265 135	0,44
Loisirs - 1,66 % (31 décembre 2023 : 1,55 %)				
Carnival Corp, 4,000 %, 01/08/28 144A (i) (ii)	USD	235 000	220 693	0,04
Carnival Corp, 5,750 %, 01/03/27 144A (i) (ii)	USD	1 480 000	1 462 126	0,29
Carnival Corp, 6,000 %, 01/05/29 144A (i) (ii)	USD	350 000	345 737	0,07
Carnival Corp, 7,000 %, 15/08/29 144A (i) (ii)	USD	195 000	202 135	0,04
NCL Corp Ltd, 5,875 %, 15/03/26 144A (i) (ii)	USD	1 115 000	1 102 314	0,22
NCL Corp Ltd, 5,875 %, 15/02/27 144A (i) (ii)	USD	835 000	824 251	0,16
NCL Corp Ltd, 8,125 %, 15/01/29 144A (i) (ii)	USD	930 000	974 410	0,19
NCL Finance Ltd, 6,125 %, 15/03/28 144A (i) (ii)	USD	410 000	404 889	0,08
Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, 01/07/26 144A (i) (ii)	USD	65 000	62 907	0,01
Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,500 %, 01/04/28 144A (i) (ii)	USD	2 440 000	2 408 874	0,47

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Loisirs – 1,66 % (31 décembre 2023 : 1,55 %) (suite)				
Royal Caribbean Cruises Ltd, 6,250 %, 15/03/32 144A (i) (ii)	USD	475 000	478 990	0,09
			8 487 326	1,66
Hébergement - 1,30 % (31 décembre 2023 : 0,88 %)				
Choice Hotels International Inc, 5,850 %, 01/08/34	USD	235 000	231 618	0,05
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 4,875 %, 01/07/31 144A (i)	USD	270 000	239 020	0,05
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 5,000 %, 01/06/29 144A (i)	USD	900 000	839 204	0,16
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 6,625 %, 15/01/32 144A (i)	USD	1 110 000	1 115 197	0,22
Marriott International Inc, 2,850 %, 15/04/31	USD	1 255 000	1 074 839	0,21
Marriott International Inc, 5,300 %, 15/05/34	USD	345 000	338 732	0,07
Marriott Ownership Resorts Inc, 4,500 %, 15/06/29 144A (i)	USD	695 000	638 605	0,12
Travel + Leisure Co, 4,500 %, 01/12/29 144A (i)	USD	1 140 000	1 050 292	0,21
Travel + Leisure Co, 4,625 %, 01/03/30 144A (i)	USD	1 185 000	1 078 416	0,21
			6 605 923	1,30
Matériels divers - 0,08 % (31 décembre 2023 : 0,64 %)				
Ingersoll Rand Inc, 5,700 %, 14/08/33	USD	155 000	158 458	0,03
Nordson Corp, 5,800 %, 15/09/33	USD	230 000	235 958	0,05
			394 416	0,08
Médias - 5,68 % (31 décembre 2023 : 5,18 %)				
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,250 %, 15/01/34 144A (i)	USD	4 150 000	3 150 089	0,62
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, 01/04/63	USD	3 255 000	2 522 287	0,49
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, 23/10/45	USD	765 000	698 736	0,14
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, 01/12/61	USD	4 335 000	2 827 610	0,55
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 6,384 %, 23/10/35	USD	6 430 000	6 269 247	1,23
CSC Holdings LLC, 3,375 %, 15/02/31 144A (i)	USD	940 000	586 644	0,12
CSC Holdings LLC, 4,125 %, 01/12/30 144A (i)	USD	400 000	258 538	0,05
CSC Holdings LLC, 4,625 %, 01/12/30 144A (i)	USD	4 935 000	1 797 337	0,35
CSC Holdings LLC, 5,000 %, 15/11/31 144A (i)	USD	400 000	145 004	0,03
CSC Holdings LLC, 5,375 %, 01/02/28 144A (i)	USD	2 030 000	1 542 334	0,30
CSC Holdings LLC, 5,750 %, 15/01/30 144A (i)	USD	400 000	150 979	0,03
DISH DBS Corp, 5,125 %, 01/06/29	USD	1 350 000	534 614	0,11
DISH DBS Corp, 5,250 %, 01/12/26 144A (i)	USD	3 630 000	2 863 316	0,56
DISH DBS Corp, 5,750 %, 01/12/28 144A (i)	USD	1 205 000	835 443	0,16
DISH DBS Corp, 7,750 %, 01/07/26	USD	1 515 000	940 460	0,18
iHeartCommunications Inc, 5,250 %, 15/08/27 144A (i)	USD	545 000	289 368	0,06
Paramount Global, 4,375 %, 15/03/43	USD	1 855 000	1 229 787	0,24

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Médias - 5,68 % (31 décembre 2023 : 5,18 %) (suite)				
Paramount Global, 5,850 %, 01/09/43	USD	500 000	393 199	0,08
Paramount Global, 6,875 %, 30/04/36	USD	1 575 000	1 474 887	0,29
Time Warner Cable LLC, 4,500 %, 15/09/42	USD	535 000	391 567	0,08
Time Warner Cable LLC, 5,875 %, 15/11/40	USD	85 000	73 752	0,01
			28 975 198	5,68
Exploitation minière - 1,29 % (31 décembre 2023 : 1,94 %)				
Anglo American Capital PLC, 5,500 %, 02/05/33 144A (i) (ii)	USD	1 445 000	1 414 553	0,28
First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, 15/10/27 144A (i)	USD	3 825 000	3 736 858	0,73
FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 4,375 %, 01/04/31 144A (i) (ii)	USD	1 575 000	1 407 622	0,28
			6 559 033	1,29
Titres municipaux - 0,18 % (31 décembre 2023 : 0,17 %)				
Tobacco Settlement Financing Corp/VA, 6,706 %, 01/06/46*	USD	1 060 000	896 507	0,18
			896 507	0,18
Matériel de bureau/d'entreprise - 0,67 % (31 décembre 2023 : 0,68 %)				
CDW LLC/CDW Finance Corp, 3,250 %, 15/02/29	USD	570 000	514 921	0,10
CDW LLC/CDW Finance Corp, 3,276 %, 01/12/28	USD	105 000	95 312	0,02
CDW LLC/CDW Finance Corp, 3,569 %, 01/12/31	USD	3 225 000	2 816 752	0,55
			3 426 985	0,67
Pétrole et gaz - 4,54 % (31 décembre 2023 : 6,16 %)				
Aker BP ASA, 6,000 %, 13/06/33 144A (i) (ii)	USD	4 960 000	5 011 000	0,98
Civitas Resources Inc, 8,625 %, 01/11/30 144A (i)	USD	225 000	241 249	0,05
Continental Resources Inc, 5,750 %, 15/01/31 144A (i)	USD	5 685 000	5 589 915	1,10
Ecopetrol SA, 8,375 %, 01/19/36 (ii)	USD	670 000	658 105	0,13
Energian Israel Finance Ltd, 5,375 %, 30/03/28 144A (i) (ii)	USD	1 045 000	925 870	0,18
Energian Israel Finance Ltd, 5,875 %, 30/03/31 144A (i) (ii)	USD	1 375 000	1 165 175	0,23
EQT Corp, 7,000 %, 01/02/30	USD	1 180 000	1 252 248	0,24
Leviathan Bond Ltd, 6,500 %, 30/06/27 144A (i) (ii)	USD	410 000	382 753	0,07
Leviathan Bond Ltd, 6,750 %, 30/06/30 144A (i) (ii)	USD	450 000	401 175	0,08
Matador Resources Co, 6,875 %, 15/04/28 144A (i)	USD	235 000	238 534	0,05
Mesquite Energy Inc, 6,125 %, 15/01/24 (v)	USD	3 105 000	131 962	0,03
Mesquite Energy Inc, 7,750 %, 15/06/24 (v) *	USD	1 365 000	58 012	0,01
Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, 15/09/31	USD	20 000	22 430	0,00
Occidental Petroleum Corp, 8,875 %, 15/07/30	USD	2 255 000	2 596 854	0,51
Ovintiv Inc, 6,500 %, 15/08/34	USD	1 645 000	1 720 552	0,34
Ovintiv Inc, 6,500 %, 01/02/38	USD	90 000	92 542	0,02
Ovintiv Inc, 6,625 %, 15/08/37	USD	440 000	458 054	0,09
Ovintiv Inc, 7,200 %, 01/11/31	USD	60 000	64 673	0,01
Ovintiv Inc, 7,375 %, 01/11/31	USD	190 000	206 992	0,04
Southwestern Energy Co, 4,750 %, 01/02/32	USD	215 000	197 784	0,04
Variable Energi ASA, 8,000 %, 15/11/32 144A (i) (ii)	USD	1 225 000	1 371 332	0,27

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Pétrole et gaz - 4,54 % (31 décembre 2023 : 6,16 %) (suite)				
Viper Energy Inc, 7,375 %, 01/11/31 144A (i)	USD	370 000	383 205	0,07
			23 170 416	4,54
Autres ABS - 0,30 % (31 décembre 2023 : 0,33 %)				
Castlelake Aircraft Securitization Trust, 5,300 %, 15/06/43 144A (i)	USD	261 000	206 464	0,04
Castlelake Aircraft Structured Trust, 3,967 %, 15/04/39 144A (i)	USD	269 230	242 375	0,05
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 4,118 %, 25/07/47 144A (i)	USD	75 200	71 947	0,01
JOL Air Ltd, 3,967 %, 15/04/44 144A (i) (ii)	USD	749 235	696 841	0,14
MAPS Trust, 2,521 %, 15/06/46 144A (i)	USD	97 904	88 139	0,02
OneMain Financial Issuance Trust, 3,570 %, 14/03/33 144A (i)	USD	48 633	48 519	0,01
Wendy's Funding LLC, 3,884 %, 15/03/48 144A (i)	USD	186 982	175 789	0,03
			1 530 074	0,30
Produits pharmaceutiques - 2,20 % (31 décembre 2023 : 1,94 %)				
Bausch Health Cos Inc, 4,875 %, 01/06/28 144A (i)	USD	2 425 000	1 814 773	0,35
Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, 01/02/36	USD	1 020 000	1 001 080	0,20
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, 15/09/29 (ii)	EUR	820 000	972 211	0,19
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,875 %, 15/09/31 (ii)	EUR	700 000	863 547	0,17
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, 01/10/26 (ii)	USD	510 000	478 654	0,09
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, 01/10/46 (ii)	USD	3 040 000	2 123 302	0,42
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, 09/05/27 (ii)	USD	1 780 000	1 715 311	0,34
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, 09/05/29 (ii)	USD	1 145 000	1 101 454	0,21
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,875 %, 15/09/29 (ii)	USD	625 000	671 291	0,13
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, 15/09/31 (ii)	USD	450 000	500 336	0,10
			11 241 959	2,20
Conduites d'hydrocarbures - 2,49 % (31 décembre 2023 : 2,35 %)				
Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, 31/01/32	USD	205 000	174 973	0,03
Cheniere Energy Partners LP, 5,950 %, 30/06/33	USD	2 975 000	3 016 483	0,59
DCP Midstream Operating LP, 3,250 %, 15/02/32	USD	1 730 000	1 481 905	0,29
DCP Midstream Operating LP, 6,450 %, 03/11/36 144A (i)	USD	125 000	131 553	0,03
Energy Transfer LP, 5,600 %, 01/09/34	USD	2 105 000	2 091 048	0,41
EnLink Midstream LLC, 6,500 %, 01/09/30 144A (i)	USD	125 000	127 838	0,03
ONEOK Partners LP, 6,200 %, 15/09/43	USD	145 000	145 404	0,03
Targa Resources Corp, 6,125 %, 15/03/33	USD	670 000	688 080	0,13
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, 15/01/32	USD	590 000	529 939	0,10

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Conduites d'hydrocarbures – 2,49 % (31 décembre 2023 : 2,35 %) (suite)				
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, 01/02/31	USD	135 000	128 824	0,03
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4,125 %, 15/08/31 144A (i)	USD	1 940 000	1 740 889	0,34
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 6,250 %, 15/01/30 144A (i)	USD	455 000	461 778	0,09
Western Midstream Operating LP, 5,250 %, 01/02/50	USD	375 000	328 687	0,06
Western Midstream Operating LP, 5,300 %, 01/03/48	USD	665 000	574 173	0,11
Western Midstream Operating LP, 5,450 %, 01/04/44	USD	120 000	108 136	0,02
Western Midstream Operating LP, 5,500 %, 15/08/48	USD	90 000	78 229	0,02
Western Midstream Operating LP, 6,150 %, 01/04/33	USD	375 000	384 415	0,08
Western Midstream Operating LP, 6,350 %, 15/01/29	USD	490 000	505 385	0,10
			12 697 739	2,49
Immobilier - 0,19 % (31 décembre 2023 : 0,18 %)				
Agile Group Holdings Ltd, 6,050 %, 13/10/25 (ii) (v)	USD	1 030 000	66 963	0,01
Central China Real Estate Ltd, 7,250 %, 16/07/24 (ii) (v)	USD	820 000	19 131	0,00
Central China Real Estate Ltd, 7,250 %, 13/08/24 (ii) (v)	USD	200 000	5 000	0,00
Central China Real Estate Ltd, 7,250 %, 28/04/25 (ii) (v)	USD	190 000	4 750	0,00
Central China Real Estate Ltd, 7,500 %, 14/07/25 (ii) (v)	USD	200 000	5 000	0,00
CIFI Holdings Group Co Ltd, 6,000 %, 16/07/25 (ii) (v)	USD	400 000	42 137	0,01
Country Garden Holdings Co Ltd, 3,300 %, 12/01/31 (ii) (v)	USD	800 000	68 024	0,01
Kaisa Group Holdings Ltd, 9,375 %, 30/06/24 (ii) (v)	USD	1 915 000	62 238	0,01
Kaisa Group Holdings Ltd, 9,950 %, 23/07/25 (ii) (v)	USD	200 000	6 116	0,00
Kaisa Group Holdings Ltd, 10,500 %, 15/01/25 (ii) (v)	USD	400 000	13 000	0,00
Kaisa Group Holdings Ltd, 11,250 %, 16/04/25 (ii) (v)	USD	2 940 000	95 550	0,02
Kaisa Group Holdings Ltd, 11,700 %, 11/11/25 (ii) (v)	USD	205 000	6 416	0,00
Logan Group Co Ltd, 4,250 %, 12/07/25 (ii) (v)	USD	605 000	51 803	0,01
Logan Group Co Ltd, 4,850 %, 14/12/26 (ii) (v)	USD	800 000	66 555	0,01
Shimao Group Holdings Ltd, 3,450 %, 11/01/31 (ii) (v)	USD	1 015 000	46 314	0,01
Shimao Group Holdings Ltd, 5,200 %, 16/01/27 (ii) (v)	USD	200 000	8 850	0,00
Shimao Group Holdings Ltd, 5,600 %, 15/07/26 (ii) (v)	USD	345 000	15 714	0,00
Shimao Group Holdings Ltd, 6,125 %, 21/02/24 (ii) (v)	USD	200 000	9 612	0,00
Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 4,750 %, 05/08/29 (ii) (v)	USD	405 000	27 192	0,01
Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 4,750 %, 14/01/30 (ii) (v)	USD	605 000	40 292	0,01
Sunac China Holdings Ltd, 6,000 %, 30/09/25 144A (i) (ii)	USD	186 569	24 143	0,01
Sunac China Holdings Ltd, 6,250 %, 30/09/26 144A (i) (ii)	USD	186 795	21 608	0,01
Sunac China Holdings Ltd, 6,500 %, 30/09/27 144A (i) (ii)	USD	374 046	39 622	0,01
Sunac China Holdings Ltd, 6,750 %, 30/09/28 144A (i) (ii)	USD	561 751	57 023	0,01
Sunac China Holdings Ltd, 7,000 %, 30/09/29 144A (i) (ii)	USD	562 430	49 213	0,01
Sunac China Holdings Ltd, 7,250 %, 30/09/30 144A (i) (ii)	USD	264 527	22 000	0,01
Times China Holdings Ltd, 5,750 %, 14/01/27 (ii) (v)	USD	200 000	4 590	0,00
Times China Holdings Ltd, 6,200 %, 22/03/26 (ii) (v)	USD	820 000	17 389	0,00
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,350 %, 13/01/27 (ii) (v)	USD	410 000	23 248	0,01

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Immobilier - 0,19 % (31 décembre 2023 : 0,18 %) (suite)				
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 7,700 %, 20/02/25 (ii) (v)	USD	660 000	37 297	0,01
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 7,850 %, 12/08/26 (ii) (v)	USD	210 000	11 802	0,00
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 8,300 %, 27/05/25 (ii) (v)	USD	340 000	19 550	0,00
			988 142	0,19
REIT - 1,61 % (31 décembre 2023 : 1,68 %)				
American Tower Corp, 5,900 %, 15/11/33	USD	1 595 000	1 633 238	0,32
COPT Defense Properties LP, 2,750 %, 15/04/31	USD	320 000	264 572	0,05
EPR Properties, 3,600 %, 15/11/31	USD	450 000	375 156	0,07
GLP Capital LP/GLP Financing II Inc, 3,250 %, 15/01/32	USD	625 000	525 214	0,10
GLP Capital LP/GLP Financing II Inc, 6,750 %, 01/12/33	USD	125 000	131 334	0,03
VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,250 %, 01/12/26 144A (i)	USD	1 085 000	1 046 362	0,21
VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,500 %, 01/09/26 144A (i)	USD	895 000	869 731	0,17
VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,625 %, 15/06/25 144A (i)	USD	770 000	759 933	0,15
Weyerhaeuser Co, 6,875 %, 15/12/33	USD	340 000	371 292	0,07
Weyerhaeuser Co, 7,375 %, 15/03/32	USD	1 989 000	2 223 418	0,44
			8 200 250	1,61
Distributeurs - 0,64 % (31 décembre 2023 : 0,52 %)				
Asbury Automotive Group Inc, 4,625 %, 15/11/29 144A (i)	USD	380 000	351 222	0,07
Dillard's Inc, 7,000 %, 01/12/28	USD	200 000	206 658	0,04
Dillard's Inc, 7,750 %, 15/07/26	USD	130 000	134 448	0,03
Home Depot Inc, 4,950 %, 25/06/34	USD	390 000	385 935	0,07
Lithia Motors Inc, 3,875 %, 01/06/29 144A (i)	USD	1 875 000	1 686 042	0,33
Lithia Motors Inc, 4,375 %, 15/01/31 144A (i)	USD	150 000	133 536	0,03
Marks & Spencer PLC, 7,125 %, 01/12/37 144A (i) (ii)	USD	325 000	345 335	0,07
			3 243 176	0,64
Semi-conducteurs - 3,66 % (31 décembre 2023 : 3,82 %)				
Broadcom Inc, 3,137 %, 15/11/35 144A (i)	USD	1 140 000	912 898	0,18
Broadcom Inc, 3,469 %, 15/04/34 144A (i)	USD	1 075 000	916 431	0,18
Broadcom Inc, 4,150 %, 15/04/32 144A (i)	USD	340 000	313 695	0,06
Broadcom Inc, 4,926 %, 15/05/37 144A (i)	USD	3 890 000	3 658 597	0,72
Entegris Inc, 4,750 %, 15/04/29 144A (i)	USD	1 320 000	1 262 920	0,25
Marvell Technology Inc, 5,950 %, 15/09/33	USD	4 020 000	4 152 051	0,81
Micron Technology Inc, 5,300 %, 15/01/31	USD	565 000	563 727	0,11
Micron Technology Inc, 5,875 %, 09/02/33	USD	1 735 000	1 772 399	0,35
Micron Technology Inc, 5,875 %, 15/09/33	USD	4 690 000	4 799 345	0,94
SK Hynix Inc, 6,375 %, 17/01/28 144A (i) (ii)	USD	295 000	303 520	0,06
			18 655 583	3,66

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Logiciels - 0,66 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Atlassian Corp, 5,250 %, 15/05/29	USD	940 000	940 041	0,19
Atlassian Corp, 5,500 %, 15/05/34	USD	1 610 000	1 595 263	0,31
UKG Inc, 6,875 %, 01/02/31 144A (i)	USD	825 000	835 337	0,16
			3 370 641	0,66
Titres souverains - 21,01 % (31 décembre 2023 : 17,27 %)				
Chile Government International Bond, 3,500 %, 31/01/34 (ii)	USD	1 195 000	1 035 294	0,20
Chile Government International Bond, 3,500 %, 25/01/50 (ii)	USD	1 135 000	814 755	0,16
Dominican Republic International Bond, 4,875 %, 23/09/32 (ii)	USD	1 200 000	1 073 557	0,21
Indonesia Treasury Bond, 6,875 %, 15/04/29 (ii)*	IDR	41 533 000 000	2 527 185	0,50
Mexican Bonos, 7,500 %, 26/05/33 (ii)	MXN	41 376 500	1 946 758	0,38
New Zealand Government Bond, 3,500 %, 14/04/33 (ii)	NZD	4 815 000	2 692 902	0,53
Norway Government Bond, 1,750 %, 13/03/25 144A (i) (ii)	NOK	28 610 000	2 637 655	0,52
Paraguay Government International Bond, 6,000 %, 09/02/36 144A (i) (ii)	USD	650 000	649 721	0,13
Philippine Government International Bond, 2,650 %, 10/12/45 (ii)	USD	1 140 000	747 521	0,15
Philippine Government International Bond, 2,950 %, 05/05/45 (ii)	USD	825 000	571 313	0,11
Qatar Government International Bond, 5,103 %, 23/04/48 (ii)	USD	1 000 000	973 750	0,19
Republic of Colombia, 7,500 %, 02/02/34 (ii)	USD	935 000	935 317	0,18
Republic of Colombia, 8,000 %, 11/14/35 (ii)	USD	1 440 000	1 480 410	0,29
Republic of Poland Government International Bond, 5,500 %, 04/04/53 (ii)	USD	660 000	646 935	0,13
Republic of Poland Government International Bond, 5,500 %, 18/03/54 (ii)	USD	2 530 000	2 449 085	0,48
Republic of South Africa Government Bond, 8,875 %, 28/02/35 (ii)	ZAR	38 325 000	1 767 651	0,35
Republic of South Africa, 4,850 %, 30/09/29 (ii)	USD	455 000	416 452	0,08
Republic of South Africa, 5,875 %, 20/04/32 (ii)	USD	1 480 000	1 372 848	0,27
Republic of Uzbekistan International Bond, 3,700 %, 25/11/30 EMTN (ii)	USD	200 000	164 253	0,03
Republic of Uzbekistan International Bond, 5,375 %, 29/05/27 144A (i) (ii)	EUR	845 000	903 474	0,18
Republic of Uzbekistan International Bond, 6,900 %, 28/02/32 144A (i) (ii)	USD	1 155 000	1 119 669	0,22
Republic of Uzbekistan International Bond, 7,850 %, 12/10/28 144A (i) (ii)	USD	415 000	428 060	0,08
Romanian Government International Bond, 6,375 %, 30/01/34 144A (i) (ii)	USD	1 740 000	1 745 072	0,34
Romanian Government International Bond, 7,125 %, 17/01/33 (ii)	USD	886 000	932 974	0,18
Serbia International Bond, 6,000 %, 12/06/34 144A (i) (ii)	USD	870 000	855 476	0,17
Turkiye Government International Bond, 5,875 %, 21/05/30 (ii)	EUR	1 730 000	1 856 538	0,36
United Arab Emirates Government International Bond, 4,857 %, 02/07/34 144A (i) (ii)	USD	2 310 000	2 303 384	0,45
United Kingdom Treasury, 0,250 %, 31/01/25 (ii)	GBP	2 930 000	3 616 717	0,71

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Titres souverains - 21,01 % (31 décembre 2023 : 17,27 %) (suite)				
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, 15/11/51	USD	4 350 000	2 525 039	0,50
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, 15/08/46	USD	6 690 000	4 459 564	0,87
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, 15/08/53	USD	3 505 000	3 263 894	0,64
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, 15/08/43	USD	18 185 000	17 552 787	3,44
United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, 31/03/26	USD	15 000 000	14 921 484	2,92
United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, 30/04/26	USD	2 575 000	2 578 822	0,51
United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, 31/05/26	USD	23 185 000	23 232 096	4,55
			107 198 412	21,01
Télécommunications - 2,46 % (31 décembre 2023 : 2,57 %)				
Cincinnati Bell Telephone Co LLC, 6,300 %, 01/12/28	USD	40 000	37 522	0,01
CommScope Inc, 4,750 %, 01/09/29 144A (i)	USD	990 000	686 270	0,13
Motorola Solutions Inc, 5,400 %, 04/15/34	USD	1 370 000	1 358 170	0,27
SoftBank Group Corp, 4,625 %, 06/07/28 (ii)	USD	810 000	751 275	0,15
Sprint Capital Corp, 8,750 %, 15/03/32	USD	1 750 000	2 104 921	0,41
Telecom Italia Capital SA, 6,375 %, 15/11/33 144A (i) (ii)	USD	986 000	964 564	0,19
T-Mobile USA Inc, 5,750 %, 15/01/34	USD	6 480 000	6 661 701	1,30
			12 564 423	2,46
Services de transport - 0,09 % (31 décembre 2023 : 0,07 %)				
Rand Parent LLC, 8,500 %, 15/02/30 144A (i)	USD	425 000	429 872	0,09
			429 872	0,09
Camionnage & leasing - 0,17 % (31 décembre 2023 : 0,44 %)				
SMBC Aviation Capital Finance DAC, 5,450 %, 03/05/28 144A (i) (ii)	USD	885 000	885 490	0,17
			885 490	0,17
TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES			**459 669 885**	**90,10**
OBLIGATIONS CONVERTIBLES - 4,46 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 4,81 %)				
Compagnies aériennes - 0,37 % (31 décembre 2023 : 0,39 %)				
Southwest Airlines Co, 1,250 %, 01/05/25	USD	1 880 000	1 881 880	0,37
			1 881 880	0,37
Biotechnologie - 0,35 % (31 décembre 2023 : 0,62 %)				
BioMarin Pharmaceutical Inc, 1,250 %, 05/15/27	USD	1 860 000	1 775 775	0,35
			1 775 775	0,35
Services commerciaux - 0,05 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Shift4 Payments Inc, 0,500 %, 01/08/27	USD	280 000	264 460	0,05
			264 460	0,05
Ordinateurs - 0,04 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Zscaler Inc, 0,125 %, 01/07/25	USD	145 000	194 655	0,04
			194 655	0,04

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS CONVERTIBLES (suite)				
Électricité - 0,27 % (31 décembre 2023 : 0,25 %)				
PPL Capital Funding Inc, 2,875 %, 15/03/28	USD	1 445 000	1 382 143	0,27
			1 382 143	0,27
Santé - 0,43 % (31 décembre 2023 : 0,59 %)				
Teladoc Health Inc, 1,250 %, 01/06/27	USD	2 635 000	2 183 617	0,43
			2 183 617	0,43
Internet - 0,56 % (31 décembre 2023 : 0,67 %)				
Booking Holdings Inc, 0,750 %, 01/05/25	USD	135 000	283 920	0,05
Etsy Inc, 0,125 %, 01/09/27	USD	400 000	334 090	0,06
Etsy Inc, 0,250 %, 15/06/28	USD	955 000	751 053	0,15
Palo Alto Networks Inc, 0,375 %, 01/06/25	USD	70 000	238 504	0,05
Spotify USA Inc, Zero Coupon Bond, 15/03/26	USD	800 000	761 200	0,15
Uber Technologies Inc, 0,875 %, 01/12/28 144A (i)	USD	435 000	517 215	0,10
			2 885 982	0,56
Loisirs - 0,39 % (31 décembre 2023 : 0,18 %)				
Carnival Corp, 5,750 %, 01/12/27 (ii)	USD	1 045 000	1 704 395	0,33
Royal Caribbean Cruises Ltd, 6,000 %, 15/08/25 (ii)	USD	95 000	306 423	0,06
			2 010 818	0,39
Médias - 1,58 % (31 décembre 2023 : 1,70 %)				
DISH Network Corp, 3,375 %, 15/08/26	USD	12 556 000	7 786 731	1,53
Liberty Media Corp-Liberty Formula One, 2,250 %, 15/08/27	USD	245 000	260 015	0,05
			8 046 746	1,58
Produits pharmaceutiques - 0,04 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Jazz Investments I Ltd, 2,000 %, 15/06/26 (ii)	USD	200 000	192 100	0,04
			192 100	0,04
Immobilier - 0,00 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Sunac China Holdings Ltd, 1,000 %, 30/09/32 144A (i) (ii)	USD	225 028	13 502	0,00
			13 502	0,00
Semi-conducteurs - 0,10 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
ON Semiconductor Corp, 0,500 %, 01/03/29	USD	510 000	488 580	0,10
			488 580	0,10
Logiciels - 0,28 % (31 décembre 2023 : 0,33 %)				
Datadog Inc, 0,125 %, 15/06/25	USD	145 000	209 888	0,04
Nutanix Inc, 0,250 %, 01/10/27	USD	165 000	192 390	0,04
Unity Software Inc, Zero Coupon Bond, 15/11/26	USD	1 170 000	1 007 955	0,20
			1 410 233	0,28
TOTAL DES OBLIGATIONS CONVERTIBLES			**22 730 491**	**4,46**
TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES OBLIGATIONS À MOYEN TERME			**482 400 376**	**94,56**

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Actions	Juste valeur USD	% de l'actif net
ACTIONS PRIVILÉGIÉES NON CONVERTIBLES – 0,08 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 0,07 %)				
Constructeurs de logements - 0,00 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Hovnanian Enterprises Inc, 7,625 % (iv)	USD	598	10 931	0,00
			10 931	0,00
REIT - 0,08 % (31 décembre 2023 : 0,07 %)				
Highwoods Properties Inc, 8,625 % (iv)	USD	74	75 663	0,02
Prologis Inc, 8,540 % (iv)*	USD	5 410	294 737	0,06
			370 400	0,08
TOTAL DES ACTIONS PRIVILÉGIÉES NON CONVERTIBLES			**381 331**	**0,08**
ACTIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES - 0,17 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 0,54 %)				
Activités bancaires - 0,12 % (31 décembre 2023 : 0,41 %)				
Bank of America Corp, 7,250 % (iv)	USD	513	613 630	0,12
Wells Fargo & Co, 7,500 % (iv)	USD	3	3 567	0,00
			617 197	0,12
Finance - 0,05 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Apollo Global Management Inc, 6,750 % 31/07/26	USD	4 042	265 196	0,05
			265 196	0,05
TOTAL DES ACTIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES			**882 393**	**0,17**
ACTIONS ORDINAIRES – 0,83 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 0,45 %)				
Biotechnologie - 0,18 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
BioMarin Pharmaceutical Inc	USD	10 904	897 726	0,18
			897 726	0,18
Matériaux de construction - 0,13 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Cemex SAB de CV (ii)	USD	100 505	642 227	0,13
			642 227	0,13
Santé - 0,10 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Elevance Health Inc	USD	979	530 481	0,10
			530 481	0,10
Médias - 0,28 % (31 décembre 2023 : 0,13 %)				
Altice USA Inc	USD	207 260	422 811	0,08
Paramount Global	USD	97 767	1 015 799	0,20
			1 438 610	0,28
Pétrole et gaz - 0,00 % (31 décembre 2023 : 0,16 %)				
Battalion Oil Corp	USD	8 641	28 861	0,00
			28 861	0,00

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Actions	Juste valeur USD	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES (suite)				
Produits pharmaceutiques - 0,14 % (31 décembre 2023 : 0,16 %)				
AbbVie Inc	USD	4 100	703 232	0,14
			703 232	0,14
TOTAL DES ACTIONS ORDINAIRES			**4 241 137**	**0,83**
FONDS D'INVESTISSEMENT : 2,39 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 2,09 %)				
Services commerciaux - 2,39 % (31 décembre 2023 : 2,09 %)				
Loomis Sayles Asia Bond Plus Fund (ii)	USD	1 640	12 198 632	2,39
			12 198 632	2,39
TOTAL DES FONDS D'INVESTISSEMENT			**12 198 632**	**2,39**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (Coût : 539 838 273 USD)			**500 103 869**	**98,03**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS – 0,08 % (31 décembre 2023 : 0,82 %)

Contrats de change à terme en cours - 0,01 % (31 décembre 2023 : 0,20 %)

Date	Montant acheté	Montant vendu	Contrepartie	Plus-value/ (Moins-value) latente USD	% de l'actif net
18/09/24	1 552 580 USD	1 425 000 EUR	Bank of America	19 470	0,00 %
31/07/24	1 413 100 GBP	1 790 031 USD	Brown Brothers Harriman	(3 415)	(0,00 %)
31/07/24	288 009 USD	269 232 EUR	Brown Brothers Harriman	(947)	(0,00 %)
31/07/24	138 913 USD	129 857 EUR	Brown Brothers Harriman	(457)	(0,00 %)
31/07/24	75 965 USD	71 013 EUR	Brown Brothers Harriman	(250)	(0,00 %)
31/07/24	6 798 CHF	7 606 USD	Brown Brothers Harriman	(13)	(0,00 %)
31/07/24	195 CHF	218 USD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	800 844 AUD	535 232 USD	Brown Brothers Harriman	42	0,00 %
31/07/24	507 141 EUR	543 356 USD	Brown Brothers Harriman	937	0,00 %
31/07/24	3 704 675 SGD	2 736 258 USD	Brown Brothers Harriman	1 227	0,00 %

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Contrats de change à terme en cours – 0,01 % (31 décembre 2023 : 0,20 %) (suite)

Date	Montant acheté	Montant vendu	Contrepartie	Plus-value/ (Moins-value) latente USD	% de l'actif net
31/07/24	708 199 EUR	758 772 USD	Brown Brothers Harriman	1 309	0,00 %
31/07/24	2 067 135 EUR	2 214 749 USD	Brown Brothers Harriman	3 821	0,00 %
31/07/24	12 485 820 SGD	9 221 977 USD	Brown Brothers Harriman	4 136	0,00 %
31/07/24	2 956 210 EUR	3 167 313 USD	Brown Brothers Harriman	5 465	0,00 %
31/07/24	3 695 977 EUR	3 959 907 USD	Brown Brothers Harriman	6 832	0,00 %
31/07/24	11 336 498 EUR	12 146 037 USD	Brown Brothers Harriman	20 955	0,01 %
Plus-value latente sur les contrats de change à terme en cours				64 194	0,01 %
Moins-value latente sur les contrats de change à terme en cours				(5 082)	(0,00 %)
Plus-value latente nette sur les contrats de change à terme en cours				**59 112**	**0,01 %**

Contrats à terme normalisés - 0,07 % (31 décembre 2023 : 0,62 %)

Nombre de contrats	Libellé	Contrepartie	Engagement	Plus-value/ (Moins-value) latente	% de l'actif net
(872)	US 10 Year Ultra September 2024 Futures	JP Morgan	97 951 767	(1 047 483)	(0,20 %)
104	US 2 Year Note September 2024 Futures	JP Morgan	21 175 050	63 700	0,01 %
218	US 5 Year Note September 2024 Futures	JP Morgan	23 063 719	170 312	0,03 %
455	US Long Bond September 2024 Futures	JP Morgan	53 129 789	702 399	0,14 %
265	US Ultra Bond September 2024 Futures	JP Morgan	32 769 168	446 926	0,09 %
Plus-value latente sur les contrats à terme normalisés				1 383 337	0,27 %
Moins-value latente sur les contrats à terme normalisés				(1 047 483)	(0,20 %)
Plus-value nette latente sur contrats à terme normalisés				**335 854**	**0,07 %**

Calendrier des investissements	Au 30 juin 2024	
	Juste valeur USD	**% de l'actif net**
Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**501 551 400**	**98,32**
Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**(1 052 565)**	**(0,21)**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS	**500 498 835**	**98,11**
Avoirs nets en banque	7 369 916	1,44
Autres actifs	6 987 155	1,37
Moins autres passifs	(4 704 143)	(0,92)
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES	**510 151 763**	**100,00**

(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 2024.
(iv) Obligations perpétuelles.
(v) 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
MXN :	Peso mexicain
NOK :	Couronne norvégienne
NZD :	Dollar néo-zélandais
SGD :	Dollar de Singapour
USD :	Dollar américain
ZAR :	Rand sud-africain

Analyse de l'actif total	**% de l'actif total**
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle	42,86
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	53,01
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire autres que ceux admis à une cote officielle ou négociés sur un marché réglementé	1,10
Instruments financiers dérivés	0,08
Actif circulant	2,95
	100,00

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME – 95,38 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 94,80 %)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 88,80 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 89,61 %)				
Publicité - 0,82 % (31 décembre 2023 : 0,69 %)				
Advantage Sales & Marketing Inc, 6,500 %, 15/11/28 144A (i)	USD	15 000	13 572	0,21
Neptune Bidco US Inc, 9,290 %, 15/04/29 144A (i)	USD	30 000	28 793	0,46
Stagwell Global LLC, 5,625 %, 15/08/29 144A (i)	USD	10 000	9 241	0,15
			51 606	0,82
Aérospatiale/Défense - 2,78 % (31 décembre 2023 : 2,09 %)				
Bombardier Inc, 6,000 %, 15/02/28 144A (i)	USD	30 000	29 655	0,47
Bombardier Inc, 7,000 %, 01/06/32 144A (i)	USD	5 000	5 069	0,08
Bombardier Inc, 7,125 %, 15/06/26 144A (i)	USD	13 000	13 187	0,21
Bombardier Inc, 7,250 %, 01/07/31 144A (i)	USD	15 000	15 401	0,24
Bombardier Inc, 7,875 %, 15/04/27 144A (i)	USD	5 000	5 013	0,08
Bombardier Inc, 8,750 %, 15/11/30 144A (i)	USD	5 000	5 404	0,09
Spirit AeroSystems Inc, 4,600 %, 15/06/28	USD	5 000	4 683	0,07
Spirit AeroSystems Inc, 9,750 %, 15/11/30 144A (i)	USD	5 000	5 516	0,09
TransDigm Inc, 6,375 %, 01/03/29 144A (i)	USD	10 000	10 050	0,16
TransDigm Inc, 6,625 %, 01/03/32 144A (i)	USD	10 000	10 101	0,16
TransDigm Inc, 6,750 %, 15/08/28 144A (i)	USD	30 000	30 367	0,48
TransDigm Inc, 6,875 %, 15/12/30 144A (i)	USD	20 000	20 417	0,32
TransDigm Inc, 7,125 %, 01/12/31 144A (i)	USD	20 000	20 607	0,33
			175 470	2,78
Compagnies aériennes - 0,77 % (31 décembre 2023 : 1,39 %)				
American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5,750 %, 20/04/29 144A (i) (ii)	USD	40 000	38 915	0,62
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd/HawaiianMiles Loyalty Ltd, 5,750 %, 20/01/26 144A (i) (ii)	USD	10 000	9 514	0,15
			48 429	0,77
Automobile - 0,54 % (31 décembre 2023 : 2,49 %)				
General Motors Financial Co Inc, 5,750 % (iii) (iv)	USD	25 000	23 829	0,38
Tenneco Inc, 8,000 %, 17/11/28 144A (i)	USD	10 000	9 103	0,14
Wheel Pros Inc, 6,500 %, 15/05/29 144A (i)	USD	5 000	902	0,02
			33 834	0,54
Matériaux de construction - 1,39 % (31 décembre 2023 : 0,91 %)				
Builders FirstSource Inc, 5,000 %, 01/03/30 144A (i)	USD	10 000	9 460	0,15
Camelot Return Merger Sub Inc, 8,750 %, 01/08/28 144A (i)	USD	15 000	14 706	0,23
EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer Inc, 6,750 %, 15/07/31 144A (i)	USD	15 000	15 187	0,24
Miter Brands Acquisition Holdco Inc/MIWD Borrower LLC, 6,750 %, 01/04/32 144A (i)	USD	20 000	20 142	0,32
MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp, 5,500 %, 01/02/30 144A (i)	USD	10 000	9 229	0,15
Standard Industries Inc, 4,375 %, 15/07/30 144A (i)	USD	10 000	9 035	0,14

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Matériaux de construction – 1,39 % (31 décembre 2023 : 0,91 %) (suite)				
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp, 7,250 %, 15/01/31 144A (i)	USD	10 000	10 357	0,16
			88 116	1,39
Chimie - 0,45 % (31 décembre 2023 : 0,46 %)				
Ashland Inc, 3,375 %, 01/09/31 144A (i)	USD	10 000	8 415	0,13
ASP Unifrax Holdings Inc, 5,250 %, 30/09/28 144A (i)	USD	5 000	2 738	0,04
Chemours Co, 4,625 %, 15/11/29 144A (i)	USD	15 000	12 915	0,21
Chemours Co, 5,750 %, 15/11/28 144A (i)	USD	5 000	4 616	0,07
			28 684	0,45
Services commerciaux - 1,36 % (31 décembre 2023 : 1,57 %)				
Block Inc, 6,500 %, 15/05/32 144A (i)	USD	50 000	50 670	0,80
Paysafe Finance PLC/Paysafe Holdings US Corp, 4,000 %, 15/06/29 144A (i) (ii)	USD	10 000	9 210	0,15
TriNet Group Inc, 7,125 %, 15/08/31 144A (i)	USD	15 000	15 237	0,24
VT Topco Inc, 8,500 %, 15/08/30 144A (i)	USD	10 000	10 500	0,17
			85 617	1,36
Ordinateurs - 1,88 % (31 décembre 2023 : 1,96 %)				
Fortress Intermediate 3 Inc, 7,500 %, 01/06/31 144A (i)	USD	15 000	15 368	0,24
McAfee Corp, 7,375 %, 15/02/30 144A (i)	USD	10 000	9 238	0,15
NCR Atleos Corp, 9,500 %, 01/04/29 144A (i)	USD	20 000	21 615	0,34
NCR Voyix Corp, 5,000 %, 01/10/28 144A (i)	USD	20 000	18 884	0,30
NCR Voyix Corp, 5,125 %, 15/04/29 144A (i)	USD	5 000	4 709	0,08
Seagate HDD Cayman, 4,091 %, 01/06/29 (ii)	USD	15 000	13 885	0,22
Seagate HDD Cayman, 4,750 %, 01/01/25 (ii)	USD	20 000	19 852	0,31
Seagate HDD Cayman, 8,250 %, 15/12/29 (ii)	USD	10 000	10 725	0,17
Western Digital Corp, 2,850 %, 01/02/29	USD	5 000	4 339	0,07
			118 615	1,88
Cosmétiques/soins personnels - 0,69 % (31 décembre 2023 : 0,44 %)				
Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC, 4,750 %, 15/01/29 144A (i)	USD	30 000	28 513	0,45
Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC, 6,625 %, 15/07/30 144A (i)	USD	15 000	15 222	0,24
			43 735	0,69
Distribution/commerce de gros - 0,42 % (31 décembre 2023 : 0,38 %)				
Resideo Funding Inc, 4,000 %, 01/09/29 144A (i)	USD	30 000	26 441	0,42
			26 441	0,42
Électricité - 0,54 % (31 décembre 2023 : 0,57 %)				
Calpine Corp, 4,500 %, 15/02/28 144A (i)	USD	15 000	14 252	0,23
PG&E Corp, 5,000 %, 01/07/28	USD	15 000	14 432	0,23
Talen Energy Supply LLC, 8,625 %, 01/06/30 144A (i)	USD	5 000	5 331	0,08
			34 015	0,54

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Électronique - 0,87 % (31 décembre 2023 : 0,81 %)				
Sensata Technologies BV, 5,000 %, 01/10/25 144A (i) (ii)	USD	20 000	20 164	0,32
Sensata Technologies Inc, 3,750 %, 15/02/31 144A (i)	USD	40 000	34 864	0,55
			55 028	0,87
Divertissements - 1,26 % (31 décembre 2023 : 1,52 %)				
Light & Wonder International Inc, 7,000 %, 15/05/28 144A (i)	USD	10 000	10 052	0,16
Light & Wonder International Inc, 7,250 %, 15/11/29 144A (i)	USD	35 000	35 746	0,57
Light & Wonder International Inc, 7,500 %, 01/09/31 144A (i)	USD	5 000	5 166	0,08
Mohegan Tribal Gaming Authority, 8,000 %, 01/02/26 144A (i)	USD	5 000	4 740	0,07
SeaWorld Parks & Entertainment Inc, 5,250 %, 15/08/29 144A (i)	USD	10 000	9 449	0,15
Speedway Motorsports LLC/Speedway Funding II Inc, 4,875 %, 01/11/27 144A (i)	USD	15 000	14 271	0,23
			79 424	1,26
Gestion de l'environnement - 1,05 % (31 décembre 2023 : 1,13 %)				
Clean Harbors Inc, 5,125 %, 15/07/29 144A (i)	USD	5 000	4 803	0,08
Clean Harbors Inc, 6,375 %, 01/02/31 144A (i)	USD	10 000	10 026	0,16
GFL Environmental Inc, 4,000 %, 01/08/28 144A (i)	USD	20 000	18 588	0,29
GFL Environmental Inc, 6,750 %, 15/01/31 144A (i)	USD	5 000	5 101	0,08
Madison IAQ LLC, 5,875 %, 30/06/29 144A (i)	USD	10 000	9 304	0,15
Reworld Holding Corp, 4,875 %, 01/12/29 144A (i)	USD	20 000	18 255	0,29
			66 077	1,05
Finance - 5,34 % (31 décembre 2023 : 5,91 %)				
Aircastle Ltd, 5,250 % 144A (i) (ii) (iii) (iv)	USD	5 000	4 821	0,08
Coinbase Global Inc, 3,375 %, 01/10/28 144A (i)	USD	20 000	17 147	0,27
Freedom Mortgage Holdings LLC, 9,125 %, 15/05/31 144A (i)	USD	5 000	4 866	0,08
Freedom Mortgage Holdings LLC, 9,250 %, 01/02/29 144A (i)	USD	10 000	9 994	0,16
GGAM Finance Ltd, 6,875 %, 15/04/29 144A (i) (ii)	USD	10 000	10 175	0,16
Macquarie Airfinance Holdings Ltd, 6,400 %, 26/03/29 144A (i) (ii)	USD	5 000	5 085	0,08
Macquarie Airfinance Holdings Ltd, 6,500 %, 26/03/31 144A (i) (ii)	USD	20 000	20 566	0,33
Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5,000 %, 01/02/26 144A (i)	USD	15 000	14 681	0,23
Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5,125 %, 15/12/30 144A (i)	USD	15 000	13 755	0,22
Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5,750 %, 15/11/31 144A (i)	USD	10 000	9 399	0,15
Nationstar Mortgage Holdings Inc, 6,000 %, 15/01/27 144A (i)	USD	5 000	4 947	0,08
Navient Corp, 4,875 %, 15/03/28	USD	15 000	13 766	0,22
Navient Corp, 5,625 %, 01/08/33	USD	20 000	15 966	0,25
OneMain Finance Corp, 3,500 %, 15/01/27	USD	30 000	28 108	0,44
OneMain Finance Corp, 4,000 %, 15/09/30	USD	5 000	4 291	0,07
OneMain Finance Corp, 5,375 %, 15/11/29	USD	5 000	4 689	0,07
OneMain Finance Corp, 7,125 %, 15/03/26	USD	35 000	35 565	0,56
Provident Funding Associates LP/PFG Finance Corp, 6,375 %, 15/06/25 144A (i)	USD	10 000	9 715	0,15

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Finance - 5,34 % (31 décembre 2023 : 5,91 %) (suite)				
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 3,875 %, 01/03/31 144A (i)	USD	10 000	8 715	0,14
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 4,000 %, 15/10/33 144A (i)	USD	120 000	101 123	1,60
			337 374	5,34
Alimentation - 1,20 % (31 décembre 2023 : 0,95 %)				
Fiesta Purchaser Inc, 7,875 %, 01/03/31 144A (i)	USD	10 000	10 333	0,16
Lamb Weston Holdings Inc, 4,125 %, 31/01/30 144A (i)	USD	10 000	9 081	0,15
Lamb Weston Holdings Inc, 4,375 %, 31/01/32 144A (i)	USD	20 000	17 837	0,28
Lamb Weston Holdings Inc, 4,875 %, 15/05/28 144A (i)	USD	10 000	9 685	0,15
Post Holdings Inc, 5,500 %, 15/12/29 144A (i)	USD	5 000	4 824	0,08
Post Holdings Inc, 6,250 %, 15/02/32 144A (i)	USD	15 000	15 038	0,24
Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 4,625 %, 01/03/29 144A (i)	USD	10 000	8 794	0,14
			75 592	1,20
Gaz - 0,08 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finance Corp, 9,375 %, 01/06/28 144A (i)	USD	5 000	5 132	0,08
			5 132	0,08
Santé - 4,21 % (31 décembre 2023 : 4,16 %)				
Bausch + Lomb Corp, 8,375 %, 01/10/28 144A (i)	USD	30 000	30 712	0,49
CHS/Community Health Systems Inc, 5,250 %, 15/05/30 144A (i)	USD	30 000	24 735	0,39
Concentra Escrow Issuer Corp, 6,875 %, 15/07/32 144A (i)	USD	10 000	10 132	0,16
DaVita Inc, 3,750°%, 15/02/31 144A (i)	USD	40 000	34 118	0,54
Hologic Inc, 3,250 %, 15/02/29 144A (i)	USD	5 000	4 486	0,07
Hologic Inc, 4,625 %, 01/02/28 144A (i)	USD	10 000	9 568	0,15
LifePoint Health Inc, 5,375 %, 15/01/29 144A (i)	USD	30 000	26 361	0,42
Medline Borrower LP, 3,875 %, 01/04/29 144A (i)	USD	15 000	13 814	0,22
Medline Borrower LP/Medline Co-Issuer Inc, 6,250 %, 01/04/29 144A (i)	USD	30 000	30 339	0,48
Molina Healthcare Inc, 3,875 %, 15/11/30 144A (i)	USD	5 000	4 445	0,07
Molina Healthcare Inc, 3,875 %, 15/05/32 144A (i)	USD	20 000	17 330	0,27
Molina Healthcare Inc, 4,375 %, 15/06/28 144A (i)	USD	15 000	14 118	0,22
Neogen Food Safety Corp, 8,625 %, 20/07/30 144A (i)	USD	10 000	10 796	0,17
Radiology Partners Inc, 7,775 %, 31/01/29 144A (i)	USD	9 062	8 496	0,14
Star Parent Inc, 9,000 %, 01/10/30 144A (i)	USD	25 000	26 247	0,42
			265 697	4,21
Articles ménagers - 0,39 % (31 décembre 2023 : 0,36 %)				
Newell Brands Inc, 5,700 %, 01/04/26	USD	25 000	24 693	0,39
			24 693	0,39
Assurance - 4,45 % (31 décembre 2023 : 2,18 %)				
Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc, 4,250 %, 15/02/29 144A (i)	USD	35 000	31 794	0,50
Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc, 8,250 %, 01/02/29 144A (i)	USD	20 000	20 097	0,32

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Assurance - 4,45 % (31 décembre 2023 : 2,18 %) (suite)				
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6,750 %, 15/10/27 144A (i)	USD	10 000	9 863	0,16
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 7,000 %, 15/01/31 144A (i)	USD	25 000	25 256	0,40
AmWINS Group Inc, 6,375 %, 15/02/29 144A (i)	USD	30 000	30 082	0,48
Baldwin Insurance Group Holdings LLC/Baldwin Insurance Group Holdings Finance, 7,125 %, 15/05/31 144A (i)	USD	30 000	30 348	0,48
HUB International Ltd, 7,250 %, 15/06/30 144A (i)	USD	55 000	56 382	0,89
Liberty Mutual Group Inc, 4,300 %, 01/02/61 144A (i)	USD	35 000	21 801	0,34
Panther Escrow Issuer LLC, 7,125 %, 01/06/31 144A (i)	USD	30 000	30 343	0,48
USI Inc, 7,500 %, 15/01/32 144A (i)	USD	25 000	25 391	0,40
			281 357	4,45
Internet - 2,81 % (31 décembre 2023 : 2,70 %)				
ANGI Group LLC, 3,875 %, 15/08/28 144A (i)	USD	10 000	8 592	0,14
Arches Buyer Inc, 4,250 %, 01/06/28 144A (i)	USD	15 000	13 393	0,21
Arches Buyer Inc, 6,125 %, 01/12/28 144A (i)	USD	5 000	4 148	0,06
Newfold Digital Holdings Group Inc, 11,750 %, 15/10/28 144A (i)	USD	15 000	15 526	0,25
Uber Technologies Inc, 4,500 %, 15/08/29 144A (i)	USD	130 000	123 863	1,96
Ziff Davis Inc, 4,625 %, 15/10/30 144A (i)	USD	13 000	11 754	0,19
			177 276	2,81
Sociétés d'investissement - 1,07 % (31 décembre 2023 : 1,51 %)				
Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 4,375 %, 01/02/29	USD	30 000	25 651	0,40
Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 5,250 %, 15/05/27	USD	45 000	42 238	0,67
			67 889	1,07
Fer/Acier - 1,53 % (31 décembre 2023 : 1,16 %)				
ATI Inc, 4,875 %, 01/10/29	USD	10 000	9 348	0,15
ATI Inc, 7,250 %, 15/08/30	USD	5 000	5 161	0,08
Cleveland-Cliffs Inc, 7,000 %, 15/03/32 144A (i)	USD	20 000	19 774	0,31
Commercial Metals Co, 4,125 %, 15/01/30	USD	25 000	22 853	0,36
Commercial Metals Co, 4,375 %, 15/03/32	USD	10 000	9 016	0,14
Mineral Resources Ltd, 8,000 %, 01/11/27 144A (i) (ii)	USD	5 000	5 101	0,08
Mineral Resources Ltd, 8,125 %, 01/05/27 144A (i) (ii)	USD	15 000	15 117	0,24
Mineral Resources Ltd, 9,250 %, 01/10/28 144A (i) (ii)	USD	10 000	10 495	0,17
			96 865	1,53
Loisirs - 4,73 % (31 décembre 2023 : 4,65 %)				
Carnival Corp, 5,750 %, 01/03/27 144A (i) (ii)	USD	55 000	54 336	0,86
Carnival Corp, 6,000 %, 01/05/29 144A (i) (ii)	USD	35 000	34 574	0,55
NCL Corp Ltd, 5,875 %, 15/03/26 144A (i) (ii)	USD	50 000	49 431	0,78
Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700 %, 15/03/28 (ii)	USD	15 000	14 018	0,22
Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, 01/07/26 144A (i) (ii)	USD	40 000	38 712	0,61

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Loisirs – 4,73 % (31 décembre 2023 : 4,65 %) (suite)				
Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,500 %, 01/04/28 144A (i) (ii)	USD	40 000	39 490	0,63
Sabre GLBL Inc, 8,625 %, 01/06/27 144A (i)	USD	5 000	4 606	0,07
Sabre GLBL Inc, 11,250 %, 15/12/27 144A (i)	USD	15 000	14 581	0,23
Viking Cruises Ltd, 5,875 %, 15/09/27 144A (i) (ii)	USD	10 000	9 896	0,16
Viking Cruises Ltd, 7,000 %, 15/02/29 144A (i) (ii)	USD	5 000	5 026	0,08
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 5,625 %, 15/02/29 144A (i) (ii)	USD	25 000	24 439	0,39
VOC Escrow Ltd, 5,000 %, 15/02/28 144A (i) (ii)	USD	10 000	9 694	0,15
			298 803	4,73
Hébergement - 3,31 % (31 décembre 2023 : 3,04 %)				
Hilton Domestic Operating Co Inc, 3,625 %, 15/02/32 144A (i)	USD	35 000	30 288	0,48
Hilton Domestic Operating Co Inc, 5,875 %, 01/04/29 144A (i)	USD	15 000	15 020	0,24
Hilton Domestic Operating Co Inc, 6,125 %, 01/04/32 144A (i)	USD	15 000	15 073	0,24
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 4,875 %, 01/07/31 144A (i)	USD	5 000	4 426	0,07
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 6,625 %, 15/01/32 144A (i)	USD	60 000	60 281	0,95
Marriott Ownership Resorts Inc, 4,500 %, 15/06/29 144A (i)	USD	55 000	50 537	0,80
Travel + Leisure Co, 4,625 %, 01/03/30 144A (i)	USD	15 000	13 651	0,22
Travel + Leisure Co, 6,000 %, 01/04/27	USD	20 000	19 958	0,31
			209 234	3,31
Matériels divers - 0,52 % (31 décembre 2023 : 0,46 %)				
Esab Corp, 6,250 %, 15/04/29 144A (i)	USD	10 000	10 060	0,16
GrafTech Finance Inc, 4,625 %, 15/12/28 144A (i)	USD	30 000	19 017	0,30
GrafTech Global Enterprises Inc, 9,875 %, 15/12/28 144A (i)	USD	5 000	3 680	0,06
			32 757	0,52
Médias - 9,63 % (31 décembre 2023 : 11,51 %)				
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,250 %, 01/02/31 144A (i)	USD	50 000	40 811	0,65
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,250 %, 15/01/34 144A (i)	USD	160 000	121 449	1,92
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, 15/08/30 144A (i)	USD	65 000	55 027	0,87
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, 01/05/32	USD	5 000	4 027	0,06
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, 01/06/33 144A (i)	USD	20 000	15 742	0,25
CSC Holdings LLC, 3,375 %, 15/02/31 144A (i)	USD	200 000	124 818	1,98
CSC Holdings LLC, 4,625 %, 01/12/30 144A (i)	USD	225 000	81 945	1,30
Directv Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor Inc, 5,875 %, 15/08/27 144A (i)	USD	85 000	79 950	1,27
DISH DBS Corp, 5,125 %, 01/06/29	USD	50 000	19 801	0,31
DISH DBS Corp, 5,750 %, 01/12/28 144A (i)	USD	15 000	10 400	0,16
DISH DBS Corp, 7,375 %, 01/07/28	USD	40 000	17 011	0,27

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Médias - 9,63 % (31 décembre 2023 : 11,51 %) (suite)				
DISH DBS Corp, 7,750 %, 01/07/26	USD	40 000	24 831	0,39
DISH Network Corp, 11,750 %, 15/11/27 144A (i)	USD	5 000	4 903	0,08
iHeartCommunications Inc, 4,750 %, 15/01/28 144A (i)	USD	15 000	7 598	0,12
			608 313	9,63
Métaux - façonnage et matériel - 0,08 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Advanced Drainage Systems Inc, 6,375 %, 15/06/30 144A (i)	USD	5 000	5 018	0,08
			5 018	0,08
Exploitation minière - 0,37 % (31 décembre 2023 : 0,55 %)				
Novelis Corp, 4,750 %, 30/01/30 144A (i)	USD	25 000	23 193	0,37
			23 193	0,37
Matériel de bureau/d'entreprise - 0,64 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Pitney Bowes Inc, 6,875 %, 15/03/27 144A (i)	USD	5 000	4 723	0,08
Zebra Technologies Corp, 6,500 %, 01/06/32 144A (i)	USD	35 000	35 394	0,56
			40 117	0,64
Pétrole et gaz - 9,14 % (31 décembre 2023 : 9,38 %)				
Antero Resources Corp, 5,375 %, 01/03/30 144A (i)	USD	15 000	14 516	0,23
Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 7,000 %, 01/11/26 144A (i)	USD	25 000	25 017	0,40
Baytex Energy Corp, 8,500 %, 30/04/30 144A (i)	USD	10 000	10 458	0,17
Chesapeake Energy Corp, 5,500 %, 01/02/26 144A (i)	USD	30 000	29 712	0,47
Chesapeake Energy Corp, 5,875 %, 01/02/29 144A (i)	USD	5 000	4 950	0,08
Chesapeake Energy Corp, 6,750 %, 15/04/29 144A (i)	USD	10 000	10 019	0,16
Civitas Resources Inc, 8,375 %, 01/07/28 144A (i)	USD	25 000	26 196	0,41
Civitas Resources Inc, 8,625 %, 01/11/30 144A (i)	USD	5 000	5 361	0,08
Crescent Energy Finance LLC, 7,375 %, 15/01/33 144A (i)	USD	15 000	15 032	0,24
Crescent Energy Finance LLC, 9,250 %, 15/02/28 144A (i)	USD	10 000	10 565	0,17
CVR Energy Inc, 8,500 %, 15/01/29 144A (i)	USD	20 000	20 082	0,32
Diamond Foreign Asset Co/Diamond Finance LLC, 8,500 %, 01/10/30 144A (i) (ii)	USD	10 000	10 497	0,17
Ecopetrol SA, 8,375 %, 01/19/36 (ii)	USD	20 000	19 645	0,31
Energean Israel Finance Ltd, 4,875 %, 30/03/26 144A (i) (ii)	USD	20 000	18 850	0,30
Gulfport Energy Corp, 8,000 %, 17/05/26 144A (i)	USD	5 000	5 056	0,08
Leviathan Bond Ltd, 6,750 %, 30/06/30 144A (i) (ii)	USD	25 000	22 288	0,35
Matador Resources Co, 5,875 %, 15/09/26	USD	10 000	9 984	0,16
Matador Resources Co, 6,500 %, 15/04/32 144A (i)	USD	25 000	25 002	0,40
Matador Resources Co, 6,875 %, 15/04/28 144A (i)	USD	10 000	10 150	0,16
Mesquite Energy Inc, 6,125 %, 15/01/24	USD	420 000	17 850	0,28
Northern Oil & Gas Inc, 8,125 %, 01/03/28 144A (i)	USD	30 000	30 339	0,48
Northern Oil & Gas Inc, 8,750 %, 15/06/31 144A (i)	USD	5 000	5 246	0,08
Parkland Corp, 4,500 %, 01/10/29 144A (i)	USD	20 000	18 306	0,29
Parkland Corp, 4,625 %, 01/05/30 144A (i)	USD	15 000	13 681	0,22
Parkland Corp, 5,875 %, 15/07/27 144A (i)	USD	5 000	4 935	0,08

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Pétrole et gaz - 9,14 % (31 décembre 2023 : 9,38 %) (suite)				
Permian Resources Operating LLC, 5,375 %, 15/01/26 144A (i)	USD	5 000	4 945	0,08
Permian Resources Operating LLC, 5,875 %, 01/07/29 144A (i)	USD	25 000	24 617	0,39
Permian Resources Operating LLC, 7,000 %, 15/01/32 144A (i)	USD	10 000	10 273	0,16
Range Resources Corp, 8,250 %, 15/01/29	USD	10 000	10 362	0,16
Sitio Royalties Operating Partnership LP/Sitio Finance Corp, 7,875 %, 01/11/28 144A (i)	USD	35 000	36 189	0,57
SM Energy Co, 5,625 %, 01/06/25	USD	10 000	9 957	0,16
SM Energy Co, 6,750 %, 15/09/26	USD	10 000	10 003	0,16
Strathcona Resources Ltd, 6,875 %, 01/08/26 144A (i)	USD	5 000	4 948	0,08
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp, 4,500 %, 15/05/29	USD	5 000	4 676	0,07
Transocean Aquila Ltd, 8,000 %, 30/09/28 144A (i) (ii)	USD	5 000	5 078	0,08
Transocean Inc, 8,000 %, 01/02/27 144A (i) (ii)	USD	13 000	12 955	0,21
Transocean Poseidon Ltd, 6,875 %, 01/02/27 144A (i) (ii)	USD	33 750	33 708	0,53
Transocean Titan Financing Ltd, 8,375 %, 01/02/28 144A (i) (ii)	USD	15 000	15 481	0,24
Vital Energy Inc, 7,875 %, 15/04/32 144A (i)	USD	10 000	10 166	0,16
			577 095	9,14
Services pétroliers et gaziers - 0,64 % (31 décembre 2023 : 0,30 %)				
Oceaneering International Inc, 6,000 %, 01/02/28	USD	5 000	4 943	0,08
Solaris Midstream Holdings LLC, 7,625 %, 01/04/26 144A (i)	USD	10 000	10 035	0,16
USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp, 7,125 %, 15/03/29 144A (i)	USD	10 000	10 076	0,16
Weatherford International Ltd, 8,625 %, 30/04/30 144A (i) (ii)	USD	15 000	15 543	0,24
			40 597	0,64
Emballages - 0,15 % (31 décembre 2023 : 0,21 %)				
Graham Packaging Co Inc, 7,125 %, 15/08/28 144A (i)	USD	5 000	4 724	0,07
Mauser Packaging Solutions Holding Co, 9,250 %, 15/04/27 144A (i)	USD	5 000	5 003	0,08
			9 727	0,15
Produits pharmaceutiques - 3,67 % (31 décembre 2023 : 3,79 %)				
Bausch Health Cos Inc, 4,875 %, 01/06/28 144A (i)	USD	70 000	52 385	0,83
Bausch Health Cos Inc, 6,125 %, 01/02/27 144A (i)	USD	15 000	12 487	0,20
HLF Financing Sarl LLC/Herbalife International Inc, 4,875 %, 01/06/29 144A (i)	USD	5 000	3 464	0,05
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, 01/10/26 (ii)	USD	70 000	65 698	1,04
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, 01/10/46 (ii)	USD	140 000	97 784	1,55
			231 818	3,67
Conduites d'hydrocarbures - 5,82 % (31 décembre 2023 : 4,67 %)				
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp, 5,375 %, 15/06/29 144A (i)	USD	20 000	19 387	0,31
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp, 6,625 %, 01/02/32 144A (i)	USD	20 000	20 180	0,32

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Conduites d'hydrocarbures – 5,82 % (31 décembre 2023 : 4,67 %) (suite)				
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp, 7,000 %, 15/07/29 144A (i)	USD	10 000	10 184	0,16
Delek Logistics Partners LP/Delek Logistics Finance Corp, 8,625 %, 15/03/29 144A (i)	USD	15 000	15 436	0,24
Enterprise Products Operating LLC, 5,250 %, 16/08/77 (iii)	USD	25 000	23 908	0,38
EQM Midstream Partners LP, 4,750 %, 15/01/31 144A (i)	USD	5 000	4 675	0,07
EQM Midstream Partners LP, 5,500 %, 15/07/28	USD	10 000	9 847	0,16
EQM Midstream Partners LP, 6,500 %, 01/07/27 144A (i)	USD	35 000	35 376	0,56
EQM Midstream Partners LP, 7,500 %, 01/06/27 144A (i)	USD	15 000	15 318	0,24
Global Partners LP/GLP Finance Corp, 8,250 %, 15/01/32 144A (i)	USD	5 000	5 139	0,08
Hess Midstream Operations LP, 4,250 %, 15/02/30 144A (i)	USD	15 000	13 769	0,22
Hess Midstream Operations LP, 5,125 %, 15/06/28 144A (i)	USD	65 000	62 937	1,00
Hess Midstream Operations LP, 5,625 %, 15/02/26 144A (i)	USD	5 000	4 962	0,08
Kinetik Holdings LP, 5,875 %, 15/06/30 144A (i)	USD	20 000	19 708	0,31
Kinetik Holdings LP, 6,625 %, 15/12/28 144A (i)	USD	25 000	25 399	0,40
New Fortress Energy Inc, 6,500 %, 30/09/26 144A (i)	USD	15 000	13 800	0,22
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 3,875 %, 01/11/33 144A (i)	USD	35 000	29 824	0,47
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4,125 %, 15/08/31 144A (i)	USD	25 000	22 434	0,35
Venture Global LNG Inc, 8,375 %, 01/06/31 144A (i)	USD	15 000	15 559	0,25
			367 842	5,82
REIT - 1,90 % (31 décembre 2023 : 2,08 %)				
Hudson Pacific Properties LP, 3,950 %, 01/11/27	USD	10 000	8 363	0,13
Iron Mountain Inc, 4,500 %, 15/02/31 144A (i)	USD	10 000	9 027	0,14
Iron Mountain Inc, 4,875 %, 15/09/29 144A (i)	USD	45 000	42 405	0,67
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, 3,500 %, 15/03/31	USD	20 000	13 032	0,21
Service Properties Trust, 8,625 %, 15/11/31 144A (i)	USD	20 000	20 846	0,33
Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 4,750 %, 15/04/28 144A (i)	USD	20 000	16 353	0,26
Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 10,500 %, 15/02/28 144A (i)	USD	10 000	9 793	0,16
			119 819	1,90
Distributeurs - 3,93 % (31 décembre 2023 : 4,95 %)				
1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 3,875 %, 15/01/28 144A (i)	USD	45 000	42 147	0,67
1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 4,000 %, 15/10/30 144A (i)	USD	20 000	17 606	0,28
1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 6,125 %, 15/06/29 144A (i)	USD	25 000	25 091	0,40
Asbury Automotive Group Inc, 4,500 %, 01/03/28	USD	10 000	9 475	0,15
Asbury Automotive Group Inc, 4,625 %, 15/11/29 144A (i)	USD	5 000	4 621	0,07
Bath & Body Works Inc, 5,250 %, 01/02/28	USD	5 000	4 854	0,08
Bath & Body Works Inc, 6,625 %, 01/10/30 144A (i)	USD	5 000	5 016	0,08

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Distributeurs – 3,93 % (31 décembre 2023 : 4,95 %) (suite)				
Beacon Roofing Supply Inc, 6,500 %, 01/08/30 144A (i)	USD	20 000	20 180	0,32
Bloomin' Brands Inc/OSI Restaurant Partners LLC, 5,125 %, 15/04/29 144A (i)	USD	10 000	9 004	0,14
Ferrellgas LP/Ferrellgas Finance Corp, 5,375 %, 01/04/26 144A (i)	USD	15 000	14 674	0,23
Foundation Building Materials Inc, 6,000 %, 03/01/29 144A (i)	USD	15 000	13 312	0,21
LBM Acquisition LLC, 6,250 %, 15/01/29 144A (i)	USD	10 000	8 839	0,14
NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC, 7,125 %, 01/04/26 144A (i)	USD	10 000	9 879	0,16
Papa John's International Inc, 3,875 %, 15/09/29 144A (i)	USD	25 000	22 127	0,35
Park River Holdings Inc, 5,625 %, 01/02/29 144A (i)	USD	5 000	3 953	0,06
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp, 6,375 %, 30/09/26 144A (i)	USD	20 000	19 650	0,31
Yum! Brands Inc, 3,625 %, 15/03/31	USD	10 000	8 825	0,14
Yum! Brands Inc, 4,625 %, 31/01/32	USD	10 000	9 197	0,14
			248 450	3,93
Logiciels - 1,46 % (31 décembre 2023 : 1,15 %)				
AthenaHealth Group Inc, 6,500 %, 15/02/30 144A (i)	USD	10 000	9 207	0,14
Cloud Software Group Inc, 6,500 %, 31/03/29 144A (i)	USD	25 000	24 008	0,38
Cloud Software Group Inc, 9,000 %, 30/09/29 144A (i)	USD	20 000	19 404	0,31
Elastic NV, 4,125 %, 15/07/29 144A (i) (ii)	USD	20 000	18 261	0,29
Rackspace Technology Global Inc, 5,375 %, 01/12/28 144A (i)	USD	5 000	1 366	0,02
UKG Inc, 6,875 %, 01/02/31 144A (i)	USD	20 000	20 251	0,32
			92 497	1,46
Titres souverains - 4,76 % (31 décembre 2023 : 1,76 %)				
United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, 30/04/26	USD	300 000	300 445	4,76
			300 445	4,76
Télécommunications - 1,59 % (31 décembre 2023 : 3,00 %)				
CommScope Inc, 4,750 %, 01/09/29 144A (i)	USD	10 000	6 932	0,11
CommScope Inc, 6,000 %, 01/03/26 144A (i)	USD	10 000	8 776	0,14
CommScope Technologies LLC, 5,000 %, 15/03/27 144A (i)	USD	25 000	10 322	0,16
Frontier Communications Holdings LLC, 5,000 %, 01/05/28 144A (i)	USD	25 000	23 552	0,37
Frontier Communications Holdings LLC, 5,875 %, 15/10/27 144A (i)	USD	30 000	29 289	0,47
Frontier Communications Holdings LLC, 8,750 %, 15/05/30 144A (i)	USD	5 000	5 152	0,08
GoTo Group Inc, 5,500 %, 01/05/28 144A (i)	USD	8 085	6 389	0,10
GoTo Group Inc, 5,500 %, 01/05/28 144A (i)	USD	11 165	4 466	0,07
Lumen Technologies Inc, 4,125 %, 15/04/29 144A (i)	USD	4 250	2 763	0,05
Lumen Technologies Inc, 4,125 %, 15/04/30 144A (i)	USD	4 250	2 657	0,04
			100 298	1,59

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Services de transport - 0,56 % (31 décembre 2023 : 0,84 %)				
Rand Parent LLC, 8,500 %, 15/02/30 144A (i)	USD	35 000	35 401	0,56
			35 401	0,56
TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES			**5 608 390**	**88,80**
OBLIGATIONS CONVERTIBLES - 6,58 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 5,19 %)				
Biotechnologie - 0,76 % (31 décembre 2023 : 1,03 %)				
BioMarin Pharmaceutical Inc, 1,250 %, 05/15/27	USD	50 000	47 736	0,76
			47 736	0,76
Services commerciaux - 0,07 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Shift4 Payments Inc, 0,500 %, 01/08/27	USD	5 000	4 723	0,07
			4 723	0,07
Ordinateurs - 0,40 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
CyberArk Software Ltd, Zero Coupon Bond, 15/11/24 (ii)	USD	5 000	8 685	0,14
Insight Enterprises Inc, 0,750 %, 15/02/25	USD	1 000	2 903	0,04
Seagate HDD Cayman, 3,500 %, 01/06/28 144A (i) (ii)	USD	5 000	6 823	0,11
Zscaler Inc, 0,125 %, 01/07/25	USD	5 000	6 712	0,11
			25 123	0,40
Électricité - 0,08 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
PG&E Corp, 4,250 %, 01/12/27 144A (i)	USD	5 000	5 043	0,08
			5 043	0,08
Santé - 0,09 % (31 décembre 2023 : 0,93 %)				
Insulet Corp, 0,375 %, 01/09/26	USD	5 000	5 452	0,09
			5 452	0,09
Internet - 0,36 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Booking Holdings Inc, 0,750 %, 01/05/25	USD	5 000	10 516	0,17
Uber Technologies Inc, 0,875 %, 01/12/28 144A (i)	USD	5 000	5 945	0,09
Zillow Group Inc, 1,375 %, 01/09/26	USD	5 000	6 028	0,10
			22 489	0,36
Fer/Acier - 0,04 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
United States Steel Corp, 5,000 %, 01/11/26	USD	1 000	2 844	0,04
			2 844	0,04
Loisirs - 0,26 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Carnival Corp, 5,750 %, 01/12/27 (ii)	USD	10 000	16 310	0,26
			16 310	0,26
Matériels divers - 0,08 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Middleby Corp, 1,000 %, 01/09/25	USD	5 000	5 324	0,08
			5 324	0,08
Médias - 3,20 % (31 décembre 2023 : 2,35 %)				
DISH Network Corp, 3,375 %, 15/08/26	USD	295 000	182 947	2,89
DISH Network Corp, Zero Coupon Bond, 15/12/25	USD	5 000	3 676	0,06

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS CONVERTIBLES (suite)				
Médias - 3,20 % (31 décembre 2023 : 2,35 %) (suite)				
Liberty Media Corp, 3,750 %, 15/03/28	USD	5 000	5 200	0,08
Liberty Media Corp-Liberty Formula One, 2,250 %, 15/08/27	USD	10 000	10 613	0,17
			202 436	3,20
Fabricants divers - 0,11 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Axon Enterprise Inc, 0,500 %, 15/12/27	USD	5 000	6 860	0,11
			6 860	0,11
Pétrole et gaz - 0,27 % (31 décembre 2023 : 0,26 %)				
Northern Oil & Gas Inc, 3,625 %, 15/04/29	USD	15 000	17 265	0,27
			17 265	0,27
Semi-conducteurs - 0,41 % (31 décembre 2023 : 0,10 %)				
ON Semiconductor Corp, 0,500 %, 01/03/29	USD	10 000	9 580	0,15
Wolfspeed Inc, 1,875 %, 01/12/29	USD	30 000	16 530	0,26
			26 110	0,41
Logiciels - 0,45 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Akamai Technologies Inc, 1,125 %, 15/02/29 144A (i)	USD	5 000	4 727	0,08
Datadog Inc, 0,125 %, 15/06/25	USD	5 000	7 237	0,12
Dropbox Inc, Zero Coupon Bond, 01/03/28	USD	5 000	4 547	0,07
Nutanix Inc, 0,250 %, 01/10/27	USD	5 000	5 830	0,09
Vertex Inc, 0,750 %, 01/05/29 144A (i)	USD	5 000	5 957	0,09
			28 298	0,45
TOTAL DES OBLIGATIONS CONVERTIBLES			**416 013**	**6,58**
TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES OBLIGATIONS À MOYEN TERME			**6 024 403**	**95,38**

		Actions	Juste valeur USD	% de l'actif net
ACTIONS PRIVILÉGIÉES NON CONVERTIBLES – 0,73 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 0,66 %)				
REIT - 0,73 % (31 décembre 2023 : 0,66 %)				
Highwoods Properties Inc, 8,625 % (iv)	USD	45	46 012	0,73
			46 012	0,73
TOTAL DES ACTIONS PRIVILÉGIÉES NON CONVERTIBLES			**46 012**	**0,73**
ACTIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES - 0,13 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 0,30 %)				
Électricité - 0,04 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
NextEra Energy Inc, 7,299 % 01/06/27	USD	50	2 459	0,04
			2 459	0,04

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Actions	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES (suite)				
Finance - 0,09 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Apollo Global Management Inc, 6,750 % 31/07/26	USD	91	5 971	0,09
			5 971	0,09
TOTAL DES ACTIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES			**8 430**	**0,13**
ACTIONS ORDINAIRES – 0,01 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 0,03 %)				
Pétrole et gaz - 0,01 % (31 décembre 2023 : 0,03 %)				
Battalion Oil Corp	USD	207	691	0,01
			691	0,01
TOTAL DES ACTIONS ORDINAIRES			**691**	**0,01**
FONDS D'INVESTISSEMENT : 2,58 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 2,25 %)				
Services commerciaux - 2,58 % (31 décembre 2023 : 2,25 %)				
Loomis Sayles Asia Bond Plus Fund (ii)	USD	22	162 643	2,58
			162 643	2,58
TOTAL DES FONDS D'INVESTISSEMENT			**162 643**	**2,58**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (Coût : 7 153 106 USD)			**6 242 179**	**98,83**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS - 0,05 % (31 décembre 2023 : 0,63 %)

Contrats de change à terme en cours - 0,05 % (31 décembre 2023 : 0,63 %)

Date	Montant acheté	Montant vendu	Contrepartie	Plus-value/ (Moins-value) latente USD	% de l'actif net
31/07/24	3 015 EUR	3 230 USD	Brown Brothers Harriman	5	0,00 %
31/07/24	1 727 814 EUR	1 851 197 USD	Brown Brothers Harriman	3 194	0,05 %
Plus-value latente sur les contrats de change à terme en cours				3 199	0,05 %
Plus-value latente nette sur les contrats de change à terme en cours				**3 199**	**0,05 %**

Calendrier des investissements	**Au 30 juin 2024**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Indices de swap de défaillance de crédit compensés par une contrepartie centrale – 0,13 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)

Position	Contrepartie	Indice sous-jacent	Taux	Date	Devise	Nominal	Plus-value/ (moins-value) latente	% de l'actif net
VENTE	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.HY.42	5,00 %	20/06/2029	USD	130 000	8 154	0,13 %
Plus-value latente sur swaps de défaillance de crédit compensés par une contrepartie centrale							8 154	0,13 %
Plus-value nette latente sur swaps de défaillance de crédit compensés par une contrepartie centrale							**8 154**	**0,13 %**

	Juste valeur USD	% de l'actif net
Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**6 253 532**	**99,01**
Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**–**	**-**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS	**6 253 532**	**99,01**
Avoirs nets en banque	112 191	1,78
Autres actifs	126 239	2,00
Moins autres passifs	(176 072)	(2,79)
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES	**6 315 890**	**100,00**

(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 2024.
(iv) Obligations perpétuelles.

Abréviations

EUR : Euro
USD : Dollar américain

Analyse de l'actif total	**% de l'actif total**
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle	13,83
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	82,32
Instruments financiers dérivés	0,18
Actif circulant	3,67
	100,00

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME – 97,27 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 96,41 %)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 97,27 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 96,41 %)				
Australie - 1,35 % (31 décembre 2023 : 1,86 %)				
New South Wales Treasury Corp, 2,000 %, 08/03/33 (i)	AUD	3 900 000	2 073 011	0,87
Queensland Treasury Corp, 2,750 %, 20/08/27 144A (i) (ii)	AUD	1 775 000	1 129 131	0,48
			3 202 142	1,35
Brésil - 1,66 % (31 décembre 2023 : 0,93 %)				
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10,000 %, 01/01/27 (i)	BRL	9 905 000	1 715 965	0,72
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10,000 %, 01/01/31 (i)	BRL	13 718 000	2 228 774	0,94
			3 944 739	1,66
Canada - 5,10 % (31 décembre 2023 : 2,84 %)				
Bank of Nova Scotia, 0,010 %, 09/14/29	EUR	990 000	898 701	0,38
Canada Housing Trust No 1, 1,550 %, 15/12/26 144A (ii)	CAD	775 000	535 486	0,23
Canadian Government, 1,500 %, 01/06/26	CAD	3 015 000	2 107 272	0,89
Canadian Government, 3,250 %, 01/12/33	CAD	1 440 000	1 030 810	0,43
Export Development Canada, 4,750 %, 05/06/34	USD	4 700 000	4 792 076	2,02
Province of British Columbia Canada, 4,300 %, 18/06/42	CAD	1 130 000	812 228	0,34
Province of Ontario Canada, 1,900 %, 02/12/51 *	CAD	2 170 000	973 887	0,41
Province of Quebec Canada, Zero Coupon Bond, 29/10/30 EMTN	EUR	1 085 000	955 795	0,40
			12 106 255	5,10
Chili – 0,48 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Chile Government International Bond, 4,950 %, 05/01/36 (i)	USD	1 200 000	1 149 719	0,48
			1 149 719	0,48
Chine - 6,36 % (31 décembre 2023 : 5,95 %)				
China Development Bank, 2,340 %, 01/05/27 (i)	CNY	29 930 000	4 161 222	1,75
China Development Bank, 3,020 %, 03/06/33 (i)	CNY	7 300 000	1 057 396	0,45
China Development Bank, 3,300 %, 03/03/26 (i)	CNY	2 790 000	393 223	0,17
China Government Bond, 2,500 %, 25/07/27 (i)	CNY	3 000 000	420 441	0,18
China Government Bond, 3,000 %, 15/10/53 (i)	CNY	12 760 000	1 955 890	0,82
China Government Bond, 3,020 %, 27/05/31 (i)	CNY	48 030 000	6 988 425	2,94
China Government Bond, 3,720 %, 12/04/51 (i)	CNY	730 000	124 002	0,05
			15 100 599	6,36
Danemark - 1,99 % (31 décembre 2023 : 1,73 %)				
Danske Bank A/S, 4,750 %, 21/06/30 EMTN (i) (iii)	EUR	1 085 000	1 210 184	0,51
Danske Bank A/S, 6,259 %, 22/09/26 144A (i) (ii) (iii)	USD	1 170 000	1 178 185	0,49
Denmark Government Bond, 2,250 %, 15/11/33 (i)	DKK	16 650 000	2 344 208	0,99
			4 732 577	1,99
France - 3,37 % (31 décembre 2023 : 3,15 %)				
AXA SA, 5,500 %, 11/07/43 EMTN (i) (iii)	EUR	370 000	418 454	0,17
Électricité de France SA, 2,000 %, 09/12/49 EMTN (i)	EUR	1 100 000	729 757	0,31
Électricité de France SA, 5,125 %, 22/09/50 EMTN (i)	GBP	150 000	159 798	0,07
French Republic Government Bond OAT, 0,500 %, 25/06/44 144A (i) (ii)	EUR	1 375 000	834 831	0,35
French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, 25/05/28 144A (i) (ii)	EUR	1 495 000	1 470 880	0,62
French Republic Government Bond OAT, 3,250 %, 25/05/45 144A (i) (ii)	EUR	160 000	162 585	0,07
French Republic Government Bond OAT, Zero Coupon Bond, 25/05/32 144A (i) (ii)	EUR	3 630 000	3 051 438	1,28
Société Générale SA, 6,066 %, 19/01/35 144A (i) (ii) (iii)	USD	975 000	965 242	0,41

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
France - 3,37 % (31 décembre 2023 : 3,15 %) (suite)				
Société Générale SA, 6,691 %, 10/01/34 144A (i) (ii) (iii)	USD	200 000	206 242	0,09
			7 999 227	3,37
Allemagne - 6,19 % (31 décembre 2023 : 6,75 %)				
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, 15/08/28 (i)	EUR	2 095 000	2 054 482	0,87
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, 15/02/26 (i)	EUR	3 110 000	3 210 303	1,35
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,800 %, 15/08/53 (i)	EUR	1 015 000	897 874	0,38
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300 %, 15/02/33 (i)	EUR	2 340 000	2 479 806	1,04
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,000 %, 04/01/37 (i)	EUR	1 290 000	1 586 656	0,67
German Treasury Bill, 3,640 %, 17/07/24 (i)	EUR	3 570 000	3 819 976	1,61
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,875 %, 28/12/29 EMTN (i)	EUR	605 000	648 478	0,27
			14 697 575	6,19
Indonésie - 1,31 % (31 décembre 2023 : 1,37 %)				
Indonesia Treasury Bond, 6,625 %, 15/02/34 (i)*	IDR	49 027 000 000	2 898 686	1,22
Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 15/02/33 (i)*	IDR	3 276 000 000	198 760	0,09
			3 097 446	1,31
Irlande - 1,58 % (31 décembre 2023 : 2,64 %)				
AIB Group PLC, 5,750 %, 16/02/29 (i) (iii)	EUR	1 425 000	1 624 538	0,69
Republic of Ireland, 1,000 %, 15/05/26 (ii)	EUR	1 110 000	1 147 432	0,48
Republic of Ireland, Zero coupon Bond, 18/10/31 (i)	EUR	650 000	568 545	0,24
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 5,125 %, 23/11/52 EMTN (i) (iii)	GBP	335 000	403 351	0,17
			3 743 866	1,58
Israël - 0,07 % (31 décembre 2023 : 0,10 %)				
Israel Government Bond – Fixed, 1,000 %, 31/03/30 (i)	ILS	765 000	165 781	0,07
			165 781	0,07
Italie – 1,60 % (31 décembre 2023 : 1,01 %)				
Intesa Sanpaolo SpA, 5,148 %, 10/06/30 EMTN (i)	GBP	140 000	163 285	0,07
Intesa Sanpaolo SpA, 7,200 %, 28/11/33 144A (i) (ii)	USD	1 000 000	1 072 017	0,45
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,850 %, 01/07/34 (i)	EUR	2 425 000	2 561 981	1,08
			3 797 283	1,60
Japon - 9,38 % (31 décembre 2023 : 6,18 %)				
Development Bank of Japan Inc, 0,875 %, 10/10/25 EMTN (i)	EUR	150 000	155 506	0,06
Japan Government Five Year Bond, 0,100 %, 20/12/25 (i)	JPY	757 000 000	4 696 214	1,98
Japan Government Thirty Year Bond, 0,300 %, 20/06/46 (i)	JPY	581 250 000	2 558 678	1,08
Japan Government Thirty Year Bond, 1,600 %, 20/12/53 (i)	JPY	322 000 000	1 760 851	0,74
Japan Government Twenty Year Bond, 1,500 %, 20/06/34 (i)	JPY	191 400 000	1 237 818	0,52
Japan Government Two Year Bond, 0,100 %, 01/01/26 (i)	JPY	1 914 100 000	11 869 776	5,00
			22 278 843	9,38
Luxembourg - 0,62 % (31 décembre 2023 : 0,53 %)				
Logicor Financing Sarl, 0,875 %, 14/01/31 EMTN (i)	EUR	1 390 000	1 176 179	0,49
Logicor Financing Sarl, 1,625 %, 17/01/30 EMTN (i)	EUR	325 000	299 234	0,13
			1 475 413	0,62

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Malaisie - 0,38 % (31 décembre 2023 : 0,34 %)				
Malaysia Government Bond, 3,906 %, 15/07/26 (i)*	MYR	4 265 000	912 332	0,38
			912 332	0,38
Mexique - 1,88 % (31 décembre 2023 : 2,13 %)				
Mexican Bonos, 8,500 %, 31/05/29 (i)	MXN	52 404 600	2 701 992	1,14
Mexico Government International Bond, 3,500 %, 12/02/34 (i)	USD	2 175 000	1 767 041	0,74
			4 469 033	1,88
Pays-Bas – 1,32 % (31 décembre 2023 : 1,69 %)				
Cooperatieve Rabobank UA, 5,000 %, 13/01/25 (i)	USD	1 200 000	1 195 589	0,50
EDP Finance BV, 0,375 %, 16/09/26 EMTN (i)	EUR	1 110 000	1 109 855	0,47
Enel Finance International NV, 5,750 %, 14/09/40 EMTN (i)	GBP	660 000	827 156	0,35
			3 132 600	1,32
Nouvelle-Zélande - 0,15 % (31 décembre 2023 : 1,15 %)				
New Zealand Government Bond, 4,500 %, 15/04/27 (i)	NZD	570 000	345 669	0,15
			345 669	0,15
Norvège - 0,49 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Aker BP ASA, 4,000 %, 15/01/31 144A (i) (ii)	USD	550 000	499 197	0,21
Norway Government Bond, 1,750 %, 13/03/25 144A (i) (ii)	NOK	1 895 000	174 707	0,08
SpareBank 1 Boligkreditt AS, 0,050 %, 03/11/28 EMTN (i)	EUR	510 000	479 488	0,20
			1 153 392	0,49
Philippines - 0,50 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Philippine Government International Bond, 3,229 %, 29/03/27 (i)	USD	1 260 000	1 196 294	0,50
			1 196 294	0,50
Pologne - 0,50 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Republic of Poland Government International Bond, 4,625 %, 18/03/29 (i)	USD	1 200 000	1 185 114	0,50
			1 185 114	0,50
Singapour - 0,47 % (31 décembre 2023 : 1,09 %)				
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, 19/05/33 (i)	USD	310 000	302 039	0,13
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300 %, 19/05/53 (i)	USD	485 000	467 791	0,20
Singapore Government Bond, 1,250 %, 01/11/26 (i)	SGD	460 000	323 285	0,13
Singapore Government Bond, 2,125 %, 01/06/26 (i)	SGD	40 000	28 803	0,01
			1 121 918	0,47
Afrique du Sud - 2,28 % (31 décembre 2023 : 1,96 %)				
Republic of South Africa Government Bond, 7,000 %, 28/02/31 (i)	ZAR	118 135 000	5 421 530	2,28
			5 421 530	2,28
Corée du Sud - 2,09 % (31 décembre 2023 : 2,15 %)				
Korea Treasury Bond, 3,250 %, 10/06/33 (i)	KRW	25 090 000	18 187	0,01
Korea Treasury Bond, 4,125 %, 10/12/33 (i)	KRW	5 968 900 000	4 630 119	1,95
Korea Treasury Bond, 4,250 %, 10/12/32 (i)	KRW	410 700 000	319 715	0,13
			4 968 021	2,09
Espagne - 4,00 % (31 décembre 2023 : 2,21 %)				
Autonomous Community of Madrid Spain, 4,300 %, 15/09/26 (i)	EUR	70 000	76 538	0,03
Banco Santander SA, 5,147 %, 18/08/25 (i)	USD	1 200 000	1 190 664	0,50
CaixaBank SA, 6,037 %, 15/06/35 144A (i) (ii) (iii)	USD	200 000	200 406	0,08
CaixaBank SA, 6,208 %, 18/01/29 144A (i) (ii) (iii)	USD	1 190 000	1 208 735	0,51
Spain Government Bond, 1,300 %, 31/10/26 144A (i) (ii)	EUR	1 880 000	1 935 552	0,82
Spain Government Bond, 3,250 %, 30/04/34 144A (i) (ii)	EUR	2 820 000	2 992 420	1,26

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Espagne - 4,00 % (31 décembre 2023 : 2,21 %) (suite)				
Spain Government Bond, 4,200 %, 31/01/37 144A (i) (ii)	EUR	1 665 000	1 902 184	0,80
			9 506 499	4,00
Titres supranationaux - 1,27 % (31 décembre 2023 : 2,03 %)				
European Union, 1,000 %, 06/07/32 (i)	EUR	2 450 000	2 255 751	0,95
International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, 18/09/30 (i)	CAD	1 000 000	746 731	0,32
			3 002 482	1,27
Suède - 0,39 % (31 décembre 2023 : 0,36 %)				
Kommuninvest I Sverige AB, 1,000 %, 12/05/25 (i)	SEK	520 000	48 082	0,02
Sweden Government Bond, 2,500 %, 12/05/25 (i)	SEK	9 260 000	869 549	0,37
			917 631	0,39
Suisse - 0,95 % (31 décembre 2023 : 0,59 %)				
UBS AG, 5,800 %, 11/09/25 (i)	USD	1 170 000	1 174 279	0,49
UBS Group AG, 2,875 %, 02/04/32 (i) (iii)	EUR	1 085 000	1 087 320	0,46
			2 261 599	0,95
Thaïlande - 0,31 % (31 décembre 2023 : 0,29 %)				
Thailand Government Bond, 1,600 %, 17/12/29 (i)*	THB	27 930 000	726 121	0,31
			726 121	0,31
Royaume-Uni - 4,64 % (31 décembre 2023 : 2,44 %)				
Anglo American Capital PLC, 4,125 %, 15/03/32 (i)	EUR	845 000	906 026	0,38
National Grid Electricity Transmission PLC, 2,750 %, 06/02/35 EMTN (i)	GBP	240 000	237 515	0,10
National Grid PLC, 4,275 %, 16/01/35 EMTN (i)	EUR	585 000	635 768	0,27
Nationwide Building Society, 3,375 %, 27/11/28 (i)	EUR	815 000	878 214	0,37
NatWest Markets PLC, 5,416 %, 17/05/27 144A (i) (ii)	USD	1 200 000	1 199 303	0,51
United Kingdom Treasury, 0,625 %, 31/07/35 (i)	GBP	2 455 000	2 118 668	0,89
United Kingdom Treasury, 1,500 %, 22/07/47 (i)	GBP	1 635 000	1 154 516	0,49
United Kingdom Treasury, 4,125 %, 29/01/27 (i)	GBP	1 120 000	1 406 745	0,59
United Kingdom Treasury, 4,750 %, 07/12/30 (i)	GBP	1 875 000	2 468 017	1,04
			11 004 772	4,64
États-Unis - 34,59 % (31 décembre 2023 : 42,94 %)				
Amgen Inc, 5,250 %, 02/03/33	USD	1 655 000	1 650 177	0,69
Amgen Inc, 5,650 %, 02/03/53	USD	540 000	531 815	0,22
AT&T Inc, 2,250 %, 01/02/32	USD	2 675 000	2 169 960	0,91
AT&T Inc, 3,500 %, 15/09/53	USD	445 000	302 083	0,13
Bank of America Corp, 2,015 %, 13/02/26 (iii)	USD	1 230 000	1 201 849	0,51
Bank of America Corp, 5,288 %, 25/04/34 (iii)	USD	1 165 000	1 152 772	0,49
Bristol-Myers Squibb Co, 4,900 %, 22/02/27	USD	2 355 000	2 348 238	0,99
Broadcom Inc, 2,450 %, 15/02/31 144A (ii)	USD	700 000	589 477	0,25
Broadcom Inc, 3,419 %, 15/04/33 144A (ii)	USD	535 000	461 249	0,19
Broadcom Inc, 3,469 %, 15/04/34 144A (ii)	USD	295 000	251 486	0,11
Centene Corp, 2,500 %, 01/03/31	USD	75 000	61 551	0,03
Centene Corp, 3,000 %, 15/10/30	USD	805 000	688 330	0,29
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 3,700 %, 01/04/51	USD	150 000	91 214	0,04
Citigroup Inc, 2,400 %, 31/10/25	JPY	11 000 000	69 587	0,03
Comcast Corp, 5,250 %, 07/11/25	USD	1 200 000	1 199 150	0,50
Continental Resources Inc, 2,875 %, 01/04/32 144A (ii)	USD	710 000	573 344	0,24
CVS Health Corp, 4,780 %, 25/03/38	USD	575 000	513 369	0,22

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
États-Unis – 34,59 % (31 décembre 2023 : 42,94 %) (suite)				
CVS Health Corp, 5,000 %, 20/02/26	USD	590 000	585 475	0,25
EIDP Inc, 4,500 %, 15/05/26	USD	2 420 000	2 385 574	1,00
Energy Transfer LP, 5,300 %, 15/04/47	USD	330 000	291 475	0,12
Energy Transfer LP, 5,950 %, 15/05/54	USD	215 000	209 360	0,09
ERAC USA Finance LLC, 4,500 %, 15/02/45 144A (ii)	USD	540 000	469 399	0,20
Fannie Mae Pool, 2,000 %, 01/03/52	USD	6 543 006	5 132 325	2,16
Fannie Mae Pool, 2,500 %, 01/05/52	USD	44 970	36 822	0,02
Fannie Mae Pool, 2,500 %, 01/01/54	USD	6 152 432	5 032 561	2,12
Fannie Mae Pool, 3,000 %, 01/04/45	USD	26 893	23 519	0,01
Fannie Mae Pool, 3,000 %, 01/11/51	USD	455 490	387 570	0,16
Fannie Mae Pool, 3,000 %, 07/01/52	USD	2 330 697	1 983 987	0,84
Fannie Mae Pool, 4,000 %, 01/03/49	USD	247 973	230 062	0,10
Fannie Mae Pool, 4,000 %, 01/09/52	USD	1 085 926	994 818	0,42
Fannie Mae Pool, 4,500 %, 01/02/47	USD	5 267	5 054	0,00
Fannie Mae Pool, 4,500 %, 01/03/47	USD	173 208	166 982	0,07
Fannie Mae Pool, 4,500 %, 10/01/52	USD	806 285	760 509	0,32
Fannie Mae Pool, 5,000 %, 01/05/53	USD	1 852 809	1 790 905	0,75
Fannie Mae Pool, 6,000 %, 11/01/53	USD	1 972 671	1 978 754	0,83
Fannie Mae Pool, 6,500 %, 01/05/53	USD	198 601	202 842	0,09
Fannie Mae Pool, 6,500 %, 09/01/53	USD	734 776	747 931	0,31
Fannie Mae Pool, 6,500 %, 06/01/54	USD	1 010 544	1 028 635	0,43
Fannie Mae-Aces, 3,027 %, 25/09/27 (iii)	USD	64 334	60 750	0,03
Freddie Mac Gold Pool, 3,500 %, 01/12/46	USD	8 698	7 949	0,00
Freddie Mac Gold Pool, 4,500 %, 01/07/39	USD	20 221	19 667	0,01
Freddie Mac Pool, 2,000 %, 01/06/52	USD	149 818	117 372	0,05
Freddie Mac Pool, 2,500 %, 01/12/51	USD	677 603	555 469	0,23
Freddie Mac Pool, 2,500 %, 01/03/52	USD	3 654 742	2 992 925	1,26
Freddie Mac Pool, 3,500 %, 01/12/53	USD	2 042 000	1 808 219	0,76
Freddie Mac Pool, 4,000 %, 01/08/52	USD	2 770 831	2 537 337	1,07
Freddie Mac Pool, 5,000 %, 01/10/48	USD	95 155	93 739	0,04
Freddie Mac Pool, 5,000 %, 01/11/48	USD	60 934	59 955	0,03
Freddie Mac Pool, 5,000 %, 01/07/53	USD	103 466	100 037	0,04
Freddie Mac Pool, 5,500 %, 01/05/54	USD	1 277 610	1 260 235	0,53
Freddie Mac Pool, 7,000 %, 01/12/53	USD	26 580	27 342	0,01
GATX Corp, 6,050 %, 15/03/34	USD	190 000	194 291	0,08
General Motors Financial Co Inc, 5,600 %, 18/06/31	USD	340 000	337 455	0,14
Goldman Sachs Group Inc, 1,000 %, 24/11/25 EMTN	CHF	1 090 000	1 205 425	0,51
Goldman Sachs Group Inc, 3,750 %, 22/05/25	USD	1 220 000	1 200 136	0,51
GXO Logistics Inc, 6,250 %, 06/05/29	USD	585 000	595 061	0,25
GXO Logistics Inc, 6,500 %, 06/05/34	USD	250 000	253 702	0,11
HCA Inc, 2,375 %, 15/07/31	USD	2 255 000	1 851 653	0,78
HCA Inc, 5,500 %, 01/06/33	USD	40 000	39 673	0,02
Home Depot Inc, 4,875 %, 25/06/27	USD	1 200 000	1 197 555	0,50
JPMorgan Chase & Co, 1,040 %, 04/02/27 (iii)	USD	2 575 000	2 398 688	1,01
Micron Technology Inc, 2,703 %, 15/04/32	USD	1 425 000	1 179 900	0,50
Micron Technology Inc, 5,300 %, 15/01/31	USD	590 000	588 670	0,25
Morgan Stanley, 2,188 %, 04/28/26 (iii)	USD	2 470 000	2 398 726	1,01
Oncor Electric Delivery Co LLC, 5,550 %, 15/06/54 144A (ii)	USD	965 000	946 311	0,40
Oracle Corp, 4,300 %, 08/07/34	USD	700 000	637 495	0,27
Oracle Corp, 5,550 %, 06/02/53	USD	480 000	454 154	0,19

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
États-Unis – 34,59 % (31 décembre 2023 : 42,94 %) (suite)				
Oracle Corp, 5,800 %, 10/11/25	USD	1 180 000	1 185 591	0,50
Ovintiv Inc, 6,250 %, 15/07/33	USD	535 000	551 468	0,23
Ovintiv Inc, 7,375 %, 01/11/31	USD	20 000	21 789	0,01
PK Alift Loan Funding 3 LP, 5,842 %, 15/09/39 144A (ii)	USD	1 185 000	1 185 290	0,50
Principal Life Global Funding II, 1,375 %, 10/01/25 144A (ii)	USD	1 215 000	1 188 839	0,50
Solvay Finance America LLC, 5,850 %, 04/06/34 144A (ii)	USD	435 000	435 717	0,18
Thermo Fisher Scientific Inc, 5,086 %, 10/08/33	USD	1 095 000	1 092 212	0,46
T-Mobile USA Inc, 2,550 %, 15/02/31	USD	15 000	12 733	0,01
T-Mobile USA Inc, 3,400 %, 15/10/52	USD	290 000	197 988	0,08
T-Mobile USA Inc, 5,050 %, 15/07/33	USD	2 070 000	2 025 098	0,85
T-Mobile USA Inc, 5,150 %, 15/04/34	USD	55 000	54 057	0,02
Towd Point Mortgage Trust, 2,750 %, 25/10/57 144A (ii) (iii)	USD	62 183	59 947	0,03
United Airlines, 3,650 %, 07/10/25	USD	132 986	127 924	0,05
United States Treasury Inflation Indexed Note, 0,625 %, 15/07/32	USD	2 589 984	2 322 240	0,98
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, 15/02/41	USD	4 715 000	3 226 276	1,36
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, 15/02/53	USD	2 270 000	1 931 096	0,81
UnitedHealth Group Inc, 4,500 %, 15/04/33	USD	1 590 000	1 519 551	0,64
UnitedHealth Group Inc, 5,150 %, 15/10/25	USD	590 000	589 138	0,25
Verizon Communications Inc, 2,850 %, 03/09/41	USD	300 000	210 187	0,09
VMware LLC, 2,200 %, 15/08/31	USD	775 000	629 722	0,27
Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, 15/03/32	USD	145 000	126 560	0,05
			82 113 524	34,59
TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES			**230 929 996**	**97,27**
TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES OBLIGATIONS À MOYEN TERME			**230 929 996**	**97,27**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (Coût : 235 209 568 USD)			**230 929 996**	**97,27**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS - (0,22 %) (31 décembre 2023 : 0,04 %)

Contrats de change à terme en cours - (0,25 %) (31 décembre 2023 : 0,01 %)

Date	Montant acheté	Montant vendu	Contrepartie	Plus-value/ (Moins-value) latente USD	% de l'actif net
18/09/24	764 186 000 JPY	4 974 975 USD	Bank of America	(166 299)	(0,07 %)
18/09/24	2 420 349 USD	379 000 000 JPY	Bank of America	35 473	0,02 %
19/09/24	2 243 632 USD	3 080 035 000 KRW	Bank of America	(4 274)	(0,00 %)

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Contrats de change à terme en cours - (0,25 %) (31 décembre 2023 : 0,01 %) (suite)

Date	Montant acheté	Montant vendu	Contrepartie	Plus-value/ (Moins-value) latente USD	% de l'actif net
18/09/24	1 429 000 PLN	329 886 EUR	Barclays Bank PLC	215	0,00 %
19/09/24	17 667 000 CNH	2 446 817 USD	BNP Paribas SA	(11 904)	(0,01 %)
31/07/24	40 051 638 GBP	47 361 396 EUR	Brown Brothers Harriman	(192 804)	(0,08 %)
31/07/24	78 774 394 GBP	99 786 675 USD	Brown Brothers Harriman	(190 382)	(0,08 %)
31/07/24	16 389 169 GBP	151 134 194 CNH	Brown Brothers Harriman	(29 798)	(0,01 %)
31/07/24	4 324 334 GBP	7 417 258 SGD	Brown Brothers Harriman	(13 459)	(0,01 %)
31/07/24	2 686 351 GBP	5 092 114 AUD	Brown Brothers Harriman	(7 089)	(0,00 %)
31/07/24	1 010 914 GBP	1 195 414 EUR	Brown Brothers Harriman	(4 866)	(0,00 %)
31/07/24	1 979 902 GBP	2 508 020 USD	Brown Brothers Harriman	(4 785)	(0,00 %)
31/07/24	4 717 702 GBP	8 162 134 CAD	Brown Brothers Harriman	(4 338)	(0,00 %)
31/07/24	413 215 GBP	3 810 496 CNH	Brown Brothers Harriman	(751)	(0,00 %)
31/07/24	638 648 GBP	807 926 USD	Brown Brothers Harriman	(469)	(0,00 %)
31/07/24	108 990 GBP	186 943 SGD	Brown Brothers Harriman	(339)	(0,00 %)
31/07/24	895 034 GBP	1 013 455 CHF	Brown Brothers Harriman	(272)	(0,00 %)
31/07/24	67 348 GBP	127 662 AUD	Brown Brothers Harriman	(178)	(0,00 %)
31/07/24	117 803 GBP	203 812 CAD	Brown Brothers Harriman	(108)	(0,00 %)
31/07/24	48 668 GBP	55 132 CHF	Brown Brothers Harriman	(43)	(0,00 %)
31/07/24	44 138 GBP	55 837 USD	Brown Brothers Harriman	(32)	(0,00 %)
31/07/24	23 011 AUD	14 356 EUR	Brown Brothers Harriman	(27)	(0,00 %)
31/07/24	537 934 EUR	456 649 GBP	Brown Brothers Harriman	(10)	(0,00 %)
31/07/24	62 007 CAD	35 873 GBP	Brown Brothers Harriman	(8)	(0,00 %)
31/07/24	22 507 GBP	25 485 CHF	Brown Brothers Harriman	(7)	(0,00 %)
31/07/24	2 496 GBP	4 727 AUD	Brown Brothers Harriman	(3)	(0,00 %)
31/07/24	1 184 GBP	2 243 AUD	Brown Brothers Harriman	(2)	(0,00 %)
31/07/24	1 545 GBP	1 750 CHF	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Contrats de change à terme en cours - (0,25 %) (31 décembre 2023 : 0,01 %) (suite)

Date	Montant acheté	Montant vendu	Contrepartie	Plus-value/ (Moins-value) latente USD	% de l'actif net
31/07/24	1 812 EUR	1 946 USD	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
31/07/24	2 508 AUD	2 269 SGD	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
31/07/24	3 916 GBP	36 065 CNH	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
31/07/24	0 EUR	1 AUD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	0 GBP	0 EUR	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	0 EUR	1 CAD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	1 EUR	9 CNH	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	1 EUR	1 CHF	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	3 SGD	2 EUR	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	3 SEK	0 EUR	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	4 CAD	4 AUD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	7 AUD	4 CHF	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	9 AUD	63 SEK	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	12 EUR	131 SEK	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	16 EUR	15 CHF	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	17 EUR	19 USD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	23 GBP	28 EUR	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	28 GBP	53 AUD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	29 AUD	18 CHF	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	35 EUR	56 AUD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	48 EUR	76 AUD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	50 EUR	73 CAD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	62 AUD	56 SGD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	66 AUD	60 CAD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	70 SGD	77 AUD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	75 SEK	11 AUD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Contrats de change à terme en cours - (0,25 %) (31 décembre 2023 : 0,01 %) (suite)

Date	Montant acheté	Montant vendu	Contrepartie	Plus-value/ (Moins-value) latente USD	% de l'actif net
31/07/24	77 EUR	111 SGD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	83 EUR	121 CAD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	87 EUR	84 CHF	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	106 EUR	829 CNH	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	114 AUD	60 GBP	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	119 CNH	25 AUD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	122 EUR	103 GBP	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	255 EUR	409 AUD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	278 SGD	192 EUR	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	303 SEK	27 EUR	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	438 AUD	292 USD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	885 JPY	5 EUR	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	1 524 GBP	2 634 CAD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	1 753 SEK	131 GBP	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	2 032 EUR	1 725 GBP	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	42 111 JPY	394 AUD	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	97 304 JPY	566 EUR	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
31/07/24	223 AUD	1 080 CNH	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
31/07/24	290 EUR	2 265 CNH	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
31/07/24	384 AUD	40 895 JPY	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
31/07/24	522 AUD	312 CHF	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
31/07/24	830 AUD	516 EUR	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
31/07/24	2 834 SGD	1 656 GBP	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
31/07/24	290 EUR	49 452 JPY	Brown Brothers Harriman	2	0,00 %
31/07/24	379 AUD	2 663 SEK	Brown Brothers Harriman	2	0,00 %
31/07/24	45 637 AUD	30 501 USD	Brown Brothers Harriman	2	0,00 %

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Contrats de change à terme en cours - (0,25 %) (31 décembre 2023 : 0,01 %) (suite)

Date	Montant acheté	Montant vendu	Contrepartie	Plus-value/ (Moins-value) latente USD	% de l'actif net
31/07/24	2 325 268 JPY	11 484 GBP	Brown Brothers Harriman	2	0,00 %
31/07/24	917 AUD	611 USD	Brown Brothers Harriman	3	0,00 %
31/07/24	1 397 EUR	1 497 USD	Brown Brothers Harriman	3	0,00 %
31/07/24	2 708 AUD	2 472 CAD	Brown Brothers Harriman	3	0,00 %
31/07/24	9 487 AUD	46 155 CNH	Brown Brothers Harriman	4	0,00 %
31/07/24	210 956 CNH	22 906 GBP	Brown Brothers Harriman	4	0,00 %
31/07/24	1 724 EUR	1 651 CHF	Brown Brothers Harriman	6	0,00 %
31/07/24	3 972 AUD	2 095 GBP	Brown Brothers Harriman	6	0,00 %
31/07/24	178 953 SEK	13 378 GBP	Brown Brothers Harriman	9	0,00 %
31/07/24	1 251 EUR	14 089 SEK	Brown Brothers Harriman	10	0,00 %
31/07/24	5 129 EUR	8 221 AUD	Brown Brothers Harriman	10	0,00 %
31/07/24	8 280 EUR	12 009 SGD	Brown Brothers Harriman	13	0,00 %
31/07/24	8 941 EUR	13 081 CAD	Brown Brothers Harriman	30	0,00 %
31/07/24	193 559 SGD	113 095 GBP	Brown Brothers Harriman	37	0,00 %
31/07/24	9 473 AUD	1 007 842 JPY	Brown Brothers Harriman	38	0,00 %
31/07/24	13 111 EUR	11 088 GBP	Brown Brothers Harriman	53	0,00 %
31/07/24	74 436 174 JPY	367 627 GBP	Brown Brothers Harriman	53	0,00 %
31/07/24	31 318 EUR	244 259 CNH	Brown Brothers Harriman	75	0,00 %
31/07/24	16 381 GBP	218 129 SEK	Brown Brothers Harriman	84	0,00 %
31/07/24	31 273 EUR	5 333 441 JPY	Brown Brothers Harriman	257	0,00 %
31/07/24	150 654 EUR	161 412 USD	Brown Brothers Harriman	278	0,00 %
31/07/24	419 076 GBP	84 504 244 JPY	Brown Brothers Harriman	2 121	0,00 %
31/07/24	651 001 GBP	8 668 608 SEK	Brown Brothers Harriman	3 319	0,00 %
31/07/24	16 359 566 GBP	3 298 808 347 JPY	Brown Brothers Harriman	82 794	0,03 %
18/09/24	2 014 033 USD	37 948 000 MXN	Goldman Sachs	(35 739)	(0,02 %)
18/09/24	192 354 000 HUF	488 918 EUR	Goldman Sachs	(5 436)	(0,00 %)

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (suite)

Contrats de change à terme en cours - (0,25 %) (31 décembre 2023 : 0,01 %) (suite)

Date	Montant acheté	Montant vendu	Contrepartie	Plus-value/ (Moins-value) latente USD	% de l'actif net
18/09/24	5 410 016 USD	100 026 000 ZAR	UBS Securities LLC	(34 963)	(0,02 %)
18/09/24	1 867 011 EUR	13 913 000 DKK	UBS Securities LLC	(223)	(0,00 %)
Plus-value latente sur les contrats de change à terme en cours				124 912	0,05 %
Moins-value latente sur les contrats de change à terme en cours				(708 612)	(0,30 %)
Moins-value latente nette sur les contrats de change à terme en cours				**(583 700)**	**(0,25 %)**

Contrats à terme normalisés - 0,03 % (31 décembre 2023 : 0,03 %)

Nombre de contrats	Libellé	Contrepartie	Engagement	Plus-value/ (Moins-value) latente	% de l'actif net
(15)	Euro-Bund September 2024 Futures	JP Morgan	2 109 847	(6 109)	(0,00 %)
(52)	US 10 Year Ultra September 2024 Futures	JP Morgan	5 948 243	44 618	0,02 %
4	Euro-Bobl September 2024 Futures	JP Morgan	494 634	4 544	0,00 %
20	Euro-Buxl 30 Year Bond September 2024 Futures	JP Morgan	2 756 862	34 832	0,02 %
2	Euro-Schatz September 2024 Futures	JP Morgan	225 496	1 072	0,00 %
74	US 10 Year Note September 2024 Futures	JP Morgan	8 180 469	(41 625)	(0,02 %)
29	US 2 Year Note September 2024 Futures	JP Morgan	5 904 581	17 762	0,01 %
44	US Ultra Bond September 2024 Futures	JP Morgan	5 509 705	5 420	0,00 %
Plus-value latente sur les contrats à terme normalisés				108 248	0,05 %
Moins-value latente sur les contrats à terme normalisés				(47 734)	(0,02 %)
Plus-value nette latente sur contrats à terme normalisés				**60 514**	**0,03 %**

	Juste valeur USD	% de l'actif net
Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**231 163 156**	**97,37**
Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**(756 346)**	**(0,32)**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS	**230 406 810**	**97,05**
Avoirs nets en banque	6 062 304	2,55
Autres actifs	2 501 527	1,06
Moins autres passifs	(1 561 358)	(0,66)
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES	**237 409 283**	**100,00**

Calendrier des investissements	**Au 30 juin 2024**

LES DIX PREMIÈRES PARTICIPATIONS SECTORIELLES AU 30 JUIN 2024 EN POURCENTAGE DE L'ACTIF NET

Titres souverains	50,11 %
Activités bancaires	13,10 %
Garanties UMBS	12,66 %
Exécutifs locaux étrangers	2,56 %
Santé	2,46 %
Télécommunications	2,09 %
Électricité	1,96 %
Produits pharmaceutiques	1,78 %
Semi-conducteurs	1,29 %
Logiciel	1,22 %

(i) Titres émis par des émetteurs non américains ou non canadiens.
(ii) 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.
(iii) Indique un titre à taux variable. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2024.
* 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
DKK :	Couronne danoise
EUR :	Euro
GBP :	Livre sterling
HUF :	Forint hongrois
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

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND (suite)

Calendrier des investissements	Au 30 juin 2024

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle	62,17
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	21,10
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire autres que ceux admis à une cote officielle ou négociés sur un marché réglementé	13,37
Instruments financiers dérivés	(0,22)
Actif circulant	3,58
	100,00

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND*

Calendrier des investissements	**Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	**Juste valeur USD**	**% de l'actif net**
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME – 0,00 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 39,50 %)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 0,00 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 39,50 %)				
Royaume-Uni - 0,00 % (31 décembre 2023 : 0,48 %)				
Polyus Finance PLC, 3,250 %, 14/10/28 144A (i) (ii)	USD	235 000	135 491	–
			135 491	–
TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES			**135 491**	**–**
TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES OBLIGATIONS À MOYEN TERME			**135 491**	**–**
ACTIONS ORDINAIRES – 0,00 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 37,79 %)				
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (Coût : 235 000 USD)			**135 491**	**–**

	Juste valeur USD	**% de l'actif net**
Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**135 491**	**–**
		–
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS	**135 491**	**–**
Avoirs nets en banque	238 721	–
Autres actifs	51	–
Moins autres passifs	(374 263)	–
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES	–	–

LES DIX PREMIÈRES PARTICIPATIONS SECTORIELLES AU 30 JUIN 2024 EN POURCENTAGE DE L'ACTIF NET

Exploitation minière	– %

(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.

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND* (suite)

Calendrier des investissements	**Au 30 juin 2024**

Abréviations

USD : Dollar américain

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	36,20
Actif circulant	63,80
	100,00

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME – 98,25 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 94,61 %)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 98,25 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 94,61 %)				
Australie - 0,55 % (31 décembre 2023 : 0,26 %)				
Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 0,669 %, 05/05/31 EMTN (i) (ii)	EUR	200 000	186 623	0,55
			186 623	0,55
Autriche - 0,85 % (31 décembre 2023 : 1,19 %)				
Erste Group Bank AG, 1,625 %, 08/09/31 EMTN (i) (ii)	EUR	200 000	188 871	0,55
OMV AG, 6,250 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	102 397	0,30
			291 268	0,85
Belgique - 1,76 % (31 décembre 2023 : 0,89 %)				
Azelis Finance NV, 5,750 %, 15/03/28 (ii)	EUR	100 000	102 625	0,30
Elia Group SA/NV, 5,850 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	103 000	0,30
KBC Group NV, 0,500 %, 03/12/29 EMTN (i) (ii)	EUR	200 000	196 500	0,58
KBC Group NV, 4,750 %, 17/04/35 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	100 822	0,30
Syensqo SA, 2,500 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	96 390	0,28
			599 337	1,76
Bermudes - 0,36 % (31 décembre 2023 : 0,31 %)				
Athora Holding Ltd, 5,875 %, 10/09/34 (ii)	EUR	125 000	122 865	0,36
			122 865	0,36
Îles Vierges britanniques - 0,29 % (31 décembre 2023 : 0,59 %)				
Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd, 1,000 %, 12/12/24 (ii)	EUR	100 000	98 470	0,29
			98 470	0,29
Îles Caïmans - 0,30 % (31 décembre 2023 : 0,32 %)				
UPCB Finance VII Ltd, 3,625 %, 15/06/29 (ii)	EUR	110 000	104 357	0,30
			104 357	0,30
République tchèque - 0,29 % (31 décembre 2023 : 0,58 %)				
Allwyn International AS, 3,875 %, 15/02/27 (ii)	EUR	100 000	98 077	0,29
			98 077	0,29
Danemark - 1,18 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Danske Bank A/S, 1,000 %, 15/05/31 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	94 651	0,28
Orsted AS, 1,500 %, 18/02/21 (i) (ii)	EUR	390 000	309 262	0,90
			403 913	1,18
Finlande - 1,92 % (31 décembre 2023 : 2,18 %)				
Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 2,000 %, 24/03/25 EMTN (ii)	EUR	100 000	98 137	0,29
Citycon OYJ, 3,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	255 000	161 925	0,47
Finnair OYJ, 4,750 %, 24/05/29 (ii)	EUR	200 000	196 816	0,58
Huhtamaki OYJ, 5,125 %, 24/11/28 (ii)	EUR	100 000	103 130	0,30
Sampo OYJ, 3,375 %, 23/05/49 (i) (ii)	EUR	100 000	94 943	0,28
			654 951	1,92
France - 24,29 % (31 décembre 2023 : 21,24 %)				
Accor SA, 7,250 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	108 382	0,32
AXA SA, 4,250 %, 10/03/43 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	97 275	0,28
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 1,125 %, 19/11/31 EMTN (ii)	EUR	200 000	159 751	0,47
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 4,375 %, 11/01/34 EMTN (ii)	EUR	100 000	97 761	0,29
BNP Paribas SA, 2,500 %, 31/03/32 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	95 030	0,28
CMA CGM SA, 5,500 %, 15/07/29 (ii)	EUR	111 000	110 938	0,32

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
France - 24,29 % (31 décembre 2023 : 21,24 %) (suite)				
CNP Assurances SACA, 1,250 %, 27/01/29 (ii)	EUR	100 000	88 366	0,26
CNP Assurances SACA, 5,250 %, 18/07/53 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	102 414	0,30
Crédit Agricole Assurances SA, 2,000 %, 17/07/30 (ii)	EUR	100 000	86 745	0,25
Crown European Holdings SA, 2,875 %, 01/02/26 (ii)	EUR	200 000	196 075	0,57
Crown European Holdings SA, 4,750 %, 15/03/29 (ii)	EUR	100 000	101 111	0,30
Électricité de France SA, 2,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	600 000	559 443	1,64
Électricité de France SA, 3,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	200 000	183 504	0,54
Électricité de France SA, 3,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	200 000	174 288	0,51
Elis SA, 2,875 %, 15/02/26 EMTN (ii)	EUR	100 000	98 250	0,29
ELO SACA, 3,250 %, 23/07/27 EMTN (ii)	EUR	300 000	276 052	0,81
ELO SACA, 5,875 %, 17/04/28 EMTN (ii)	EUR	100 000	98 400	0,29
ELO SACA, 6,000 %, 22/03/29 EMTN (ii)	EUR	100 000	98 180	0,29
Eramet SA, 6,500 %, 30/11/29 (ii)	EUR	200 000	200 934	0,59
Eutelsat SA, 1,500 %, 13/10/28 (ii)	EUR	100 000	80 501	0,24
Eutelsat SA, 2,250 %, 13/07/27 (ii)	EUR	100 000	87 752	0,26
Eutelsat SA, 9,750 %, 13/04/29 (ii)	EUR	125 000	130 250	0,38
Forvia SE, 2,375 %, 15/06/27 (ii)	EUR	145 000	136 069	0,40
Forvia SE, 2,750 %, 15/02/27 (ii)	EUR	400 000	381 657	1,12
Forvia SE, 3,125 %, 15/06/26 (ii)	EUR	115 000	112 269	0,33
Forvia SE, 5,125 %, 15/06/29 (ii)	EUR	100 000	100 125	0,29
Forvia SE, 5,500 %, 15/06/31 (ii)	EUR	100 000	100 765	0,30
Getlink SE, 3,500 %, 30/10/25 (ii)	EUR	100 000	99 000	0,29
Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement, 0,125 %, 16/09/25 (ii)	EUR	110 000	104 556	0,31
Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement, 0,625 %, 16/09/28 (ii)	EUR	250 000	212 279	0,62
iliad SA, 1,875 %, 11/02/28 (ii)	EUR	400 000	362 944	1,06
iliad SA, 2,375 %, 17/06/26 (ii)	EUR	200 000	192 982	0,57
iliad SA, 5,375 %, 02/05/31 (ii)	EUR	200 000	201 370	0,59
La Poste SA, 3,125 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	97 045	0,28
Loxam SAS, 2,875 %, 15/04/26 (ii)	EUR	100 000	97 374	0,29
Loxam SAS, 6,375 %, 15/05/28 EMTN (ii)	EUR	100 000	102 767	0,30
Nexans SA, 4,125 %, 29/05/29 (ii)	EUR	100 000	98 913	0,29
Paprec Holding SA, 7,250 %, 17/11/29 (ii)	EUR	200 000	209 828	0,61
RCI Banque SA, 1,625 %, 26/05/26 EMTN (ii)	EUR	100 000	96 166	0,28
RCI Banque SA, 2,625 %, 18/02/30 (i) (ii)	EUR	100 000	98 252	0,29
RCI Banque SA, 5,500 %, 09/10/34 EMTN (i) (ii)	EUR	200 000	199 448	0,58
Renault SA, 1,125 %, 04/10/27 (ii)	EUR	100 000	90 785	0,27
Renault SA, 2,000 %, 28/09/26 EMTN (ii)	EUR	300 000	286 125	0,84
Renault SA, 2,375 %, 25/05/26 EMTN (ii)	EUR	100 000	96 742	0,28
Renault SA, 2,500 %, 02/06/27 EMTN (ii)	EUR	100 000	95 288	0,28
Rexel SA, 5,250 %, 15/09/30 (ii)	EUR	200 000	204 460	0,60
SNF Group SACA, 2,625 %, 01/02/29 (ii)	EUR	315 000	293 344	0,86
Tereos Finance Groupe I SA, 4,750 %, 30/04/27 (ii)	EUR	110 000	109 175	0,32
Tereos Finance Groupe I SA, 5,875 %, 30/04/30 (ii)	EUR	200 000	199 969	0,59
Tereos Finance Groupe I SA, 7,500 %, 30/10/25 (ii)	EUR	100 000	100 750	0,30
TotalEnergies SE, 2,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	200 000	186 800	0,55
Valeo SE, 1,000 %, 03/08/28 EMTN (ii)	EUR	100 000	87 539	0,26

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
France - 24,29 % (31 décembre 2023 : 21,24 %) (suite)				
Valeo SE, 4,500 %, 11/04/30 EMTN (ii)	EUR	300 000	293 983	0,86
			8 280 171	24,29
Allemagne - 9,41 % (31 décembre 2023 : 7,52 %)				
Allianz SE, 4,597 %, 07/09/38 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	101 264	0,30
Allianz SE, 4,851 %, 26/07/54 (i) (ii)	EUR	100 000	102 685	0,30
Bayer AG, 3,125 %, 12/11/79 (i) (ii)	EUR	400 000	363 024	1,06
Bayer AG, 5,375 %, 25/03/82 (i) (ii)	EUR	200 000	190 280	0,56
Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,500 %, 23/04/75 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	97 125	0,28
CECONOMY AG, 1,750 %, 24/06/26 (ii)	EUR	100 000	96 146	0,28
Commerzbank AG, 4,875 %, 16/10/34 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	99 672	0,29
Evonik Industries AG, 1,375 %, 02/09/81 (i) (ii)	EUR	200 000	184 010	0,54
Gruenenthal GmbH, 4,125 %, 15/05/28 (ii)	EUR	100 000	97 500	0,29
HOCHTIEF AG, 4,250 %, 31/05/30 EMTN (ii)	EUR	100 000	100 702	0,29
IHO Verwaltungs GmbH, 3,875 %, 15/05/27 (ii)	EUR	100 000	98 117	0,29
IHO Verwaltungs GmbH, 8,750 %, 15/05/28 (ii)	EUR	100 000	106 994	0,31
INEOS Styrolution Ludwigshafen GmbH, 2,250 %, 16/01/27 (ii)	EUR	120 000	112 351	0,33
Infineon Technologies AG, 2,875 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	98 625	0,29
Mahle GmbH, 2,375 %, 14/05/28 EMTN (ii)	EUR	100 000	88 596	0,26
Mahle GmbH, 6,500 %, 02/05/31 (ii)	EUR	100 000	101 775	0,30
Merck KGaA, 1,625 %, 09/09/80 (i) (ii)	EUR	100 000	94 373	0,28
Novelis Sheet Ingot GmbH, 3,375 %, 15/04/29 EMTN (ii)	EUR	100 000	94 000	0,28
Schaeffler AG, 4,500 %, 14/08/26 EMTN (ii)	EUR	200 000	201 300	0,59
Schaeffler AG, 4,500 %, 28/03/30 EMTN (ii)	EUR	200 000	197 524	0,58
Schaeffler AG, 4,750 %, 14/08/29 EMTN (ii)	EUR	300 000	301 999	0,89
Talanx AG, 2,250 %, 05/12/47 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	93 343	0,27
ZF Finance GmbH, 2,000 %, 06/05/27 EMTN (ii)	EUR	200 000	186 620	0,55
			3 208 025	9,41
Guernesey - 0,26 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)				
Globalworth Real Estate Investments Ltd, 6,250 %, 31/03/30 EMTN (ii)	EUR	94 000	87 625	0,26
			87 625	0,26
Irlande - 2,07 % (31 décembre 2023 : 2,12 %)				
AIB Group PLC, 2,875 %, 30/05/31 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	96 941	0,28
Energia Group Roi Financeco DAC, 6,875 %, 31/07/28 (ii)	EUR	200 000	206 844	0,61
James Hardie International Finance DAC, 3,625 %, 01/10/26 (ii)	EUR	300 000	295 500	0,87
Permanent TSB Group Holdings PLC, 6,625 %, 25/04/28 (i) (ii)	EUR	100 000	105 356	0,31
			704 641	2,07
Île de Man - 0,29 % (31 décembre 2023 : 0,30 %)				
Playtech PLC, 4,250 %, 07/03/26 (ii)	EUR	100 000	98 443	0,29
			98 443	0,29
Italie – 8,35 % (31 décembre 2023 : 7,15 %)				
Amplifon SpA, 1,125 %, 13/02/27 (ii)	EUR	200 000	186 162	0,55
Assicurazioni Generali SpA, 5,800 %, 06/07/32 EMTN (ii)	EUR	200 000	215 898	0,63
Azzurra Aeroporti SpA, 2,625 %, 30/05/27 (ii)	EUR	100 000	94 524	0,28
Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA, 6,250 %, 17/05/27 (ii)	EUR	70 968	71 571	0,21
Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,625 %, 21/10/28 (ii)	EUR	100 000	92 244	0,27
Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,750 %, 19/04/31 EMTN (ii)	EUR	120 000	106 490	0,31
Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,875 %, 08/07/26 (ii)	EUR	200 000	192 871	0,56

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Italie - 8,35 % (31 décembre 2023 : 7,15 %) (suite)				
Lottomatica SpA, 5,375 %, 01/06/30 (ii)	EUR	110 000	111 377	0,33
Mundys SpA, 1,875 %, 12/02/28 (ii)	EUR	420 000	385 209	1,13
Poste Italiane SpA, 2,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	230 000	201 779	0,59
Telecom Italia SpA, 1,625 %, 18/01/29 EMTN (ii)	EUR	100 000	87 400	0,26
Telecom Italia SpA, 2,375 %, 12/10/27 EMTN (ii)	EUR	100 000	93 242	0,27
Telecom Italia SpA, 2,875 %, 28/01/26 EMTN (ii)	EUR	200 000	195 000	0,57
Telecom Italia SpA, 3,000 %, 30/09/25 EMTN (ii)	EUR	100 000	98 369	0,29
Telecom Italia SpA, 6,875 %, 15/02/28 (ii)	EUR	100 000	106 475	0,31
Telecom Italia SpA, 7,875 %, 31/07/28 (ii)	EUR	100 000	109 000	0,32
Terna - Rete Elettrica Nazionale, 2,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	210 000	193 725	0,57
Webuild SpA, 3,875 %, 28/07/26 (ii)	EUR	200 000	197 000	0,58
Webuild SpA, 5,375 %, 20/06/29 (ii)	EUR	110 000	109 238	0,32
			2 847 574	8,35
Luxembourg - 4,71 % (31 décembre 2023 : 3,82 %)				
Aroundtown Finance Sarl, 5,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	57 500	0,17
Birkenstock Financing Sarl, 5,250 %, 30/04/29 (ii)	EUR	100 000	100 900	0,30
CPI Property Group SA, 1,500 %, 27/01/31 EMTN (ii)	EUR	200 000	140 730	0,41
CPI Property Group SA, 1,625 %, 23/04/27 EMTN (ii) (iv)	EUR	200 000	178 750	0,52
CPI Property Group SA, 3,750 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	49 600	0,15
CPI Property Group SA, 4,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	135 000	85 725	0,25
CPI Property Group SA, 7,000 %, 07/05/29 EMTN (ii)	EUR	100 000	98 158	0,29
Euroclear Investments SA, 2,625 %, 11/04/48 (i) (ii)	EUR	100 000	93 625	0,27
Eurofins Scientific SE, 3,250 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	94 893	0,28
Eurofins Scientific SE, 6,750 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	100 554	0,29
Mytilineos Financial Partners SA, 2,500 %, 01/12/24 (ii)	EUR	100 000	98 720	0,29
SES SA, 2,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	315 000	296 612	0,87
Telecom Italia Finance SA, 7,750 %, 24/01/33 EMTN (ii)	EUR	100 000	117 750	0,35
Vivion Investments Sarl, 7,900 %, 28/02/29 EMTN (ii)	EUR	100 700	90 882	0,27
			1 604 399	4,71
Pays-Bas – 18,48 % (31 décembre 2023 : 17,49 %)				
Abertis Infraestructuras Finance BV, 2,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	300 000	281 040	0,82
ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, 22/02/33 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	102 046	0,30
Achmea BV, 5,625 %, 11/02/44 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	100 395	0,29
Akelius Residential Property Financing BV, 0,750 %, 22/02/30 EMTN (ii)	EUR	100 000	80 194	0,23
ASR Nederland NV, 3,375 %, 02/05/49 (i) (ii)	EUR	100 000	93 899	0,28
Boels Topholding BV, 5,750 %, 15/05/30 (ii)	EUR	205 000	207 880	0,61
de Volksbank NV, 1,750 %, 22/10/30 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	96 350	0,28
ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 % (i) (ii) (iii)	EUR	170 000	167 792	0,49
ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG, 3,375 %, 29/09/47 (i) (ii)	EUR	100 000	96 425	0,28
ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group, 4,500 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	200 000	199 661	0,59
Goodyear Europe BV, 2,750 %, 15/08/28 (ii)	EUR	120 000	108 456	0,32
ING Groep NV, 2,000 %, 22/03/30 (i) (ii)	EUR	100 000	98 028	0,29
ING Groep NV, 2,125 %, 26/05/31 EMTN (i) (ii)	EUR	300 000	288 528	0,85
Koninklijke FrieslandCampina NV, 2,850 % (i) (ii) (iii)	EUR	110 000	105 083	0,31
Koninklijke KPN NV, 4,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	111 000	111 860	0,33
OI European Group BV, 5,250 %, 01/06/29 (ii)	EUR	100 000	100 349	0,29

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Pays-Bas – 18,48 % (31 décembre 2023 : 17,49 %) (suite)				
OI European Group BV, 6,250 %, 15/05/28 (ii)	EUR	115 000	118 814	0,35
PPF Telecom Group BV, 2,125 %, 31/01/25 EMTN (ii)	EUR	200 000	197 447	0,58
PPF Telecom Group BV, 3,250 %, 29/09/27 EMTN (ii)	EUR	200 000	194 000	0,57
Saipem Finance International BV, 4,875 %, 30/05/30 EMTN (ii)	EUR	200 000	199 536	0,59
Telefonica Europe BV, 2,376 % (i) (ii) (iii)	EUR	300 000	267 317	0,78
Telefonica Europe BV, 3,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	500 000	493 369	1,45
Telefonica Europe BV, 5,752 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	102 276	0,30
TenneT Holding BV, 2,374 % (i) (ii) (iii)	EUR	200 000	194 500	0,57
TenneT Holding BV, 4,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	99 625	0,29
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, 15/10/24 (ii)	EUR	200 000	197 734	0,58
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,625 %, 15/10/28 (ii)	EUR	270 000	238 067	0,70
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,875 %, 31/03/27 (ii)	EUR	250 000	232 819	0,68
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4,375 %, 09/05/30 (ii)	EUR	400 000	387 188	1,14
Viterra Finance BV, 0,375 %, 24/09/25 EMTN (ii)	EUR	100 000	95 690	0,28
Wintershall Dea Finance 2 BV, 2,499 % (i) (ii) (iii)	EUR	400 000	373 648	1,10
ZF Europe Finance BV, 2,000 %, 23/02/26 (ii)	EUR	300 000	288 108	0,84
ZF Europe Finance BV, 2,500 %, 23/10/27 (ii)	EUR	200 000	187 493	0,55
ZF Europe Finance BV, 6,125 %, 13/03/29 EMTN (ii)	EUR	100 000	105 655	0,31
Ziggo BV, 2,875 %, 15/01/30 (ii)	EUR	100 000	87 567	0,26
			6 298 839	18,48
Norvège - 0,32 % (31 décembre 2023 : 0,95 %)				
Var Energi ASA, 7,862 %, 15/11/83 (i) (ii)	EUR	100 000	108 500	0,32
			108 500	0,32
Portugal - 1,69 % (31 décembre 2023 : 1,74 %)				
EDP - Energias de Portugal SA, 1,700 %, 20/07/80 (i) (ii)	EUR	400 000	389 000	1,14
EDP - Energias de Portugal SA, 1,875 %, 14/03/82 (i) (ii)	EUR	100 000	86 750	0,26
EDP - Energias de Portugal SA, 4,750 %, 29/05/54 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	99 375	0,29
			575 125	1,69
Espagne - 3,58 % (31 décembre 2023 : 6,14 %)				
Banco de Sabadell SA, 2,000 %, 17/01/30 (i) (ii)	EUR	100 000	98 114	0,29
Banco Santander SA, 1,625 %, 22/10/30 EMTN (ii)	EUR	100 000	86 180	0,25
CaixaBank SA, 1,250 %, 18/06/31 EMTN (i) (ii)	EUR	200 000	188 618	0,55
CaixaBank SA, 2,250 %, 17/04/30 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	97 874	0,29
Food Service Project SA, 5,500 %, 21/01/27 (ii)	EUR	100 000	100 070	0,30
Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, 18/09/27 (ii)	EUR	570 000	555 836	1,63
Mapfre SA, 2,875 %, 13/04/30 (ii)	EUR	100 000	92 693	0,27
			1 219 385	3,58
Suède - 2,29 % (31 décembre 2023 : 1,28 %)				
Akelius Residential Property AB, 2,249 %, 17/05/81 (i) (ii)	EUR	100 000	91 875	0,27
Dometic Group AB, 3,000 %, 08/05/26 EMTN (ii)	EUR	150 000	146 062	0,43
Heimstaden Bostad AB, 2,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	105 000	64 838	0,19
Heimstaden Bostad AB, 3,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	67 000	0,20
Svenska Handelsbanken AB, 3,250 %, 01/06/33 (i) (ii)	EUR	100 000	96 421	0,28
Volvo Car AB, 2,500 %, 07/10/27 EMTN (ii)	EUR	100 000	94 789	0,28

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Suède - 2,29 % (31 décembre 2023 : 1,28 %) (suite)				
Volvo Car AB, 4,750 %, 08/05/30 EMTN (ii)	EUR	220 000	220 275	0,64
			781 260	2,29
Royaume-Uni - 8,99 % (31 décembre 2023 : 9,17 %)				
BP Capital Markets PLC, 3,250 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	97 671	0,29
British Telecommunications PLC, 5,125 %, 03/10/54 EMTN (i) (ii)	EUR	210 000	210 523	0,62
Drax Finco PLC, 5,875 %, 15/04/29 (ii)	EUR	100 000	100 528	0,29
HSBC Holdings PLC, 4,599 %, 22/03/35 (i) (ii)	EUR	200 000	200 446	0,59
INEOS Finance PLC, 6,375 %, 15/04/29 (ii)	EUR	235 000	241 756	0,71
INEOS Quattro Finance 2 PLC, 8,500 %, 15/03/29 (ii)	EUR	100 000	105 875	0,31
International Game Technology PLC, 2,375 %, 15/04/28 (ii)	EUR	115 000	107 899	0,32
International Game Technology PLC, 3,500 %, 15/06/26 (ii)	EUR	200 000	197 300	0,58
Jaguar Land Rover Automotive PLC, 4,500 %, 15/07/28 (ii)	EUR	100 000	99 800	0,29
Lloyds Banking Group PLC, 4,375 %, 05/04/34 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	99 190	0,29
NGG Finance PLC, 2,125 %, 05/09/82 (i) (ii)	EUR	200 000	184 134	0,54
Nomad Foods Bondco PLC, 2,500 %, 24/06/28 (ii)	EUR	200 000	184 240	0,54
PEU Fin PLC, 7,250 %, 01/07/28 (ii)	EUR	100 000	104 000	0,30
Standard Chartered PLC, 1,200 %, 23/09/31 EMTN (i) (ii)	EUR	300 000	277 482	0,81
Vmed O2 UK Financing I PLC, 3,250 %, 31/01/31 (ii)	EUR	190 000	167 200	0,49
Vodafone Group PLC, 2,625 %, 27/08/80 (i) (ii)	EUR	275 000	264 361	0,78
Vodafone Group PLC, 4,200 %, 03/10/78 (i) (ii)	EUR	430 000	423 152	1,24
			3 065 557	8,99
États-Unis - 6,02 % (31 décembre 2023 : 8,25 %)				
Avantor Funding Inc, 2,625 %, 01/11/25	EUR	200 000	195 518	0,57
Belden Inc, 3,875 %, 15/03/28	EUR	100 000	96 844	0,29
Coty Inc, 3,875 %, 15/04/26	EUR	225 000	223 650	0,66
EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer Inc, 6,375 %, 15/12/30	EUR	100 000	103 496	0,30
Graphic Packaging International LLC, 2,625 %, 01/02/29	EUR	100 000	92 771	0,27
IQVIA Inc, 2,250 %, 15/01/28	EUR	400 000	372 000	1,09
IQVIA Inc, 2,875 %, 15/06/28	EUR	200 000	188 542	0,55
Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 2,875 %, 30/04/28	EUR	200 000	188 030	0,55
Silgan Holdings Inc, 3,250 %, 15/03/25	EUR	100 000	98 991	0,29
Standard Industries Inc, 2,250 %, 21/11/26	EUR	200 000	188 890	0,56
Warnermedia Holdings Inc, 4,693 %, 17/05/33	EUR	100 000	99 348	0,29
WMG Acquisition Corp, 2,250 %, 15/08/31	EUR	110 000	95 700	0,28
WMG Acquisition Corp, 2,750 %, 15/07/28	EUR	115 000	108 265	0,32
			2 052 045	6,02
TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES			**33 491 450**	**98,25**
TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES OBLIGATIONS À MOYEN TERME			**33 491 450**	**98,25**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (Coût : 32 966 180 EUR)			**33 491 450**	**98,25**

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS - 0,03 % (31 décembre 2023 : 0,04 %)

Contrats de change à terme en cours - 0,00 % (31 décembre 2023 : 0,00 %)

Date	Montant acheté	Montant vendu	Contrepartie	Plus-value/ (Moins-value) latente EUR	% de l'actif net
31/07/24	3 021 CHF	3 154 EUR	Brown Brothers Harriman	(11)	(0,00 %)
31/07/24	3 025 CHF	3 159 EUR	Brown Brothers Harriman	(11)	(0,00 %)
31/07/24	3 028 CHF	3 162 EUR	Brown Brothers Harriman	(11)	(0,00 %)
Moins-value latente sur les contrats de change à terme en cours				(33)	(0,00 %)
Moins-value latente nette sur les contrats de change à terme en cours				**(33)**	**(0,00 %)**

Contrats à terme normalisés - 0,03 % (31 décembre 2023 : 0,04 %)

Nombre de contrats	Libellé	Contrepartie	Engagement	Plus-value/ (Moins-value) latente	% de l'actif net
6	Euro-Bobl September 2024 Futures	JP Morgan	692 220	6 420	0,02 %
2	Euro-Bund September 2024 Futures	JP Morgan	259 420	3 820	0,01 %
1	Euro-Schatz September 2024 Futures	JP Morgan	105 200	500	0,00 %
Plus-value latente sur les contrats à terme normalisés				10 740	0,03 %
Plus-value nette latente sur contrats à terme normalisés				**10 740**	**0,03 %**

	Juste valeur EUR	% de l'actif net
Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**33 502 190**	**98,28**
Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**(33)**	**0,00**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS	**33 502 157**	**98,28**
Avoirs nets en banque	669 470	1,96
Autres actifs	1 731 360	5,08
Moins autres passifs	(1 815 383)	(5,32)
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES	**34 087 604**	**100,00**

Calendrier des investissements	**Au 30 juin 2024**

LES DIX PREMIÈRES PARTICIPATIONS SECTORIELLES AU 30 JUIN 2024 EN POURCENTAGE DE L'ACTIF NET

Automobile	13,39 %
Télécommunications	12,88 %
Activités bancaires	9,52 %
Électricité	8,75 %
Produits pharmaceutiques	6,38 %
Assurance	4,95 %
Ingénierie et construction	3,73 %
Immobilier	3,71 %
Produits chimiques	3,52 %
Santé	2,79 %

(i) Indique un titre à taux variable. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2024.
(ii) Titres émis par des émetteurs non américains ou non canadiens.
(iii) Obligations perpétuelles.
(iv) Indique un titre à coupon progressif. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2024.

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	93,28
Instruments financiers dérivés	0,03
Actif circulant	6,69
	100,00

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

Calendrier des investissements	**Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	**Juste valeur EUR**	**% de l'actif net**
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME – 96,69 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 97,23 %)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 96,69 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 97,23 %)				
Australie - 0,55 % (31 décembre 2023 : 0,63 %)				
Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 0,669 %, 05/05/31 EMTN (i) (ii)	EUR	300 000	279 934	0,20
National Australia Bank Ltd, 1,375 %, 30/08/28 EMTN (ii)	EUR	550 000	507 657	0,35
			787 591	0,55
Autriche - 0,81 % (31 décembre 2023 : 1,27 %)				
Erste Group Bank AG, 1,625 %, 08/09/31 EMTN (i) (ii)	EUR	400 000	377 741	0,26
Erste Group Bank AG, 4,250 %, 30/05/30 EMTN (i) (ii)	EUR	500 000	513 356	0,36
Raiffeisen Bank International AG, 0,050 %, 01/09/27 EMTN (ii)	EUR	300 000	265 811	0,19
			1 156 908	0,81
Belgique - 2,91 % (31 décembre 2023 : 3,26 %)				
Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,450 %, 22/09/31 EMTN (ii)	EUR	350 000	349 131	0,24
Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,750 %, 22/03/37 EMTN (ii)	EUR	400 000	398 140	0,28
Belfius Bank SA, 4,125 %, 12/09/29 EMTN (ii)	EUR	300 000	306 806	0,22
Elia Transmission Belgium SA, 0,875 %, 28/04/30 EMTN (ii)	EUR	300 000	257 467	0,18
Euroclear Bank SA, 3,625 %, 13/10/27 EMTN (ii)	EUR	500 000	503 574	0,35
FLUVIUS System Operator CV, 3,875 %, 18/03/31 EMTN (ii)	EUR	500 000	505 667	0,35
KBC Group NV, 0,500 %, 03/12/29 EMTN (i) (ii)	EUR	300 000	294 750	0,21
KBC Group NV, 0,625 %, 07/12/31 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	92 095	0,06
KBC Group NV, 0,750 %, 21/01/28 EMTN (i) (ii)	EUR	400 000	371 050	0,26
KBC Group NV, 3,000 %, 25/08/30 EMTN (ii)	EUR	400 000	383 184	0,27
KBC Group NV, 4,750 %, 17/04/35 EMTN (i) (ii)	EUR	200 000	201 644	0,14
Lonza Finance International NV, 1,625 %, 21/04/27 (ii)	EUR	150 000	142 676	0,10
Lonza Finance International NV, 3,875 %, 25/05/33 (ii)	EUR	350 000	350 630	0,25
			4 156 814	2,91
Bermudes - 0,17 % (31 décembre 2023 : 0,14 %)				
Athora Holding Ltd, 5,875 %, 10/09/34 (ii)	EUR	240 000	235 901	0,17
			235 901	0,17
Îles Vierges britanniques - 0,21 % (31 décembre 2023 : 0,23 %)				
Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd, 1,000 %, 12/12/24 (ii)	EUR	300 000	295 411	0,21
			295 411	0,21
Danemark - 1,48 % (31 décembre 2023 : 1,48 %)				
Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 3,250 %, 21/01/31 EMTN (ii)	EUR	672 000	670 254	0,47
Nykredit Realkredit AS, 1,375 %, 12/07/27 EMTN (ii)	EUR	430 000	403 676	0,28
Nykredit Realkredit AS, 3,875 %, 05/07/27 EMTN (ii)	EUR	400 000	401 417	0,28
Nykredit Realkredit AS, 4,000 %, 17/07/28 EMTN (ii)	EUR	300 000	301 427	0,21
Pandora A/S, 3,875 %, 31/05/30 EMTN (ii)	EUR	335 000	333 848	0,24
			2 110 622	1,48
Finlande - 1,41 % (31 décembre 2023 : 2,21 %)				
Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 2,000 %, 24/03/25 EMTN (ii)	EUR	200 000	196 274	0,14
Fortum OYJ, 4,500 %, 26/05/33 EMTN (ii)	EUR	390 000	405 344	0,28
Neste OYJ, 3,875 %, 21/05/31 EMTN (ii)	EUR	480 000	481 705	0,34
Nordea Bank Abp, 0,625 %, 18/08/31 EMTN (i) (ii)	EUR	475 000	444 066	0,31
Nordea Bank Abp, 1,125 %, 16/02/27 EMTN (ii)	EUR	420 000	394 973	0,27
Sampo OYJ, 3,375 %, 23/05/49 (i) (ii)	EUR	100 000	94 943	0,07
			2 017 305	1,41

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
France - 16,28 % (31 décembre 2023 : 17,06 %)				
APRR SA, 1,500 %, 25/01/30 EMTN (ii)	EUR	300 000	270 090	0,19
APRR SA, 3,125 %, 24/01/30 EMTN (ii)	EUR	500 000	488 457	0,34
AXA SA, 1,875 %, 10/07/42 EMTN (i) (ii)	EUR	290 000	239 822	0,17
AXA SA, 3,941 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	200 000	198 910	0,14
Ayvens SA, 4,375 %, 23/11/26 (ii)	EUR	500 000	506 139	0,35
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,250 %, 29/06/28 EMTN (ii)	EUR	500 000	438 718	0,31
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,250 %, 19/07/28 (ii)	EUR	700 000	606 925	0,42
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,625 %, 21/02/31 EMTN (ii)	EUR	600 000	485 838	0,34
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 1,125 %, 19/11/31 EMTN (ii)	EUR	400 000	319 502	0,22
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 1,250 %, 26/05/27 EMTN (ii)	EUR	400 000	374 580	0,26
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 3,500 %, 15/05/31 EMTN (ii)	EUR	400 000	395 262	0,28
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 4,000 %, 21/11/29 EMTN (ii)	EUR	300 000	304 492	0,21
Banque Stellantis France SACA, 3,500 %, 19/07/27 EMTN (ii)	EUR	400 000	398 186	0,28
BNP Paribas SA, 0,500 %, 19/02/28 EMTN (i) (ii)	EUR	600 000	550 385	0,38
BNP Paribas SA, 0,875 %, 11/07/30 EMTN (i) (ii)	EUR	500 000	430 042	0,30
BNP Paribas SA, 2,750 %, 25/07/28 EMTN (i) (ii)	EUR	400 000	387 630	0,27
BNP Paribas SA, 3,875 %, 23/02/29 EMTN (i) (ii)	EUR	700 000	704 679	0,49
BNP Paribas SA, 4,125 %, 26/09/32 EMTN (i) (ii)	EUR	400 000	409 704	0,29
Bouygues SA, 3,875 %, 17/07/31 (ii)	EUR	500 000	507 895	0,36
CNP Assurances SACA, 1,250 %, 27/01/29 (ii)	EUR	100 000	88 366	0,06
CNP Assurances SACA, 5,250 %, 18/07/53 EMTN (i) (ii)	EUR	100 000	102 414	0,07
Coentreprise de Transport d'Électricité SA, 2,125 %, 29/07/32 (ii)	EUR	300 000	265 366	0,19
Covivio Hotels SACA, 1,000 %, 27/07/29 (ii)	EUR	500 000	430 731	0,30
Covivio SA, 4,625 %, 05/06/32 EMTN (ii)	EUR	300 000	303 771	0,21
Crédit Agricole Assurances SA, 2,000 %, 17/07/30 (ii)	EUR	200 000	173 491	0,12
Crédit Agricole Assurances SA, 4,250 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	99 200	0,07
Crédit Agricole SA, 0,625 %, 12/01/28 (i) (ii)	EUR	1 000 000	923 895	0,65
Crédit Agricole SA, 0,875 %, 14/01/32 EMTN (ii)	EUR	500 000	402 887	0,28
Crédit Agricole SA, 1,000 %, 03/07/29 EMTN (ii)	EUR	400 000	354 070	0,25
Crédit Agricole SA, 3,750 %, 22/01/34 EMTN (ii)	EUR	400 000	399 145	0,28
Crédit Agricole SA, 4,250 %, 11/07/29 (i) (ii)	EUR	700 000	709 315	0,50
Danone SA, 3,470 %, 22/05/31 EMTN (ii)	EUR	700 000	699 049	0,49
Électricité de France SA, 2,000 %, 09/12/49 EMTN (ii)	EUR	300 000	185 701	0,13
Électricité de France SA, 4,125 %, 17/06/31 EMTN (ii)	EUR	300 000	302 293	0,21
Électricité de France SA, 4,375 %, 12/10/29 EMTN (ii)	EUR	400 000	410 147	0,29
Engie SA, 0,500 %, 24/10/30 EMTN (ii)	EUR	300 000	248 193	0,17
Engie SA, 3,875 %, 06/01/31 EMTN (ii)	EUR	100 000	100 625	0,07
Engie SA, 4,000 %, 11/01/35 EMTN (ii)	EUR	200 000	200 385	0,14
Engie SA, 4,250 %, 11/01/43 EMTN (ii)	EUR	200 000	195 831	0,14
Firmenich Productions Participations SAS, 1,750 %, 30/04/30 (ii)	EUR	345 000	313 608	0,22
Groupe des Assurances du Crédit Mutuel SADIR, 1,850 %, 21/04/42 (i) (ii)	EUR	100 000	80 765	0,06
Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,625 %, 18/09/29 EMTN (ii)	EUR	200 000	177 804	0,12

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
France - 16,28 % (31 décembre 2023 : 17,06 %) (suite)				
Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement, 0,625 %, 16/09/28 (ii)	EUR	330 000	280 208	0,20
HSBC Continental Europe SA, 1,375 %, 04/09/28 EMTN (ii)	EUR	800 000	737 367	0,52
Klepierre SA, 0,625 %, 01/07/30 EMTN (ii)	EUR	300 000	248 171	0,17
La Poste SA, Zero Coupon Bond, 18/07/29 EMTN (ii)	EUR	200 000	167 403	0,12
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3,250 %, 07/09/29 EMTN (ii)	EUR	700 000	700 314	0,49
Orange SA, 1,375 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	500 000	430 625	0,30
Orange SA, Zero Coupon Bond, 04/09/26 EMTN (ii)	EUR	500 000	464 305	0,32
Pernod Ricard SA, 3,250 %, 02/11/28 EMTN (ii)	EUR	200 000	198 064	0,14
Praemia Healthcare SACA, 0,875 %, 04/11/29 (ii)	EUR	200 000	167 039	0,12
Praemia Healthcare SACA, 5,500 %, 19/09/28 (ii)	EUR	200 000	207 023	0,14
RTE Réseau de Transport d'Électricité SADIR, 3,750 %, 04/07/35 EMTN (ii)	EUR	500 000	497 977	0,35
Sanofi SA, 1,250 %, 06/04/29 (ii)	EUR	400 000	365 431	0,26
Société Générale SA, 0,250 %, 08/07/27 EMTN (ii)	EUR	700 000	632 197	0,44
Société Générale SA, 0,625 %, 02/12/27 (i) (ii)	EUR	900 000	830 286	0,58
Société Générale SA, 5,625 %, 02/06/33 EMTN (ii)	EUR	200 000	208 225	0,15
Sogecap SA, 6,500 %, 16/05/44 (i) (ii)	EUR	200 000	213 454	0,15
Suez SACA, 2,375 %, 24/05/30 EMTN (ii)	EUR	500 000	460 416	0,32
TotalEnergies Capital International SA, 0,696 %, 31/05/28 EMTN (ii)	EUR	400 000	361 360	0,25
TotalEnergies Capital International SA, 1,618 %, 18/05/40 EMTN (ii)	EUR	200 000	149 461	0,10
TotalEnergies SE, 2,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	420 000	392 280	0,27
Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1,875 %, 15/01/31 EMTN (ii)	EUR	100 000	88 000	0,06
Unibail-Rodamco-Westfield SE, 4,125 %, 11/12/30 EMTN (ii)	EUR	300 000	300 901	0,21
			23 284 815	16,28
Allemagne - 9,05 % (31 décembre 2023 : 9,75 %)				
Allianz SE, 4,597 %, 07/09/38 EMTN (i) (ii)	EUR	300 000	303 790	0,21
Allianz SE, 4,851 %, 26/07/54 (i) (ii)	EUR	100 000	102 685	0,07
Allianz SE, 5,824 %, 25/07/53 (i) (ii)	EUR	100 000	109 510	0,08
BASF SE, 4,500 %, 08/03/35 EMTN (ii)	EUR	300 000	316 895	0,22
Bayer AG, 1,125 %, 06/01/30 (ii)	EUR	400 000	345 054	0,24
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, 15/02/25 (ii)	EUR	345 000	339 075	0,24
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,000 %, 15/08/24 (ii)	EUR	480 000	478 563	0,33
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,000 %, 04/01/37 (ii)	EUR	1 275 000	1 463 220	1,02
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Zero Coupon Bond, 15/02/32 (ii)	EUR	700 000	584 628	0,41
Commerzbank AG, 3,000 %, 14/09/27 (i) (ii)	EUR	300 000	294 125	0,20
Commerzbank AG, 5,250 %, 25/03/29 (i) (ii)	EUR	400 000	416 349	0,29
Deutsche Bahn Finance GmbH, 1,375 %, 03/03/34 EMTN (ii)	EUR	465 000	389 397	0,27
Deutsche Bahn Finance GmbH, 4,000 %, 23/11/43 EMTN (ii)	EUR	100 000	102 729	0,07
Deutsche Bank AG, 1,375 %, 03/09/26 EMTN (i) (ii)	EUR	200 000	194 139	0,14
Deutsche Bank AG, 1,750 %, 19/11/30 EMTN (i) (ii)	EUR	300 000	263 673	0,18
Deutsche Boerse AG, 3,750 %, 28/09/29 (ii)	EUR	1 000 000	1 018 126	0,71

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Allemagne - 9,05 % (31 décembre 2023 : 9,75 %) (suite)				
E.ON SE, 3,375 %, 15/01/31 (ii)	EUR	515 000	509 032	0,36
Eurogrid GmbH, 3,722 %, 27/04/30 EMTN (ii)	EUR	200 000	199 410	0,14
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide, 4,250 %, 11/06/32 (ii)	EUR	339 000	341 848	0,24
Hannover Rueck SE, 3,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	98 500	0,07
HOCHTIEF AG, 4,250 %, 31/05/30 EMTN (ii)	EUR	605 000	609 247	0,43
HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, 1,125 %, 01/11/33 EMTN (ii)	EUR	400 000	316 455	0,22
HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, Zero Coupon Bond, 01/11/24 EMTN (ii)	EUR	400 000	394 404	0,28
Infineon Technologies AG, 1,625 %, 24/06/29 EMTN (ii)	EUR	500 000	459 318	0,32
Knorr-Bremse AG, 3,250 %, 21/09/27 EMTN (ii)	EUR	400 000	397 286	0,28
Merck KGaA, 1,625 %, 09/09/80 (i) (ii)	EUR	200 000	188 746	0,13
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, 26/05/49 (i) (ii)	EUR	100 000	96 348	0,07
Porsche Automobil Holding SE, 3,750 %, 27/09/29 EMTN (ii)	EUR	400 000	394 419	0,28
Robert Bosch GmbH, 4,375 %, 02/06/43 EMTN (ii)	EUR	300 000	305 625	0,21
Volkswagen Bank GmbH, 2,500 %, 31/07/26 EMTN (ii)	EUR	500 000	486 911	0,34
Volkswagen Bank GmbH, 4,625 %, 03/05/31 EMTN (ii)	EUR	400 000	412 950	0,29
Volkswagen Financial Services AG, 3,875 %, 10/09/30 (ii)	EUR	400 000	399 600	0,28
Volkswagen Leasing GmbH, 4,625 %, 25/03/29 EMTN (ii)	EUR	100 000	103 244	0,07
Vonovia SE, 1,000 %, 16/06/33 (ii)	EUR	200 000	151 927	0,11
Vonovia SE, 2,125 %, 22/03/30 EMTN (ii)	EUR	400 000	360 761	0,25
			12 947 989	9,05
Irlande - 2,12 % (31 décembre 2023 : 2,54 %)				
AIB Group PLC, 5,250 %, 23/10/31 EMTN (i) (ii)	EUR	350 000	374 005	0,26
Bank of Ireland Group PLC, 0,375 %, 10/05/27 EMTN (i) (ii)	EUR	275 000	258 663	0,18
Bank of Ireland Group PLC, 4,750 %, 10/08/34 EMTN (i) (ii)	EUR	275 000	274 830	0,19
CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, 11/07/27 EMTN (ii)	EUR	400 000	405 299	0,29
CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, 11/07/31 EMTN (ii)	EUR	365 000	370 603	0,26
CRH SMW Finance DAC, 4,250 %, 11/07/35 EMTN (ii)	EUR	200 000	204 036	0,14
James Hardie International Finance DAC, 3,625 %, 01/10/26 (ii)	EUR	250 000	246 250	0,17
Linde PLC, 1,625 %, 31/03/35 (ii)	EUR	300 000	247 915	0,17
Lunar Funding V for Swisscom AG, 1,125 %, 12/10/26 (ii)	EUR	130 000	123 552	0,09
Permanent TSB Group Holdings PLC, 6,625 %, 25/04/28 (i) (ii)	EUR	505 000	532 048	0,37
			3 037 201	2,12
Italie – 1,88 % (31 décembre 2023 : 2,38 %)				
A2A SpA, 0,625 %, 15/07/31 EMTN (ii)	EUR	260 000	207 771	0,15
ENI SpA, 2,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	255 000	247 731	0,17
Intesa Sanpaolo SpA, 1,000 %, 19/11/26 EMTN (ii)	EUR	300 000	281 798	0,20
Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, 04/07/29 EMTN (ii)	EUR	300 000	273 688	0,19
Intesa Sanpaolo SpA, 4,000 %, 19/05/26 EMTN (ii)	EUR	320 000	321 793	0,23
Snam SpA, 0,875 %, 25/10/26 EMTN (ii)	EUR	430 000	404 212	0,28
Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3,500 %, 17/01/31 EMTN (ii)	EUR	400 000	393 262	0,27
UniCredit SpA, 0,850 %, 19/01/31 EMTN (ii)	EUR	670 000	554 434	0,39
			2 684 689	1,88
Japon - 0,23 % (31 décembre 2023 : 0,55 %)				
Asahi Group Holdings Ltd, 0,541 %, 23/10/28 (ii)	EUR	380 000	335 008	0,23
			335 008	0,23

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Jersey, Îles Anglo-Normandes - 0,15 % (31 décembre 2023 : 0,34 %)				
Heathrow Funding Ltd, 1,875 %, 14/03/34 EMTN (ii)	EUR	250 000	207 294	0,15
			207 294	0,15
Luxembourg - 3,50 % (31 décembre 2023 : 4,39 %)				
Aroundtown Finance Sarl, 5,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	57 500	0,04
Aroundtown Finance Sarl, 7,125 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	74 800	0,05
Aroundtown SA, 0,375 %, 15/04/27 EMTN (ii)	EUR	300 000	260 055	0,18
CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 0,750 %, 17/04/26 (ii)	EUR	310 000	293 811	0,21
DH Europe Finance II Sarl, 0,450 %, 18/03/28 (ii)	EUR	300 000	269 907	0,19
Euroclear Investments SA, 1,125 %, 07/12/26 (ii)	EUR	300 000	284 904	0,20
Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 4,875 %, 21/11/33 EMTN (ii)	EUR	150 000	158 937	0,11
Highland Holdings Sarl, 0,318 %, 15/12/26 (ii)	EUR	200 000	184 807	0,13
John Deere Bank SA, 3,300 %, 15/10/29 EMTN (ii)	EUR	399 000	397 342	0,28
Medtronic Global Holdings SCA, 0,375 %, 15/10/28 (ii)	EUR	690 000	608 214	0,42
Medtronic Global Holdings SCA, 1,000 %, 02/07/31 (ii)	EUR	320 000	272 412	0,19
Medtronic Global Holdings SCA, 1,500 %, 02/07/39 (ii)	EUR	455 000	332 678	0,23
Medtronic Global Holdings SCA, 1,625 %, 07/03/31 (ii)	EUR	250 000	223 246	0,16
Nestlé Finance International Ltd, 3,250 %, 23/01/37 EMTN (ii)	EUR	460 000	445 911	0,31
Novartis Finance SA, Zero Coupon Bond, 23/09/28 (ii)	EUR	335 000	293 594	0,20
Prologis International Funding II SA, 3,625 %, 07/03/30 EMTN (ii)	EUR	260 000	254 722	0,18
Traton Finance Luxembourg SA, 3,750 %, 27/03/30 EMTN (ii)	EUR	400 000	394 681	0,28
Traton Finance Luxembourg SA, 4,500 %, 23/11/26 EMTN (ii)	EUR	200 000	202 660	0,14
			5 010 181	3,50
Pays-Bas – 17,23 % (31 décembre 2023 : 14,56 %)				
ABN AMRO Bank NV, 0,500 %, 23/09/29 EMTN (ii)	EUR	400 000	339 802	0,24
ABN AMRO Bank NV, 4,375 %, 20/10/28 (ii)	EUR	200 000	205 005	0,14
Achmea BV, 5,625 %, 11/02/44 EMTN (i) (ii)	EUR	105 000	105 415	0,07
Airbus SE, 1,625 %, 09/06/30 EMTN (ii)	EUR	475 000	426 983	0,30
Akelius Residential Property Financing BV, 0,750 %, 22/02/30 EMTN (ii)	EUR	450 000	360 874	0,25
Alliander NV, 3,250 %, 13/06/28 EMTN (ii)	EUR	310 000	309 511	0,22
Allianz Finance II BV, 3,250 %, 12/04/29 EMTN (ii)	EUR	300 000	299 552	0,21
American Medical Systems Europe BV, 0,750 %, 08/03/25 (ii)	EUR	350 000	342 798	0,24
American Medical Systems Europe BV, 3,500 %, 08/03/32 (ii)	EUR	500 000	492 646	0,34
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 2,000 %, 17/09/30 (ii)	EUR	300 000	275 259	0,19
ASML Holding NV, 0,250 %, 25/02/30 (ii)	EUR	235 000	199 496	0,14
BNI Finance BV, 3,875 %, 01/12/30 (ii)	EUR	780 000	789 956	0,55
BP Capital Markets BV, 4,323 %, 12/05/35 EMTN (ii)	EUR	140 000	144 738	0,10
Coca-Cola HBC Finance BV, 0,625 %, 21/11/29 (ii)	EUR	160 000	137 738	0,10
Compass Group Finance Netherlands BV, 3,000 %, 08/03/30 EMTN (ii)	EUR	700 000	684 062	0,48
Cooperatieve Rabobank UA, 4,233 %, 25/04/29 EMTN (i) (ii)	EUR	500 000	510 348	0,36
Daimler Truck International Finance BV, 1,625 %, 06/04/27 EMTN (ii)	EUR	500 000	476 392	0,33
Daimler Truck International Finance BV, 3,875 %, 19/06/26 EMTN (ii)	EUR	200 000	201 253	0,14
Danfoss Finance II BV, 0,750 %, 28/04/31 EMTN (ii)	EUR	345 000	281 457	0,20

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Pays-Bas – 17,23 % (31 décembre 2023 : 14,56 %) (suite)				
de Volksbank NV, 1,750 %, 22/10/30 EMTN (i) (ii)	EUR	300 000	289 051	0,20
de Volksbank NV, 2,375 %, 04/05/27 (i) (ii)	EUR	400 000	388 828	0,27
ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 % (i) (ii) (iii)	EUR	355 000	350 389	0,25
ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG, 3,375 %, 29/09/47 (i) (ii)	EUR	285 000	274 812	0,19
Enel Finance International NV, 0,250 %, 28/05/26 EMTN (ii)	EUR	460 000	432 351	0,30
Enel Finance International NV, 0,875 %, 28/09/34 EMTN (ii)	EUR	340 000	253 472	0,18
Enel Finance International NV, 4,500 %, 20/02/43 EMTN (ii)	EUR	300 000	298 754	0,21
Essity Capital BV, 3,000 %, 21/09/26 EMTN (ii)	EUR	540 000	536 015	0,37
Euronext NV, 1,125 %, 12/06/29 (ii)	EUR	310 000	278 159	0,19
Heimstaden Bostad Treasury BV, 1,625 %, 13/10/31 EMTN (ii)	EUR	250 000	177 575	0,12
Heineken NV, 1,250 %, 17/03/27 EMTN (ii)	EUR	400 000	378 334	0,26
Heineken NV, 3,812 %, 04/07/36 EMTN (ii)	EUR	541 000	538 578	0,38
Iberdrola International BV, 1,874 % (i) (ii) (iii)	EUR	500 000	479 320	0,34
ING Groep NV, 0,250 %, 18/02/29 (i) (ii)	EUR	1 100 000	968 643	0,68
ING Groep NV, 0,375 %, 29/09/28 (i) (ii)	EUR	400 000	359 720	0,25
ING Groep NV, 2,000 %, 22/03/30 (i) (ii)	EUR	700 000	686 195	0,48
ING Groep NV, 4,875 %, 14/11/27 EMTN (i) (ii)	EUR	400 000	409 732	0,29
JAB Holdings BV, 4,375 %, 25/04/34 (ii)	EUR	200 000	200 777	0,14
Koninklijke Ahold Delhaize NV, 3,875 %, 11/03/36 (ii)	EUR	245 000	244 345	0,17
Koninklijke KPN NV, 1,125 %, 11/09/28 (ii)	EUR	200 000	182 949	0,13
Lseg Netherlands BV, 4,125 %, 29/09/26 EMTN (ii)	EUR	700 000	708 266	0,50
Mercedes-Benz International Finance BV, 3,250 %, 15/11/30 EMTN (ii)	EUR	1 000 000	984 542	0,69
Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0,375 %, 22/09/29 (ii)	EUR	490 000	418 225	0,29
MSD Netherlands Capital BV, 3,500 %, 30/05/37 (ii)	EUR	248 000	244 312	0,17
Nederlandse Gasunie NV, 0,375 %, 03/10/31 EMTN (ii)	EUR	105 000	84 759	0,06
Nederlandse Gasunie NV, 3,375 %, 11/07/34 EMTN (ii)	EUR	160 000	157 529	0,11
PACCAR Financial Europe BV, Zero Coupon Bond, 01/03/26 EMTN (ii)	EUR	390 000	368 094	0,26
Pluxee NV, 3,750 %, 04/09/32 (ii)	EUR	200 000	196 576	0,14
Prosus NV, 2,085 %, 19/01/30 (ii)	EUR	180 000	158 047	0,11
Randstad NV, 3,610 %, 12/03/29 EMTN (ii)	EUR	485 000	481 294	0,34
Roche Finance Europe BV, 3,204 %, 27/08/29 (ii)	EUR	360 000	360 450	0,25
Roche Finance Europe BV, 3,586 %, 04/12/36 (ii)	EUR	390 000	392 952	0,27
Shell International Finance BV, 1,500 %, 07/04/28 EMTN (ii)	EUR	455 000	424 980	0,30
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2,750 %, 09/09/30 EMTN (ii)	EUR	100 000	97 436	0,07
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,000 %, 09/08/33 EMTN (ii)	EUR	100 000	96 798	0,07
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,625 %, 22/02/44 (ii)	EUR	300 000	290 316	0,20
Sika Capital BV, 3,750 %, 03/11/26 (ii)	EUR	500 000	502 237	0,35
Stedin Holding NV, 0,875 %, 24/10/25 EMTN (ii)	EUR	200 000	192 996	0,13
Stedin Holding NV, 2,375 %, 03/06/30 EMTN (ii)	EUR	390 000	365 942	0,26
Stellantis NV, 3,500 %, 19/09/30 EMTN (ii)	EUR	310 000	303 739	0,21
Swisscom Finance BV, 3,625 %, 29/11/36 EMTN (ii)	EUR	300 000	297 503	0,21
Telefonica Europe BV, 3,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	300 000	296 021	0,21
TenneT Holding BV, 1,375 %, 26/06/29 EMTN (ii)	EUR	300 000	273 445	0,19
TenneT Holding BV, 1,500 %, 03/06/39 EMTN (ii)	EUR	175 000	133 984	0,09

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Pays-Bas – 17,23 % (31 décembre 2023 : 14,56 %) (suite)				
TenneT Holding BV, 4,500 %, 28/10/34 EMTN (ii)	EUR	270 000	287 707	0,20
TenneT Holding BV, 4,750 %, 28/10/42 EMTN (ii)	EUR	175 000	190 215	0,13
Toyota Motor Finance Netherlands BV, 3,125 %, 11/01/27 EMTN (ii)	EUR	310 000	307 473	0,21
Vesteda Finance BV, 0,750 %, 18/10/31 EMTN (ii)	EUR	525 000	422 518	0,30
Vesteda Finance BV, 2,000 %, 10/07/26 EMTN (ii)	EUR	480 000	463 396	0,32
Volkswagen International Finance NV, 3,500 % (i) (ii) (iii)	EUR	200 000	179 241	0,13
Volkswagen International Finance NV, 3,748 % (i) (ii) (iii)	EUR	100 000	95 012	0,07
Wintershall Dea Finance 2 BV, 2,499 % (i) (ii) (iii)	EUR	200 000	186 824	0,13
Wintershall Dea Finance BV, 1,823 %, 25/09/31 (ii)	EUR	200 000	168 336	0,12
WPC Eurobond BV, 2,250 %, 19/07/24 (ii)	EUR	200 000	199 751	0,14
			24 642 200	17,23
Nouvelle-Zélande - 0,33 % (31 décembre 2023 : 0,49 %)				
ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0,200 %, 23/09/27 EMTN (ii)	EUR	525 000	472 630	0,33
			472 630	0,33
Norvège - 2,36 % (31 décembre 2023 : 2,01 %)				
DNB Bank ASA, 0,250 %, 23/02/29 EMTN (i) (ii)	EUR	670 000	592 090	0,41
DNB Bank ASA, 0,375 %, 18/01/28 EMTN (i) (ii)	EUR	290 000	267 643	0,19
DNB Bank ASA, 4,625 %, 01/11/29 EMTN (i) (ii)	EUR	150 000	155 469	0,11
Equinor ASA, 1,250 %, 17/02/27 EMTN (ii)	EUR	340 000	322 153	0,23
Santander Consumer Bank AS, 0,500 %, 11/08/25 EMTN (ii)	EUR	700 000	675 933	0,47
Statkraft AS, 1,500 %, 26/03/30 EMTN (ii)	EUR	446 000	401 777	0,28
Statnett SF, 0,875 %, 08/03/25 EMTN (ii)	EUR	225 000	220 652	0,16
Statnett SF, 1,250 %, 26/04/30 EMTN (ii)	EUR	475 000	420 079	0,29
Telenor ASA, 0,750 %, 31/05/26 EMTN (ii)	EUR	330 000	313 645	0,22
			3 369 441	2,36
Portugal - 0,20 % (31 décembre 2023 : 0,55 %)				
EDP - Energias de Portugal SA, 1,700 %, 20/07/80 (i) (ii)	EUR	300 000	291 750	0,20
			291 750	0,20
Espagne - 5,21 % (31 décembre 2023 : 3,59 %)				
Aena SME SA, 4,250 %, 13/10/30 EMTN (ii)	EUR	400 000	414 213	0,29
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,125 %, 24/03/27 EMTN (i) (ii)	EUR	400 000	376 768	0,26
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,375 %, 15/11/26 EMTN (ii)	EUR	500 000	464 790	0,32
Banco de Sabadell SA, 5,250 %, 02/07/29 EMTN (i) (ii)	EUR	300 000	311 409	0,22
Banco Santander SA, 3,500 %, 09/01/28 EMTN (i) (ii)	EUR	900 000	896 582	0,63
Banco Santander SA, 3,875 %, 22/04/29 EMTN (ii)	EUR	300 000	300 286	0,21
Banco Santander SA, 4,875 %, 18/10/31 EMTN (ii)	EUR	300 000	316 841	0,22
CaixaBank SA, 0,500 %, 09/02/29 EMTN (i) (ii)	EUR	400 000	355 838	0,25
CaixaBank SA, 0,750 %, 09/07/26 (ii)	EUR	900 000	849 406	0,59
CaixaBank SA, 1,250 %, 18/06/31 EMTN (i) (ii)	EUR	300 000	282 928	0,20
CaixaBank SA, 2,250 %, 17/04/30 EMTN (i) (ii)	EUR	200 000	195 749	0,14
CaixaBank SA, 4,250 %, 06/09/30 EMTN (ii)	EUR	500 000	516 727	0,36
Cellnex Finance Co SA, 0,750 %, 15/11/26 EMTN (ii)	EUR	200 000	187 012	0,13
Cellnex Telecom SA, 1,750 %, 23/10/30 EMTN (ii)	EUR	700 000	613 785	0,43
Cepsa Finance SA, 4,125 %, 11/04/31 EMTN (ii)	EUR	700 000	685 605	0,48
EDP Servicios Financieros Espana SA, 3,500 %, 16/07/30 EMTN (ii)	EUR	400 000	395 292	0,28

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Espagne - 5,21 % (31 décembre 2023 : 3,59 %) (suite)				
Telefonica Emisiones SA, 2,318 %, 17/10/28 EMTN (ii)	EUR	300 000	286 500	0,20
			7 449 731	5,21
Suède - 3,16 % (31 décembre 2023 : 3,11 %)				
Epiroc AB, 3,625 %, 28/02/31 EMTN (ii)	EUR	430 000	425 067	0,30
Investor AB, 1,500 %, 12/09/30 EMTN (ii)	EUR	675 000	607 165	0,42
Molnlycke Holding AB, 0,875 %, 05/09/29 EMTN (ii)	EUR	400 000	345 221	0,24
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,750 %, 09/08/27 EMTN (ii)	EUR	350 000	321 297	0,23
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3,875 %, 09/05/28 EMTN (ii)	EUR	750 000	761 930	0,53
Telia Co AB, 3,625 %, 22/02/32 EMTN (ii)	EUR	700 000	702 202	0,49
Vattenfall AB, 0,125 %, 12/02/29 EMTN (ii)	EUR	220 000	189 346	0,13
Vattenfall AB, 3,750 %, 18/10/26 EMTN (ii)	EUR	495 000	497 489	0,35
Volvo Treasury AB, 3,875 %, 29/08/26 EMTN (ii)	EUR	670 000	674 589	0,47
			4 524 306	3,16
Suisse - 1,66 % (31 décembre 2023 : 2,24 %)				
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 5,230 %, 01/11/27 EMTN (ii)	EUR	200 000	208 072	0,15
UBS AG, 0,250 %, 01/09/28 EMTN (ii)	EUR	750 000	656 363	0,46
UBS AG, 0,500 %, 31/03/31 EMTN (ii)	EUR	330 000	268 657	0,19
UBS Group AG, 0,250 %, 03/11/26 (i) (ii)	EUR	275 000	261 635	0,18
UBS Group AG, 0,625 %, 18/01/33 EMTN (ii)	EUR	365 000	278 375	0,19
UBS Group AG, 2,875 %, 02/04/32 (i) (ii)	EUR	150 000	140 257	0,10
UBS Group AG, 7,750 %, 01/03/29 (i) (ii)	EUR	500 000	564 811	0,39
			2 378 170	1,66
Royaume-Uni - 9,29 % (31 décembre 2023 : 6,80 %)				
AstraZeneca PLC, 3,750 %, 03/03/32 EMTN (ii)	EUR	700 000	716 545	0,50
Barclays PLC, 0,877 %, 28/01/28 (i) (ii)	EUR	300 000	278 991	0,20
Barclays PLC, 4,918 %, 08/08/30 EMTN (i) (ii)	EUR	130 000	135 264	0,10
BG Energy Capital PLC, 2,250 %, 21/11/29 EMTN (ii)	EUR	670 000	629 508	0,44
BP Capital Markets PLC, 1,231 %, 08/05/31 EMTN (ii)	EUR	1 250 000	1 068 187	0,75
British Telecommunications PLC, 1,500 %, 23/06/27 EMTN (ii)	EUR	315 000	297 339	0,21
Chanel Ceres PLC, 0,500 %, 31/07/26 (ii)	EUR	470 000	438 687	0,31
Chanel Ceres PLC, 1,000 %, 31/07/31 (ii)	EUR	280 000	231 009	0,16
Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1,875 %, 18/03/30 (ii)	EUR	440 000	402 471	0,28
DS Smith PLC, 4,375 %, 27/07/27 EMTN (ii)	EUR	425 000	433 451	0,30
GlaxoSmithKline Capital PLC, 1,375 %, 12/09/29 (ii)	EUR	200 000	180 975	0,13
GlaxoSmithKline Capital PLC, 1,750 %, 21/05/30 EMTN (ii)	EUR	335 000	305 483	0,21
HSBC Holdings PLC, 4,599 %, 22/03/35 (i) (ii)	EUR	400 000	400 893	0,28
HSBC Holdings PLC, 4,787 %, 10/03/32 EMTN (i) (ii)	EUR	300 000	314 218	0,22
International Distribution Services PLC, 5,250 %, 14/09/28 (ii)	EUR	310 000	318 169	0,22
Lloyds Banking Group PLC, 3,125 %, 24/08/30 EMTN (i) (ii)	EUR	400 000	386 098	0,27
Motability Operations Group PLC, 4,000 %, 17/01/30 EMTN (ii)	EUR	515 000	521 053	0,36
National Gas Transmission PLC, 4,250 %, 05/04/30 EMTN (ii)	EUR	325 000	330 412	0,23
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC, 3,530 %, 20/09/28 EMTN (ii)	EUR	745 000	740 902	0,52
Nationwide Building Society, 2,000 %, 25/07/29 EMTN (i) (ii)	EUR	350 000	349 461	0,24
Nationwide Building Society, 4,500 %, 01/11/26 EMTN (ii)	EUR	760 000	775 568	0,54
NatWest Group PLC, 4,771 %, 16/02/29 EMTN (i) (ii)	EUR	400 000	411 946	0,29

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Royaume-Uni – 9,29 % (31 décembre 2023 : 6,80 %) (suite)				
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 3,875 %, 14/09/33 EMTN (ii)	EUR	500 000	502 036	0,35
Severn Trent Utilities Finance PLC, 4,000 %, 05/03/34 EMTN (ii)	EUR	200 000	195 940	0,14
SSE PLC, 4,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	230 000	224 777	0,16
Standard Chartered PLC, 0,800 %, 17/11/29 (i) (ii)	EUR	500 000	438 350	0,31
Standard Chartered PLC, 1,200 %, 23/09/31 EMTN (i) (ii)	EUR	500 000	462 470	0,32
Virgin Money UK PLC, 4,000 %, 18/03/28 EMTN (i) (ii)	EUR	600 000	600 983	0,42
Vodafone Group PLC, 1,625 %, 24/11/30 EMTN (ii)	EUR	840 000	748 477	0,52
WPP Finance 2013, 3,625 %, 12/09/29 EMTN (ii)	EUR	450 000	446 339	0,31
			13 286 002	9,29
États-Unis - 16,50 % (31 décembre 2023 : 16,38 %)				
AbbVie Inc, 2,125 %, 17/11/28	EUR	330 000	313 067	0,22
Air Lease Corp, 3,700 %, 15/04/30 EMTN	EUR	400 000	391 960	0,27
American Tower Corp, 0,500 %, 15/01/28	EUR	310 000	276 671	0,19
American Tower Corp, 0,875 %, 21/05/29	EUR	685 000	595 409	0,42
AT&T Inc, 1,600 %, 19/05/28	EUR	975 000	908 525	0,64
AT&T Inc, 4,300 %, 18/11/34	EUR	335 000	346 726	0,24
Bank of America Corp, 0,583 %, 24/08/28 EMTN (i)	EUR	1 235 000	1 122 399	0,78
BMW US Capital LLC, 3,375 %, 02/02/34 EMTN	EUR	320 000	312 651	0,22
Booking Holdings Inc, 4,250 %, 15/05/29	EUR	285 000	294 376	0,21
Caterpillar Financial Services Corp, 3,742 %, 04/09/26 EMTN	EUR	365 000	367 797	0,26
Chubb INA Holdings LLC, 0,300 %, 15/12/24	EUR	260 000	255 833	0,18
Chubb INA Holdings LLC, 1,400 %, 15/06/31	EUR	335 000	291 105	0,20
Citigroup Inc, 0,500 %, 08/10/27 EMTN (i)	EUR	710 000	662 166	0,46
Coca-Cola Co, 0,400 %, 06/05/30	EUR	330 000	280 748	0,20
Corning Inc, 3,875 %, 15/05/26	EUR	365 000	365 360	0,26
Corning Inc, 4,125 %, 15/05/31	EUR	125 000	126 900	0,09
Dover Corp, 0,750 %, 04/11/27	EUR	720 000	658 361	0,46
Duke Energy Corp, 3,750 %, 01/04/31	EUR	400 000	394 293	0,28
Eli Lilly & Co, 1,375 %, 14/09/61	EUR	165 000	88 864	0,06
Eli Lilly & Co, 2,125 %, 03/06/30	EUR	750 000	704 685	0,49
Ford Motor Credit Co LLC, 3,250 %, 15/09/25 EMTN	EUR	285 000	282 526	0,20
General Electric Co, 4,125 %, 19/09/35 EMTN	EUR	625 000	635 100	0,44
General Motors Financial Co Inc., 3,900 %, 12/01/28 EMTN	EUR	145 000	145 469	0,10
Global Payments Inc, 4,875 %, 17/03/31	EUR	270 000	278 687	0,19
Goldman Sachs Group Inc, 1,625 %, 27/07/26 EMTN	EUR	700 000	673 890	0,47
International Business Machines Corp, 3,625 %, 06/02/31	EUR	765 000	770 643	0,54
Johnson & Johnson, 3,550 %, 06/01/44	EUR	245 000	242 307	0,17
JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, 24/02/28 EMTN (i)	EUR	675 000	620 969	0,43
JPMorgan Chase & Co, 1,001 %, 25/07/31 EMTN (i)	EUR	900 000	771 177	0,54
JPMorgan Chase & Co, 3,761 %, 21/03/34 EMTN (i)	EUR	295 000	293 017	0,21
Mastercard Inc, 2,100 %, 01/12/27	EUR	520 000	501 184	0,35
McDonald's Corp, 1,600 %, 15/03/31	EUR	900 000	796 873	0,56
Merck & Co Inc, 0,500 %, 02/11/24	EUR	210 000	207 667	0,15
Morgan Stanley, 2,950 %, 07/05/32 EMTN (i)	EUR	150 000	141 744	0,10
Morgan Stanley, 3,790 %, 21/03/30 (i)	EUR	350 000	350 217	0,24
Morgan Stanley, 4,656 %, 02/03/29 (i)	EUR	410 000	422 747	0,30
Nasdaq Inc, 0,900 %, 30/07/33	EUR	200 000	156 307	0,11
National Grid North America Inc, 4,668 %, 12/09/33 EMTN	EUR	275 000	285 355	0,20

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
États-Unis – 16,50 % (31 décembre 2023 : 16,38 %) (suite)				
Netflix Inc, 4,625 %, 15/05/29	EUR	305 000	318 880	0,22
PepsiCo Inc, 1,125 %, 18/03/31	EUR	400 000	349 137	0,24
PPG Industries Inc, 2,750 %, 01/06/29	EUR	405 000	390 193	0,27
Prologis Euro Finance LLC, 0,500 %, 16/02/32	EUR	350 000	271 911	0,19
Prologis Euro Finance LLC, 0,625 %, 10/09/31	EUR	715 000	572 965	0,40
Prologis Euro Finance LLC 1,000 %, 08/02/29 EMTN	EUR	215 000	190 117	0,13
PVH Corp, 4,125 %, 16/07/29	EUR	265 000	264 029	0,18
Stryker Corp, 0,750 %, 01/03/29	EUR	335 000	295 919	0,21
Thermo Fisher Scientific Inc, 0,875 %, 01/10/31	EUR	360 000	302 508	0,21
Thermo Fisher Scientific Inc, 3,650 %, 21/11/34	EUR	400 000	401 855	0,28
Toyota Motor Credit Corp, 4,050 %, 13/09/29 EMTN	EUR	360 000	369 400	0,26
Unilever Capital Corp, 3,300 %, 06/06/29 EMTN	EUR	155 000	155 675	0,11
Unilever Capital Corp, 3,400 %, 06/06/33 EMTN	EUR	330 000	329 574	0,23
US Bancorp, 4,009 %, 21/05/32 (i)	EUR	700 000	699 223	0,49
Verizon Communications Inc, 4,250 %, 31/10/30	EUR	1 245 000	1 289 398	0,90
Warnermedia Holdings Inc, 4,693 %, 17/05/33	EUR	412 000	409 312	0,29
Wells Fargo & Co, 0,625 %, 25/03/30 EMTN	EUR	200 000	168 454	0,12
Wells Fargo & Co, 1,375 %, 26/10/26 EMTN	EUR	515 000	488 768	0,34
			23 601 093	16,50
TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES			**138 283 052**	**96,69**
TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES OBLIGATIONS À MOYEN TERME			**138 283 052**	**96,69**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (Coût : 138 010 866 EUR)			**138 283 052**	**96,69**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS - (0,01 %) (31 décembre 2023 : 0,04 %)

Contrats à terme normalisés - (0,01) % (31 décembre 2023 : 0,05 %)

Nombre de contrats	Libellé	Contrepartie	Engagement	Plus-value/ (Moins-value) latente	% de l'actif net
(148)	Euro-Bobl September 2024 Futures	JP Morgan	17 068 840	(164 280)	(0,11 %)
65	Euro-Bund September 2024 Futures	JP Morgan	8 431 150	124 150	0,09 %
64	Euro-Schatz September 2024 Futures	JP Morgan	6 744 920	19 880	0,01 %
Plus-value latente sur les contrats à terme normalisés				144 030	0,10 %
Moins-value latente sur les contrats à terme normalisés				(164 280)	(0,11 %)
Moins-value nette latente sur les contrats à terme normalisés				**(20 250)**	**(0,01 %)**

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND (suite)

Calendrier des investissements	**Au 30 juin 2024**

	Juste valeur EUR	**% de l'actif net**
Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**138 427 082**	**96,79**
Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**(164 280)**	**(0,11)**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS	**138 262 802**	**96,68**
Avoirs nets en banque	4 894 534	3,42
Autres actifs	2 950 165	2,06
Moins autres passifs	(3 095 586)	(2,16)
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES	**143 011 915**	**100,00**

LES DIX PREMIÈRES PARTICIPATIONS SECTORIELLES AU 30 JUIN 2024 EN POURCENTAGE DE L'ACTIF NET

Activités bancaires	32,07 %
Électricité	8,31 %
Télécommunications	5,23 %
Automobile	5,17 %
Produits pharmaceutiques	3,93 %
Pétrole et gaz	3,68 %
Santé	3,06 %
Boissons	2,91 %
REIT	2,69 %
Immobilier	2,44 %

(i) Indique un titre à taux variable. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2024.
(ii) Titres émis par des émetteurs non américains ou non canadiens.
(iii) Obligations perpétuelles.

Abréviations

EUR : Euro

Analyse de l'actif total	**% de l'actif total**
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle	94,47
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	0,17
Instruments financiers dérivés	(0,01)
Actif circulant	5,37
	100,00

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME – 97,17 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 98,10 %)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES - 97,17 % DE L'ACTIF NET (31 décembre 2023 : 98,10 %)				
Australie - 0,60 % (31 décembre 2023 : 0,67 %)				
Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 0,669 %, 05/05/31 EMTN (i) (ii)	EUR	1 900 000	1 772 917	0,21
National Australia Bank Ltd, 1,375 %, 30/08/28 EMTN (ii)	EUR	3 680 000	3 396 687	0,39
			5 169 604	0,60
Autriche - 0,94 % (31 décembre 2023 : 1,21 %)				
Erste Group Bank AG, 1,625 %, 08/09/31 EMTN (i) (ii)	EUR	2 200 000	2 077 574	0,24
Erste Group Bank AG, 4,250 %, 30/05/30 EMTN (i) (ii)	EUR	4 200 000	4 312 194	0,50
Raiffeisen Bank International AG, 0,050 %, 01/09/27 EMTN (ii)	EUR	2 000 000	1 772 070	0,20
			8 161 838	0,94
Belgique - 2,67 % (31 décembre 2023 : 3,26 %)				
Ageas SA, 3,250 %, 02/07/49 (i) (ii)	EUR	1 300 000	1 222 921	0,14
Belfius Bank SA, 4,125 %, 12/09/29 EMTN (ii)	EUR	1 400 000	1 431 763	0,16
Elia Transmission Belgium SA, 0,875 %, 28/04/30 EMTN (ii)	EUR	4 600 000	3 947 830	0,46
Elia Transmission Belgium SA, 1,375 %, 14/01/26 EMTN (ii)	EUR	700 000	677 137	0,08
Euroclear Bank SA, 3,625 %, 13/10/27 EMTN (ii)	EUR	2 000 000	2 014 296	0,23
FLUVIUS System Operator CV, 3,875 %, 18/03/31 EMTN (ii)	EUR	2 400 000	2 427 203	0,28
KBC Group NV, 0,500 %, 03/12/29 EMTN (i) (ii)	EUR	2 000 000	1 965 000	0,23
KBC Group NV, 0,625 %, 07/12/31 EMTN (i) (ii)	EUR	400 000	368 380	0,04
KBC Group NV, 0,750 %, 21/01/28 EMTN (i) (ii)	EUR	2 700 000	2 504 588	0,29
KBC Group NV, 3,000 %, 25/08/30 EMTN (ii)	EUR	2 100 000	2 011 714	0,23
KBC Group NV, 4,750 %, 17/04/35 EMTN (i) (ii)	EUR	1 000 000	1 008 218	0,12
Lonza Finance International NV, 1,625 %, 21/04/27 (ii)	EUR	1 420 000	1 350 661	0,16
Lonza Finance International NV, 3,875 %, 25/05/33 (ii)	EUR	2 200 000	2 203 961	0,25
			23 133 672	2,67
Danemark - 1,31 % (31 décembre 2023 : 0,72 %)				
Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 3,250 %, 21/01/31 EMTN (ii)	EUR	3 496 000	3 486 916	0,40
Nykredit Realkredit AS, 1,375 %, 12/07/27 EMTN (ii)	EUR	1 755 000	1 647 563	0,19
Nykredit Realkredit AS, 3,875 %, 05/07/27 EMTN (ii)	EUR	2 300 000	2 308 151	0,27
Pandora A/S, 3,875 %, 31/05/30 EMTN (ii)	EUR	2 115 000	2 107 724	0,24
Vestas Wind Systems, 4,125 %, 15/06/31 EMTN (ii)	EUR	1 785 000	1 809 178	0,21
			11 359 532	1,31
Finlande - 0,91 % (31 décembre 2023 : 1,80 %)				
Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 2,000 %, 24/03/25 EMTN (ii)	EUR	1 400 000	1 373 920	0,16
Nordea Bank Abp, 0,625 %, 18/08/31 EMTN (i) (ii)	EUR	3 085 000	2 884 089	0,33
Nordea Bank Abp, 1,125 %, 16/02/27 EMTN (ii)	EUR	3 200 000	3 009 318	0,35
Sampo OYJ, 3,375 %, 23/05/49 (i) (ii)	EUR	600 000	569 656	0,07
			7 836 983	0,91
France - 18,52 % (31 décembre 2023 : 18,77 %)				
Aéroports de Paris SA, 2,125 %, 02/10/26 (ii)	EUR	3 400 000	3 306 259	0,38
APRR SA, 1,500 %, 25/01/30 EMTN (ii)	EUR	1 900 000	1 710 570	0,20
APRR SA, 3,125 %, 24/01/30 EMTN (ii)	EUR	3 700 000	3 614 579	0,42
AXA SA, 1,875 %, 10/07/42 EMTN (i) (ii)	EUR	2 395 000	1 980 599	0,23
AXA SA, 3,941 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	1 400 000	1 392 370	0,16
Ayvens SA, 4,375 %, 23/11/26 (ii)	EUR	2 500 000	2 530 695	0,29
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,250 %, 29/06/28 EMTN (ii)	EUR	6 100 000	5 352 360	0,62
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,250 %, 19/07/28 (ii)	EUR	4 200 000	3 641 549	0,42

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
France - 18,52 % (31 décembre 2023 : 18,77 %) (suite)				
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,625 %, 21/02/31 EMTN (ii)	EUR	3 800 000	3 076 974	0,36
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 1,125 %, 19/11/31 EMTN (ii)	EUR	2 000 000	1 597 512	0,18
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 3,500 %, 15/05/31 EMTN (ii)	EUR	2 300 000	2 272 756	0,26
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 4,000 %, 21/11/29 EMTN (ii)	EUR	1 500 000	1 522 460	0,18
Banque Stellantis France SACA, 3,500 %, 19/07/27 EMTN (ii)	EUR	2 300 000	2 289 570	0,26
BNP Paribas SA, 0,500 %, 19/02/28 EMTN (i) (ii)	EUR	3 900 000	3 577 501	0,41
BNP Paribas SA, 0,875 %, 11/07/30 EMTN (i) (ii)	EUR	3 200 000	2 752 272	0,32
BNP Paribas SA, 2,750 %, 25/07/28 EMTN (i) (ii)	EUR	2 300 000	2 228 872	0,26
BNP Paribas SA, 3,875 %, 23/02/29 EMTN (i) (ii)	EUR	4 300 000	4 328 741	0,50
BNP Paribas SA, 4,125 %, 26/09/32 EMTN (i) (ii)	EUR	2 400 000	2 458 224	0,28
Bouygues SA, 3,875 %, 17/07/31 (ii)	EUR	6 000 000	6 094 740	0,70
CNP Assurances SACA, 1,250 %, 27/01/29 (ii)	EUR	500 000	441 831	0,05
CNP Assurances SACA, 5,250 %, 18/07/53 EMTN (i) (ii)	EUR	800 000	819 315	0,09
Coentreprise de Transport d'Électricité SA, 0,875 %, 29/09/24 (ii)	EUR	2 300 000	2 283 164	0,26
Coentreprise de Transport d'Électricité SA, 1,500 %, 29/07/28 (ii)	EUR	2 700 000	2 485 039	0,29
Coentreprise de Transport d'Électricité SA, 2,125 %, 29/07/32 (ii)	EUR	2 200 000	1 946 019	0,22
Covivio Hotels SACA, 1,000 %, 27/07/29 (ii)	EUR	2 900 000	2 498 240	0,29
Covivio SA, 4,625 %, 05/06/32 EMTN (ii)	EUR	2 300 000	2 328 915	0,27
Crédit Agricole Assurances SA, 2,000 %, 17/07/30 (ii)	EUR	1 800 000	1 561 415	0,18
Crédit Agricole SA, 0,625 %, 12/01/28 (i) (ii)	EUR	5 600 000	5 173 811	0,60
Crédit Agricole SA, 0,875 %, 14/01/32 EMTN (ii)	EUR	2 000 000	1 611 547	0,19
Crédit Agricole SA, 1,000 %, 03/07/29 EMTN (ii)	EUR	4 000 000	3 540 696	0,41
Crédit Agricole SA, 3,750 %, 22/01/34 EMTN (ii)	EUR	3 100 000	3 093 376	0,36
Crédit Agricole SA, 4,250 %, 11/07/29 (i) (ii)	EUR	3 800 000	3 850 567	0,44
Danone SA, 3,470 %, 22/05/31 EMTN (ii)	EUR	4 100 000	4 094 428	0,47
Électricité de France SA, 2,000 %, 09/12/49 EMTN (ii)	EUR	2 000 000	1 238 004	0,14
Électricité de France SA, 4,125 %, 17/06/31 EMTN (ii)	EUR	1 800 000	1 813 756	0,21
Électricité de France SA, 4,375 %, 12/10/29 EMTN (ii)	EUR	2 300 000	2 358 346	0,27
Engie SA, 3,625 %, 11/01/30 EMTN (ii)	EUR	3 700 000	3 694 269	0,43
Engie SA, 3,875 %, 06/01/31 EMTN (ii)	EUR	2 800 000	2 817 491	0,33
Engie SA, 4,250 %, 11/01/43 EMTN (ii)	EUR	800 000	783 325	0,09
Firmenich Productions Participations SAS, 1,750 %, 30/04/30 (ii)	EUR	1 755 000	1 595 313	0,18
Gecina SA, 1,625 %, 14/03/30 EMTN (ii)	EUR	2 200 000	1 957 481	0,23
Groupe des Assurances du Crédit Mutuel SADIR, 1,850 %, 21/04/42 (i) (ii)	EUR	600 000	484 589	0,06
Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,625 %, 18/09/29 EMTN (ii)	EUR	1 200 000	1 066 824	0,12
Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement, 0,625 %, 16/09/28 (ii)	EUR	2 090 000	1 774 652	0,21
HSBC Continental Europe SA, 1,375 %, 04/09/28 EMTN (ii)	EUR	3 500 000	3 225 981	0,37
Klepierre SA, 0,625 %, 01/07/30 EMTN (ii)	EUR	2 300 000	1 902 643	0,22
La Poste SA, 3,125 %, 14/03/33 EMTN (ii)	EUR	1 600 000	1 538 469	0,18
La Poste SA, 3,750 %, 12/06/30 EMTN (ii)	EUR	1 500 000	1 510 871	0,17
La Poste SA, Zero Coupon Bond, 18/07/29 EMTN (ii)	EUR	800 000	669 612	0,08
L'Oréal SA, 3,375 %, 23/11/29 EMTN (ii)	EUR	2 000 000	2 020 980	0,23
Orange SA, 1,375 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	2 900 000	2 497 625	0,29

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
France - 18,52 % (31 décembre 2023 : 18,77 %) (suite)				
Orange SA, Zero Coupon Bond, 04/09/26 EMTN (ii)	EUR	3 600 000	3 342 997	0,39
Praemia Healthcare SACA, 0,875 %, 04/11/29 (ii)	EUR	1 300 000	1 085 753	0,13
Praemia Healthcare SACA, 5,500 %, 19/09/28 (ii)	EUR	1 100 000	1 138 624	0,13
RCI Banque SA, 4,500 %, 06/04/27 EMTN (ii)	EUR	2 130 000	2 165 956	0,25
RCI Banque SA, 4,625 %, 13/07/26 EMTN (ii)	EUR	1 800 000	1 823 000	0,21
RCI Banque SA, 4,625 %, 02/10/26 EMTN (ii)	EUR	1 705 000	1 730 945	0,20
RTE Réseau de Transport d'Électricité SADIR, 1,625 %, 27/11/25 EMTN (ii)	EUR	1 200 000	1 168 182	0,14
RTE Réseau de Transport d'Électricité SADIR, 3,750 %, 04/07/35 EMTN (ii)	EUR	4 400 000	4 382 202	0,51
Sanofi SA, 1,250 %, 06/04/29 (ii)	EUR	2 000 000	1 827 153	0,21
Schneider Electric SE, 3,250 %, 10/10/35 EMTN (ii)	EUR	2 100 000	2 030 551	0,23
Société Générale SA, 0,250 %, 08/07/27 EMTN (ii)	EUR	3 300 000	2 980 358	0,34
Société Générale SA, 0,625 %, 02/12/27 (i) (ii)	EUR	4 800 000	4 428 192	0,51
Société Générale SA, 5,625 %, 02/06/33 EMTN (ii)	EUR	1 300 000	1 353 464	0,16
Sogecap SA, 6,500 %, 16/05/44 (i) (ii)	EUR	700 000	747 089	0,09
Suez SACA, 2,375 %, 24/05/30 EMTN (ii)	EUR	2 200 000	2 025 833	0,23
Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1,875 %, 15/01/31 EMTN (ii)	EUR	1 100 000	967 996	0,11
Unibail-Rodamco-Westfield SE, 4,125 %, 11/12/30 EMTN (ii)	EUR	2 800 000	2 808 408	0,32
			160 413 900	18,52
Allemagne - 9,39 % (31 décembre 2023 : 9,85 %)				
Allianz SE, 4,597 %, 07/09/38 EMTN (i) (ii)	EUR	2 300 000	2 329 060	0,27
Allianz SE, 4,851 %, 26/07/54 (i) (ii)	EUR	700 000	718 795	0,08
Allianz SE, 5,824 %, 25/07/53 (i) (ii)	EUR	1 900 000	2 080 693	0,24
Amprion GmbH, 0,625 %, 23/09/33 EMTN (ii)	EUR	1 300 000	987 249	0,11
Amprion GmbH, 3,971 %, 22/09/32 (ii)	EUR	500 000	506 891	0,06
Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,500 %, 29/05/29 (ii)	EUR	1 300 000	1 294 641	0,15
Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,500 %, 23/04/75 EMTN (i) (ii)	EUR	2 200 000	2 136 750	0,25
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,500 %, 04/07/44 (ii)	EUR	1 315 000	1 274 307	0,15
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,000 %, 04/01/37 (ii)	EUR	9 535 000	10 942 593	1,26
Commerzbank AG, 3,000 %, 14/09/27 (i) (ii)	EUR	2 700 000	2 647 123	0,31
Commerzbank AG, 4,875 %, 16/10/34 EMTN (i) (ii)	EUR	1 300 000	1 295 736	0,15
Commerzbank AG, 5,250 %, 25/03/29 (i) (ii)	EUR	2 600 000	2 706 267	0,31
Deutsche Bahn Finance GmbH, 1,375 %, 03/03/34 EMTN (ii)	EUR	5 300 000	4 438 294	0,51
Deutsche Bahn Finance GmbH, 1,600 % (i) (ii) (iii)	EUR	3 400 000	2 946 110	0,34
Deutsche Bahn Finance GmbH, 4,000 %, 23/11/43 EMTN (ii)	EUR	975 000	1 001 606	0,12
Deutsche Bank AG, 1,375 %, 03/09/26 EMTN (i) (ii)	EUR	1 300 000	1 261 902	0,15
Deutsche Bank AG, 1,750 %, 19/11/30 EMTN (i) (ii)	EUR	2 400 000	2 109 384	0,24
Deutsche Boerse AG, 3,750 %, 28/09/29 (ii)	EUR	6 400 000	6 516 005	0,75
Eurogrid GmbH, 3,722 %, 27/04/30 EMTN (ii)	EUR	1 300 000	1 296 168	0,15
Eurogrid GmbH, 3,915 %, 01/02/34 EMTN (ii)	EUR	1 400 000	1 395 072	0,16
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide, 4,250 %, 11/06/32 (ii)	EUR	2 116 000	2 133 779	0,25
Hannover Rueck SE, 3,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	700 000	689 500	0,08
HOCHTIEF AG, 4,250 %, 31/05/30 EMTN (ii)	EUR	3 660 000	3 685 693	0,43
HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, 1,125 %, 01/11/33 EMTN (ii)	EUR	2 700 000	2 136 073	0,25

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Allemagne - 9,39 % (31 décembre 2023 : 9,85 %) (suite)				
HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, Zero Coupon Bond, 01/11/24 EMTN (ii)	EUR	2 400 000	2 366 424	0,27
Infineon Technologies AG, 1,625 %, 24/06/29 EMTN (ii)	EUR	2 900 000	2 664 044	0,31
Knorr-Bremse AG, 3,250 %, 21/09/27 EMTN (ii)	EUR	3 400 000	3 376 931	0,39
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,125 %, 09/01/32 EMTN (ii)	EUR	1 195 000	975 009	0,11
Merck Financial Services GmbH, 0,500 %, 16/07/28 EMTN (ii)	EUR	2 900 000	2 595 564	0,30
Merck KGaA, 1,625 %, 09/09/80 (i) (ii)	EUR	1 300 000	1 226 849	0,14
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, 26/05/49 (i) (ii)	EUR	900 000	867 129	0,10
Robert Bosch GmbH, 4,375 %, 02/06/43 EMTN (ii)	EUR	2 500 000	2 546 872	0,29
Schaeffler AG, 4,500 %, 28/03/30 EMTN (ii)	EUR	1 600 000	1 580 194	0,18
Talanx AG, 4,000 %, 25/10/29 EMTN (ii)	EUR	1 500 000	1 533 107	0,18
Vonovia SE, 1,000 %, 16/06/33 (ii)	EUR	600 000	455 781	0,05
Vonovia SE, 2,125 %, 22/03/30 EMTN (ii)	EUR	2 900 000	2 615 516	0,30
			81 333 111	9,39
Irlande - 1,94 % (31 décembre 2023 : 2,23 %)				
AIB Group PLC, 5,250 %, 23/10/31 EMTN (i) (ii)	EUR	2 395 000	2 559 261	0,30
Bank of Ireland Group PLC, 0,375 %, 10/05/27 EMTN (i) (ii)	EUR	2 030 000	1 909 406	0,22
Bank of Ireland Group PLC, 4,750 %, 10/08/34 EMTN (i) (ii)	EUR	1 750 000	1 748 915	0,20
CCEP Finance Ireland DAC, Zero Coupon Bond, 06/09/25 (ii)	EUR	1 200 000	1 149 362	0,13
James Hardie International Finance DAC, 3,625 %, 01/10/26 (ii)	EUR	1 750 000	1 723 750	0,20
Linde PLC, 1,625 %, 31/03/35 (ii)	EUR	3 000 000	2 479 152	0,29
Linde PLC, 3,625 %, 12/06/34 (ii)	EUR	1 500 000	1 506 332	0,17
Lunar Funding V for Swisscom AG, 1,125 %, 12/10/26 (ii)	EUR	860 000	817 344	0,09
Permanent TSB Group Holdings PLC, 6,625 %, 25/04/28 (i) (ii)	EUR	2 755 000	2 902 558	0,34
			16 796 080	1,94
Italie – 2,09 % (31 décembre 2023 : 2,27 %)				
A2A SpA, 0,625 %, 15/07/31 EMTN (ii)	EUR	1 610 000	1 286 583	0,15
Intesa Sanpaolo SpA, 1,000 %, 19/11/26 EMTN (ii)	EUR	2 000 000	1 878 652	0,21
Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, 04/07/29 EMTN (ii)	EUR	2 850 000	2 600 034	0,30
Intesa Sanpaolo SpA, 4,000 %, 19/05/26 EMTN (ii)	EUR	2 300 000	2 312 891	0,27
Snam SpA, 0,875 %, 25/10/26 EMTN (ii)	EUR	2 830 000	2 660 279	0,31
Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0,375 %, 25/09/30 EMTN (ii)	EUR	2 180 000	1 784 568	0,20
Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3,500 %, 17/01/31 EMTN (ii)	EUR	2 550 000	2 507 043	0,29
UniCredit SpA, 0,850 %, 19/01/31 EMTN (ii)	EUR	3 760 000	3 111 453	0,36
			18 141 503	2,09
Japon - 0,43 % (31 décembre 2023 : 0,42 %)				
Takeda Pharmaceutical Co Ltd., 3,000 %, 21/11/30 (ii)	EUR	3 860 000	3 717 299	0,43
			3 717 299	0,43
Jersey, Îles Anglo-Normandes - 0,19 % (31 décembre 2023 : 0,38 %)				
Heathrow Funding Ltd, 1,875 %, 14/03/34 EMTN (ii)	EUR	1 970 000	1 633 475	0,19
			1 633 475	0,19
Liechtenstein - 0,32 % (31 décembre 2023 : 0,38 %)				
Swiss Life Finance I AG, 0,500 %, 15/09/31 (ii)	EUR	3 450 000	2 773 530	0,32
			2 773 530	0,32
Luxembourg - 2,85 % (31 décembre 2023 : 4,32 %)				
Aroundtown Finance Sarl, 5,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	700 000	402 500	0,05
Aroundtown Finance Sarl, 7,125 % (i) (ii) (iii)	EUR	590 000	441 320	0,05
Aroundtown SA, 0,375 %, 15/04/27 EMTN (ii)	EUR	2 200 000	1 907 072	0,22

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Luxembourg - 2,85 % (31 décembre 2023 : 4,32 %) (suite)				
DH Europe Finance II Sarl, 0,450 %, 18/03/28 (ii)	EUR	2 000 000	1 799 380	0,21
Euroclear Investments SA, 1,125 %, 07/12/26 (ii)	EUR	1 300 000	1 234 583	0,14
Highland Holdings Sarl, 0,318 %, 15/12/26 (ii)	EUR	1 480 000	1 367 572	0,16
John Deere Bank SA, 3,300 %, 15/10/29 EMTN (ii)	EUR	2 490 000	2 479 657	0,29
Medtronic Global Holdings SCA, 0,375 %, 15/10/28 (ii)	EUR	2 500 000	2 203 675	0,25
Medtronic Global Holdings SCA, 1,000 %, 02/07/31 (ii)	EUR	2 555 000	2 175 041	0,25
Medtronic Global Holdings SCA, 1,500 %, 02/07/39 (ii)	EUR	2 860 000	2 091 122	0,24
Medtronic Global Holdings SCA, 1,625 %, 07/03/31 (ii)	EUR	1 500 000	1 339 474	0,15
Nestlé Finance International Ltd, 3,250 %, 23/01/37 EMTN (ii)	EUR	3 445 000	3 339 483	0,39
Novartis Finance SA, Zero Coupon Bond, 23/09/28 (ii)	EUR	2 345 000	2 055 158	0,24
Prologis International Funding II SA, 3,625 %, 07/03/30 EMTN (ii)	EUR	1 900 000	1 861 428	0,21
			24 697 465	2,85
Pays-Bas – 17,22 % (31 décembre 2023 : 13,99 %)				
ABN AMRO Bank NV, 0,500 %, 23/09/29 EMTN (ii)	EUR	2 100 000	1 783 960	0,21
ABN AMRO Bank NV, 4,375 %, 20/10/28 (ii)	EUR	1 200 000	1 230 032	0,14
Achmea BV, 5,625 %, 11/02/44 EMTN (i) (ii)	EUR	725 000	727 865	0,08
Alliander NV, 3,250 %, 13/06/28 EMTN (ii)	EUR	4 050 000	4 043 617	0,47
Allianz Finance II BV, 3,250 %, 12/04/29 EMTN (ii)	EUR	1 800 000	1 797 314	0,21
American Medical Systems Europe BV, 0,750 %, 08/03/25 (ii)	EUR	2 300 000	2 252 675	0,26
American Medical Systems Europe BV, 3,500 %, 08/03/32 (ii)	EUR	3 100 000	3 054 402	0,35
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 1,125 %, 17/09/25 (ii)	EUR	1 400 000	1 357 629	0,16
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 2,000 %, 17/09/30 (ii)	EUR	2 200 000	2 018 566	0,23
ASML Holding NV, 0,250 %, 25/02/30 (ii)	EUR	1 790 000	1 519 567	0,18
ASR Nederland NV, 3,375 %, 02/05/49 (i) (ii)	EUR	700 000	657 295	0,08
BMW Finance NV, 3,875 %, 04/10/28 EMTN (ii)	EUR	1 640 000	1 673 836	0,19
BNI Finance BV, 3,875 %, 01/12/30 (ii)	EUR	4 620 000	4 678 970	0,54
Coca-Cola HBC Finance BV, 0,625 %, 21/11/29 (ii)	EUR	2 215 000	1 906 816	0,22
Compass Group Finance Netherlands BV, 3,000 %, 08/03/30 EMTN (ii)	EUR	4 380 000	4 280 276	0,49
Cooperatieve Rabobank UA, 4,233 %, 25/04/29 EMTN (i) (ii)	EUR	3 000 000	3 062 085	0,35
Daimler Truck International Finance BV, 1,625 %, 06/04/27 EMTN (ii)	EUR	2 900 000	2 763 074	0,32
Daimler Truck International Finance BV, 3,875 %, 19/06/26 EMTN (ii)	EUR	700 000	704 385	0,08
Danfoss Finance II BV, 0,750 %, 28/04/31 EMTN (ii)	EUR	2 180 000	1 778 479	0,21
de Volksbank NV, 1,750 %, 22/10/30 EMTN (i) (ii)	EUR	1 300 000	1 252 555	0,14
de Volksbank NV, 2,375 %, 04/05/27 (i) (ii)	EUR	2 300 000	2 235 760	0,26
DSM BV, 3,625 %, 02/07/34 EMTN (ii)	EUR	1 850 000	1 833 084	0,21
DSV Finance BV, 0,750 %, 05/07/33 EMTN (ii)	EUR	2 650 000	2 054 646	0,24
ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 % (i) (ii) (iii)	EUR	2 925 000	2 887 004	0,33
ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG, 3,375 %, 29/09/47 (i) (ii)	EUR	1 465 000	1 412 629	0,16
Essity Capital BV, 3,000 %, 21/09/26 EMTN (ii)	EUR	1 990 000	1 975 316	0,23
Euronext NV, 1,125 %, 12/06/29 (ii)	EUR	3 930 000	3 526 334	0,41
Haleon Netherlands Capital BV, 1,750 %, 29/03/30 EMTN (ii)	EUR	1 940 000	1 758 455	0,20
Iberdrola International BV, 1,450 % (i) (ii) (iii)	EUR	1 900 000	1 767 665	0,20

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Pays-Bas – 17,22 % (31 décembre 2023 : 13,99 %) (suite)				
Iberdrola International BV, 1,874 % (i) (ii) (iii)	EUR	3 200 000	3 067 645	0,35
ING Groep NV, 0,250 %, 18/02/29 (i) (ii)	EUR	7 100 000	6 252 150	0,72
ING Groep NV, 0,375 %, 29/09/28 (i) (ii)	EUR	2 400 000	2 158 322	0,25
ING Groep NV, 2,000 %, 22/03/30 (i) (ii)	EUR	3 900 000	3 823 084	0,44
ING Groep NV, 4,875 %, 14/11/27 EMTN (i) (ii)	EUR	2 900 000	2 970 557	0,34
JAB Holdings BV, 4,375 %, 25/04/34 (ii)	EUR	1 400 000	1 405 441	0,16
Koninklijke Ahold Delhaize NV, 3,875 %, 11/03/36 (ii)	EUR	1 850 000	1 845 057	0,21
Koninklijke KPN NV, 1,125 %, 11/09/28 (ii)	EUR	1 400 000	1 280 640	0,15
LKQ Dutch Bond BV, 4,125 %, 13/03/31 (ii)	EUR	2 400 000	2 396 016	0,28
Lseg Netherlands BV, 4,125 %, 29/09/26 EMTN (ii)	EUR	4 630 000	4 684 671	0,54
MSD Netherlands Capital BV, 3,500 %, 30/05/37 (ii)	EUR	1 737 000	1 711 171	0,20
Nederlandse Gasunie NV, 0,375 %, 03/10/31 EMTN (ii)	EUR	620 000	500 482	0,06
Nederlandse Gasunie NV, 3,375 %, 11/07/34 EMTN (ii)	EUR	2 480 000	2 441 704	0,28
PACCAR Financial Europe BV, Zero Coupon Bond, 01/03/26 EMTN (ii)	EUR	2 350 000	2 218 000	0,26
Pluxee NV, 3,750 %, 04/09/32 (ii)	EUR	1 300 000	1 277 744	0,15
Prosus NV, 2,085 %, 19/01/30 (ii)	EUR	1 480 000	1 299 499	0,15
Randstad NV, 3,610 %, 12/03/29 EMTN (ii)	EUR	3 110 000	3 086 233	0,36
Roche Finance Europe BV, 3,204 %, 27/08/29 (ii)	EUR	2 400 000	2 403 000	0,28
Roche Finance Europe BV, 3,586 %, 04/12/36 (ii)	EUR	2 450 000	2 468 547	0,28
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2,750 %, 09/09/30 EMTN (ii)	EUR	3 000 000	2 923 095	0,34
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,000 %, 09/08/33 EMTN (ii)	EUR	1 300 000	1 258 371	0,15
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,625 %, 22/02/44 (ii)	EUR	1 900 000	1 838 666	0,21
Sika Capital BV, 3,750 %, 03/11/26 (ii)	EUR	1 995 000	2 003 926	0,23
Sika Capital BV, 3,750 %, 03/05/30 (ii)	EUR	2 535 000	2 558 666	0,30
Stedin Holding NV, 0,875 %, 24/10/25 EMTN (ii)	EUR	3 995 000	3 855 091	0,44
Stedin Holding NV, 2,375 %, 03/06/30 EMTN (ii)	EUR	2 955 000	2 772 718	0,32
Stellantis NV, 3,500 %, 19/09/30 EMTN (ii)	EUR	2 510 000	2 459 307	0,28
Swisscom Finance BV, 3,625 %, 29/11/36 EMTN (ii)	EUR	1 880 000	1 864 349	0,22
Telefonica Europe BV, 3,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	2 400 000	2 368 171	0,27
TenneT Holding BV, 1,375 %, 26/06/29 EMTN (ii)	EUR	2 295 000	2 091 856	0,24
TenneT Holding BV, 1,500 %, 03/06/39 EMTN (ii)	EUR	1 035 000	792 422	0,09
TenneT Holding BV, 4,500 %, 28/10/34 EMTN (ii)	EUR	1 935 000	2 061 899	0,24
TenneT Holding BV, 4,750 %, 28/10/42 EMTN (ii)	EUR	1 400 000	1 521 722	0,18
Unilever Finance Netherlands BV, 3,500 %, 15/02/37 EMTN (ii)	EUR	1 461 000	1 454 723	0,17
Vesteda Finance BV, 0,750 %, 18/10/31 EMTN (ii)	EUR	3 200 000	2 575 350	0,30
Vesteda Finance BV, 2,000 %, 10/07/26 EMTN (ii)	EUR	2 455 000	2 370 075	0,27
WPC Eurobond BV, 0,950 %, 01/06/30 (ii)	EUR	2 460 000	2 064 934	0,24
WPC Eurobond BV, 2,250 %, 19/07/24 (ii)	EUR	1 035 000	1 033 710	0,12
			149 153 305	17,22
Nouvelle-Zélande - 0,43 % (31 décembre 2023 : 0,57 %)				
ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0,200 %, 23/09/27 EMTN (ii)	EUR	4 110 000	3 700 015	0,43
			3 700 015	0,43
Norvège - 2,22 % (31 décembre 2023 : 2,39 %)				
DNB Bank ASA, 0,250 %, 23/02/29 EMTN (i) (ii)	EUR	5 775 000	5 103 460	0,59
DNB Bank ASA, 0,375 %, 18/01/28 EMTN (i) (ii)	EUR	2 000 000	1 845 816	0,21
Santander Consumer Bank AS, 0,500 %, 11/08/25 EMTN (ii)	EUR	2 300 000	2 220 921	0,25

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Norvège - 2,22 % (31 décembre 2023 : 2,39 %) (suite)				
Statkraft AS, 1,500 %, 26/03/30 EMTN (ii)	EUR	3 630 000	3 270 064	0,38
Statnett SF, 0,875 %, 08/03/25 EMTN (ii)	EUR	1 845 000	1 809 347	0,21
Statnett SF, 1,250 %, 26/04/30 EMTN (ii)	EUR	2 447 000	2 164 068	0,25
Telenor ASA, 0,750 %, 31/05/26 EMTN (ii)	EUR	2 975 000	2 827 559	0,33
			19 241 235	2,22
Espagne - 4,55 % (31 décembre 2023 : 3,88 %)				
Aena SME SA, 4,250 %, 13/10/30 EMTN (ii)	EUR	2 400 000	2 485 275	0,29
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,125 %, 24/03/27 EMTN (i) (ii)	EUR	2 600 000	2 448 992	0,28
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,375 %, 15/11/26 EMTN (ii)	EUR	3 000 000	2 788 739	0,32
Banco de Sabadell SA, 5,250 %, 02/07/29 EMTN (i) (ii)	EUR	1 700 000	1 764 651	0,20
Banco Santander SA, 3,500 %, 09/01/28 EMTN (i) (ii)	EUR	4 700 000	4 682 149	0,54
Banco Santander SA, 3,875 %, 22/04/29 EMTN (ii)	EUR	2 100 000	2 102 003	0,24
Banco Santander SA, 4,875 %, 18/10/31 EMTN (ii)	EUR	2 300 000	2 429 118	0,28
CaixaBank SA, 0,500 %, 09/02/29 EMTN (i) (ii)	EUR	2 300 000	2 046 069	0,24
CaixaBank SA, 0,750 %, 09/07/26 (ii)	EUR	4 200 000	3 963 897	0,46
CaixaBank SA, 1,250 %, 18/06/31 EMTN (i) (ii)	EUR	2 000 000	1 886 184	0,22
CaixaBank SA, 4,250 %, 06/09/30 EMTN (ii)	EUR	3 000 000	3 100 362	0,36
Cellnex Finance Co SA, 0,750 %, 15/11/26 EMTN (ii)	EUR	900 000	841 553	0,10
Cellnex Telecom SA, 1,750 %, 23/10/30 EMTN (ii)	EUR	4 000 000	3 507 345	0,41
International Consolidated Airlines Group SA, 1,500 %, 04/07/27 (ii)	EUR	1 800 000	1 676 819	0,19
Mapfre SA, 2,875 %, 13/04/30 (ii)	EUR	700 000	648 852	0,07
Telefonica Emisiones SA, 2,318 %, 17/10/28 EMTN (ii)	EUR	3 200 000	3 056 000	0,35
			39 428 008	4,55
Suède - 3,15 % (31 décembre 2023 : 3,82 %)				
Epiroc AB, 3,625 %, 28/02/31 EMTN (ii)	EUR	2 070 000	2 046 253	0,23
Investor AB, 1,500 %, 12/09/30 EMTN (ii)	EUR	2 900 000	2 608 562	0,30
Molnlycke Holding AB, 0,875 %, 05/09/29 EMTN (ii)	EUR	2 500 000	2 157 627	0,25
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,750 %, 09/08/27 EMTN (ii)	EUR	2 175 000	1 996 633	0,23
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3,875 %, 09/05/28 EMTN (ii)	EUR	3 975 000	4 038 226	0,47
Telia Co AB, 3,625 %, 22/02/32 EMTN (ii)	EUR	3 855 000	3 867 128	0,45
Vattenfall AB, 0,125 %, 12/02/29 EMTN (ii)	EUR	1 485 000	1 278 086	0,15
Vattenfall AB, 3,750 %, 18/10/26 EMTN (ii)	EUR	4 105 000	4 125 640	0,48
Volvo Treasury AB, 3,625 %, 25/05/27 EMTN (ii)	EUR	3 015 000	3 025 285	0,35
Volvo Treasury AB, 3,875 %, 29/08/26 EMTN (ii)	EUR	2 100 000	2 114 384	0,24
			27 257 824	3,15
Suisse - 1,63 % (31 décembre 2023 : 2,20 %)				
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 5,230 %, 01/11/27 EMTN (ii)	EUR	1 500 000	1 560 537	0,18
UBS AG, 0,250 %, 01/09/28 EMTN (ii)	EUR	3 050 000	2 669 207	0,31
UBS AG, 0,500 %, 31/03/31 EMTN (ii)	EUR	2 215 000	1 803 260	0,21
UBS Group AG, 0,250 %, 03/11/26 (i) (ii)	EUR	1 375 000	1 308 175	0,15
UBS Group AG, 0,625 %, 18/01/33 EMTN (ii)	EUR	2 420 000	1 845 667	0,21
UBS Group AG, 2,875 %, 02/04/32 (i) (ii)	EUR	1 050 000	981 801	0,12

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
Suisse - 1,63 % (31 décembre 2023 : 2,20 %) (suite)				
UBS Group AG, 7,750 %, 01/03/29 (i) (ii)	EUR	3 465 000	3 914 141	0,45
			14 082 788	1,63
Royaume-Uni - 9,76 % (31 décembre 2023 : 7,64 %)				
AstraZeneca PLC, 3,750 %, 03/03/32 EMTN (ii)	EUR	4 655 000	4 765 026	0,55
Barclays PLC, 0,877 %, 28/01/28 (i) (ii)	EUR	1 950 000	1 813 439	0,21
Barclays PLC, 4,918 %, 08/08/30 EMTN (i) (ii)	EUR	940 000	978 063	0,11
British Telecommunications PLC, 1,500 %, 23/06/27 EMTN (ii)	EUR	2 485 000	2 345 676	0,27
Cadent Finance PLC, 3,750 %, 16/04/33 EMTN (ii)	EUR	2 320 000	2 269 679	0,26
Chanel Ceres PLC, 0,500 %, 31/07/26 (ii)	EUR	2 485 000	2 319 439	0,27
Chanel Ceres PLC, 1,000 %, 31/07/31 (ii)	EUR	3 320 000	2 739 113	0,32
Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1,875 %, 18/03/30 (ii)	EUR	2 420 000	2 213 589	0,26
DS Smith PLC, 4,375 %, 27/07/27 EMTN (ii)	EUR	2 255 000	2 299 838	0,27
GlaxoSmithKline Capital PLC, 1,375 %, 12/09/29 (ii)	EUR	1 400 000	1 266 826	0,15
GlaxoSmithKline Capital PLC, 1,750 %, 21/05/30 EMTN (ii)	EUR	2 400 000	2 188 536	0,25
HSBC Holdings PLC, 0,641 %, 24/09/29 (i) (ii)	EUR	2 085 000	1 831 785	0,21
HSBC Holdings PLC, 4,599 %, 22/03/35 (i) (ii)	EUR	2 450 000	2 455 468	0,28
HSBC Holdings PLC, 4,787 %, 10/03/32 EMTN (i) (ii)	EUR	2 400 000	2 513 743	0,29
International Distribution Services PLC, 5,250 %, 14/09/28 (ii)	EUR	2 220 000	2 278 500	0,26
Lloyds Banking Group PLC, 3,125 %, 24/08/30 EMTN (i) (ii)	EUR	2 600 000	2 509 637	0,29
Motability Operations Group PLC, 4,000 %, 17/01/30 EMTN (ii)	EUR	3 231 000	3 268 977	0,38
National Gas Transmission PLC, 4,250 %, 05/04/30 EMTN (ii)	EUR	2 225 000	2 262 050	0,26
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC, 3,530 %, 20/09/28 EMTN (ii)	EUR	3 550 000	3 530 475	0,41
Nationwide Building Society, 2,000 %, 25/07/29 EMTN (i) (ii)	EUR	2 150 000	2 146 689	0,25
Nationwide Building Society, 4,500 %, 01/11/26 EMTN (ii)	EUR	3 800 000	3 877 839	0,45
NatWest Group PLC, 4,771 %, 16/02/29 EMTN (i) (ii)	EUR	1 800 000	1 853 757	0,21
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 3,875 %, 14/09/33 EMTN (ii)	EUR	3 135 000	3 147 764	0,36
Rentokil Initial PLC, 0,500 %, 14/10/28 EMTN (ii)	EUR	2 860 000	2 519 626	0,29
Severn Trent Utilities Finance PLC, 4,000 %, 05/03/34 EMTN (ii)	EUR	1 400 000	1 371 580	0,16
SSE PLC, 2,875 %, 01/08/29 EMTN (ii)	EUR	2 305 000	2 227 132	0,26
SSE PLC, 4,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	1 750 000	1 710 258	0,20
Standard Chartered PLC, 0,800 %, 17/11/29 (i) (ii)	EUR	4 900 000	4 295 830	0,50
Standard Chartered PLC, 1,200 %, 23/09/31 EMTN (i) (ii)	EUR	3 220 000	2 978 307	0,34
Virgin Money UK PLC, 4,000 %, 18/03/28 EMTN (i) (ii)	EUR	2 965 000	2 969 860	0,34
Vodafone Group PLC, 1,625 %, 24/11/30 EMTN (ii)	EUR	7 810 000	6 959 057	0,80
WPP Finance 2013, 3,625 %, 12/09/29 EMTN (ii)	EUR	2 600 000	2 578 846	0,30
			84 486 404	9,76
États-Unis - 16,05 % (31 décembre 2023 : 16,89 %)				
AbbVie Inc, 2,125 %, 17/11/28	EUR	2 100 000	1 992 244	0,23
Air Lease Corp, 3,700 %, 15/04/30 EMTN	EUR	2 535 000	2 484 047	0,29
American Tower Corp, 0,500 %, 15/01/28	EUR	3 850 000	3 436 079	0,40
American Tower Corp, 0,875 %, 21/05/29	EUR	3 815 000	3 316 036	0,38
AT&T Inc, 1,600 %, 19/05/28	EUR	6 040 000	5 628 193	0,65
AT&T Inc, 4,300 %, 18/11/34	EUR	2 905 000	3 006 681	0,35
Bank of America Corp, 0,583 %, 24/08/28 EMTN (i)	EUR	7 785 000	7 075 202	0,82
Bank of America Corp, 1,102 %, 24/05/32 EMTN (i)	EUR	1 190 000	997 936	0,12
BMW US Capital LLC, 3,000 %, 11/02/27 EMTN	EUR	2 000 000	1 978 328	0,23
Booking Holdings Inc, 4,250 %, 15/05/29	EUR	2 890 000	2 985 074	0,34

Calendrier des investissements **Au 30 juin 2024**

		Valeur Montant	Juste valeur EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS À LONG TERME ET OBLIGATIONS À MOYEN TERME (suite)				
OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES (suite)				
États-Unis – 16,05 % (31 décembre 2023 : 16,89 %) (suite)				
Caterpillar Financial Services Corp, 3,742 %, 04/09/26 EMTN	EUR	2 345 000	2 362 967	0,27
Chubb INA Holdings LLC, 1,400 %, 15/06/31	EUR	4 150 000	3 606 230	0,42
Chubb INA Holdings LLC, 1,550 %, 15/03/28	EUR	600 000	559 897	0,06
Citigroup Inc, 0,500 %, 08/10/27 EMTN (i)	EUR	4 620 000	4 308 741	0,50
Coca-Cola Co, 0,400 %, 06/05/30	EUR	5 145 000	4 377 119	0,51
Corning Inc, 3,875 %, 15/05/26	EUR	2 420 000	2 422 386	0,28
Corning Inc, 4,125 %, 15/05/31	EUR	1 170 000	1 187 789	0,14
Dover Corp, 0,750 %, 04/11/27	EUR	2 850 000	2 606 011	0,30
Eli Lilly & Co, 1,375 %, 14/09/61	EUR	1 100 000	592 427	0,07
Eli Lilly & Co, 2,125 %, 03/06/30	EUR	3 805 000	3 575 102	0,41
General Mills Inc, 3,907 %, 13/04/29	EUR	1 100 000	1 113 949	0,13
General Motors Financial Co Inc, 3,900 %, 12/01/28 EMTN	EUR	1 230 000	1 233 977	0,14
Global Payments Inc, 4,875 %, 17/03/31	EUR	1 705 000	1 759 858	0,20
JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, 24/02/28 EMTN (i)	EUR	3 615 000	3 325 635	0,38
JPMorgan Chase & Co, 1,001 %, 25/07/31 EMTN (i)	EUR	4 945 000	4 237 191	0,49
JPMorgan Chase & Co, 3,761 %, 21/03/34 EMTN (i)	EUR	2 055 000	2 041 184	0,24
Kraft Heinz Foods Co, 2,250 %, 25/05/28	EUR	2 470 000	2 364 738	0,27
Mastercard Inc, 2,100 %, 01/12/27	EUR	3 790 000	3 652 863	0,42
Merck & Co Inc, 0,500 %, 02/11/24	EUR	1 350 000	1 335 001	0,15
Morgan Stanley, 2,950 %, 07/05/32 EMTN (i)	EUR	1 000 000	944 960	0,11
Morgan Stanley, 3,790 %, 21/03/30 (i)	EUR	3 100 000	3 101 922	0,36
Morgan Stanley, 4,656 %, 02/03/29 (i)	EUR	2 740 000	2 825 190	0,33
Nasdaq Inc, 0,900 %, 30/07/33	EUR	2 375 000	1 856 147	0,21
National Grid North America Inc, 4,668 %, 12/09/33 EMTN	EUR	1 735 000	1 800 328	0,21
Netflix Inc, 4,625 %, 15/05/29	EUR	3 585 000	3 748 146	0,43
PepsiCo, Inc, 0,500 %, 06/05/28 EMTN	EUR	3 930 000	3 549 242	0,41
PPG Industries Inc, 2,750 %, 01/06/29	EUR	2 655 000	2 557 931	0,30
Prologis Euro Finance LLC, 0,500 %, 16/02/32	EUR	2 200 000	1 709 154	0,20
Prologis Euro Finance LLC, 0,625 %, 10/09/31	EUR	2 890 000	2 315 899	0,27
Prologis Euro Finance LLC 1,000 %, 08/02/29 EMTN	EUR	1 750 000	1 547 465	0,18
Public Storage Operating Co, 0,500 %, 09/09/30	EUR	3 600 000	2 979 558	0,34
PVH Corp, 4,125 %, 16/07/29	EUR	1 900 000	1 893 039	0,22
Stryker Corp, 0,750 %, 01/03/29	EUR	2 400 000	2 120 018	0,24
Thermo Fisher Scientific Inc, 0,875 %, 01/10/31	EUR	3 440 000	2 890 632	0,33
Thermo Fisher Scientific Inc, 3,650 %, 21/11/34	EUR	2 600 000	2 612 059	0,30
Unilever Capital Corp, 3,300 %, 06/06/29 EMTN	EUR	1 250 000	1 255 440	0,14
Unilever Capital Corp, 3,400 %, 06/06/33 EMTN	EUR	2 745 000	2 741 459	0,32
United Parcel Service Inc, 1,500 %, 15/11/32	EUR	2 170 000	1 866 894	0,22
US Bancorp, 4,009 %, 21/05/32 (i)	EUR	4 245 000	4 240 286	0,49
Verizon Communications Inc, 0,375 %, 22/03/29	EUR	2 110 000	1 831 174	0,21
Verizon Communications Inc, 4,250 %, 31/10/30	EUR	6 350 000	6 576 447	0,76
Warnermedia Holdings Inc, 4,693 %, 17/05/33	EUR	2 473 000	2 456 866	0,28
			138 983 141	16,05

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND (suite)

Calendrier des investissements		Au 30 juin 2024
TOTAL DES OBLIGATIONS NON CONVERTIBLES	**841 500 712**	**97,17**
TOTAL DES OBLIGATIONS À LONG TERME ET DES OBLIGATIONS À MOYEN TERME	**841 500 712**	**97,17**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT HORS INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS (Coût : 837 706 576 EUR)	**841 500 712**	**97,17**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS - (0,02 %) (31 décembre 2023 : 0,00 %)

Contrats à terme normalisés - (0,02) % (31 décembre 2023 : 0,00 %)

Nombre de contrats	Libellé	Contrepartie	Engagement	Plus-value/ (Moins-value) latente	% de l'actif net
(896)	Euro-Bobl September 2024 Futures	JP Morgan	103 406 570	(923 670)	(0,11 %)
324	Euro-Bund September 2024 Futures	JP Morgan	42 038 840	606 040	0,07 %
431	Euro-Schatz September 2024 Futures	JP Morgan	45 394 750	161 950	0,02 %
Plus-value latente sur les contrats à terme normalisés				767 990	0,09 %
Moins-value latente sur les contrats à terme normalisés				(923 670)	(0,11 %)
Moins-value nette latente sur les contrats à terme normalisés				**(155 680)**	**(0,02 %)**

	Juste valeur EUR	% de l'actif net
Total de l'actif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**842 268 702**	**97,26**
Total du passif financier désigné à sa juste valeur par le biais du compte de résultat	**(923 670)**	**(0,11)**
TOTAL DE L'ACTIF FINANCIER À SA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT ET DES INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS	**841 345 032**	**97,15**
Avoirs nets en banque	20 468 110	2,36
Autres actifs	18 152 930	2,10
Moins autres passifs	(13 930 917)	(1,61)
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPANTES REMBOURSABLES	**866 035 155**	**100,00**

Calendrier des investissements	**Au 30 juin 2024**

LES DIX PREMIÈRES PARTICIPATIONS SECTORIELLES AU 30 JUIN 2024 EN POURCENTAGE DE L'ACTIF NET

Activités bancaires	31,45 %
Électricité	9,68 %
Télécommunications	5,99 %
Produits pharmaceutiques	4,30 %
REIT	3,82 %
Assurance	3,42 %
Santé	3,26 %
Automobile	3,24 %
Ingénierie et construction	2,74 %
Finance	2,62 %

(i) Indique un titre à taux variable. Le taux d'intérêt mentionné reflète le taux en vigueur au 30 juin 2024.
(ii) Titres émis par des émetteurs non américains ou non canadiens.
(iii) Obligations perpétuelles.

Abréviations

EUR : Euro

Analyse de l'actif total	**% de l'actif total**
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à une cote officielle	95,43
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	0,20
Instruments financiers dérivés	(0,02)
Actif circulant	4,39
	100,00

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, 4,875 %, 31/05/26	23 185 000	23 210 425
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 06/06/24	20 695 000	20 424 309
United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, 31/03/26	15 000 000	14 922 070
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, 28/02/26	13 555 000	13 547 587
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, 15/08/46	6 690 000	4 651 641
Ares Capital Corp, 5,875 %, 01/03/29	3 765 000	3 731 303
United Kingdom Treasury, 0,250 %, 01/31/25	2 930 000	3 562 228
Crédit Agricole SA, Zero Coupon Bond, 10/01/35 144A	3 205 000	3 208 792
Williams Cos Inc, 5,150 %, 15/03/34	2 725 000	2 724 319
New Zealand Government Bond, 3,500 %, 04/14/33	4 815 000	2 698 772
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, 15/11/51	4 350 000	2 650 180
Norway Government Bond, 1,750 %, 03/13/25	28 610 000	2 619 564
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, 01/04/63	3 255 000	2 609 599
United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, 30/04/26	2 575 000	2 567 154
Republic of Poland Government International Bond, 5,500 %, 18/03/54	2 530 000	2 500 677
United Arab Emirates Government International Bond, 4,857 %, 02/07/34 144A	2 310 000	2 310 000
Energy Transfer LP, 5,600 %, 01/09/34	2 105 000	2 099 548
Owens Corning, 5,700 %, 15/06/34	1 950 000	1 956 215
Turkiye Government International Bond, 5,875 %, 21/05/30	1 730 000	1 859 419
Mexico Government International Bond, 6,000 %, 07/05/36	1 840 000	1 836 866

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.

CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

Principales ventes	USD nominal	Produit USD
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, 30/06/25	46 665 000	46 589 876
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, 28/02/26	13 555 000	13 583 063
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 20/06/24	8 430 000	8 260 825
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 23/05/24	5 600 000	5 498 424
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 06/06/24	5 380 000	5 375 325
Aker BP ASA, 6,000 %, 13/06/33 144A	4 045 000	4 113 927
Anglo American Capital PLC, 5,500 %, 02/05/33 144A	4 050 000	3 954 971
Ares Capital Corp, 3,200 %, 15/11/31	3 765 000	3 117 834
Georgia-Pacific LLC, 7,750 %, 15/11/29	2 470 000	2 824 322
Williams Cos Inc, 5,150 %, 15/03/34	2 725 000	2 644 040
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 05/09/24	2 620 000	2 575 550
JPMorgan Chase & Co, Zero Coupon Bond, 01/06/34	2 375 000	2 363 671
CommScope Inc, 4,750 %, 01/09/29 144A	3 240 000	2 316 600
EQT Corp, 7,000 %, 01/02/30	2 150 000	2 272 132
Pertamina Persero PT, 6,450 %, 30/05/44 144A	2 150 000	2 242 450
Uber Technologies Inc, Zero Coupon Bond, 15/12/25	1 945 000	2 120 006
Ally Financial Inc, Zero Coupon Bond, 15/08/72	2 200 000	1 871 589
GENM Capital Labuan Ltd, 3,882 %, 19/04/31 144A	2 160 000	1 859 144
Mexico Government International Bond, 6,000 %, 07/05/36	1 840 000	1 833 630
Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 06/07/34 144A	1 725 000	1 772 783

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 Note/Bond, 4,875 %, 30/04/26	470 000	469 872
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, 15/05/25	185 000	179 045
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 08/08/24	120 000	118 497
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 04/09/24	75 000	73 975
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 6,625 %, 15/01/32 144A	60 000	60 094
Block Inc, 6,500 %, 15/05/32 144A	50 000	50 000
Hess Midstream Operations LP, 5,125 %, 15/06/28 144A	50 000	48 250
HUB International Ltd, 7,250 %, 15/06/30 144A	35 000	35 698
Zebra Technologies Corp, 6,500 %, 01/06/32 144A	35 000	35 269
Baldwin Insurance Group Holdings LLC / Baldwin Insurance Group Holdings Finance, 7,125 %, 15/05/31 144A	30 000	30 062
Panther Escrow Issuer LLC, 7,125 %, 01/06/31 144A	30 000	30 000
Medline Borrower LP/Medline Co-Issuer Inc, 6,250 %, 01/04/29 144A	30 000	29 975
AmWINS Group Inc, 6,375 %, 15/02/29 144A	30 000	29 963
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 7,000 %, 15/01/31 144A	25 000	25 446
1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 6,125 %, 15/06/29 144A	25 000	25 175
Matador Resources Co, 6,500 %, 15/04/32 144A	25 000	25 000
United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, 31/03/26	25 000	24 939
Directv Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor Inc, 5,875 %, 15/08/27 144A	25 000	23 513
Macquarie Airfinance Holdings Ltd, 6,500 %, 26/03/31 144A	20 000	20 138
Ecopetrol SA, 8,375 %, 19/01/36	20 000	20 047

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.

CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

Principales ventes	USD nominal	Produit USD
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, 15/05/25	185 000	179 491
United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, 30/04/26	170 000	170 371
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 08/08/24	120 000	118 515
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 04/09/24	100 000	99 695
Telecom Italia Capital SA, 6,000 %, 30/09/34	65 000	55 625
Energizer Holdings Inc, 4,375 %, 31/03/29 144A	60 000	53 513
Ford Motor Co, 4,346 %, 12/08/26	55 000	53 474
Teladoc Health Inc, 1,250 %, 01/06/27	55 000	46 063
Southwest Airlines Co, 1,250 %, 01/05/25	35 000	36 770
Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5,750 %, 15/11/31 144A	40 000	36 638
Sirius XM Radio Inc, 3,875 %, 01/09/31 144A	40 000	33 225
ADT Security Corp, 4,125 %, 01/08/29 144A	35 000	31 894
American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5,750 %, 20/04/29 144A	30 000	29 094
Entegris Inc, 4,750 %, 15/04/29 144A	30 000	28 667
Asbury Automotive Group Inc, 4,625 %, 15/11/29 144A	30 000	27 419
iHeartCommunications Inc, 4,750 %, 15/01/28 144A	40 000	27 099
Stagwell Global LLC, 5,625 %, 15/08/29 144A	30 000	27 044
Marriott Ownership Resorts Inc, 4,500 %, 15/06/29 144A	30 000	26 825
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 4,875 %, 01/07/31 144A	30 000	26 588
United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, 31/03/26	25 000	24 822

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
Japan Government Two Year Bond, 0,100 %, 01/01/26	2 296 150 000	14 965 536
United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, 15/11/33	11 750 000	11 789 280
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, 31/10/27	10 225 000	10 102 366
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 31/01/30	10 580 000	10 097 662
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, 30/04/25	7 835 000	7 465 150
China Government Bond, 3,020 %, 27/05/31	48 030 000	6 978 690
China Development Bank, 2,630 %, 01/08/34	45 380 000	6 344 004
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300 %, 15/02/33	5 700 000	6 094 846
Fannie Mae Pool, 2,000 %, 01/03/52	6 645 898	5 221 184
Fannie Mae Pool, 2,500 %, 01/01/54	6 230 422	5 091 909
Export Development Canada, 4,750 %, 05/06/34	4 700 000	4 832 681
Republic of South Africa Government Bond, 7,000 %, 28/02/31	111 280 000	4 789 397
Korea Treasury Bond, 4,125 %, 10/12/33	5 968 900 000	4 717 338
Japan Government Five Year Bond, 0,100 %, 20/12/25	680 850 000	4 521 747
China Development Bank, 2,340 %, 01/05/27	29 930 000	4 172 059
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, 15/02/53	4 895 000	4 170 003
United Kingdom Treasury, 0,625 %, 07/31/35	4 710 000	4 044 072
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, 15/02/26	3 650 000	3 762 355
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, 28/02/26	3 775 000	3 761 150
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,500 %, 30/04/24	3 750 000	3 731 225
German Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 17/07/24	3 285 000	3 505 394
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, 15/08/28	3 515 000	3 462 408
Freddie Mac Pool, 2,500 %, 01/03/52	3 854 698	3 123 510
Indonesia Treasury Bond, 6,625 %, 02/15/34	49 027 000 000	3 113 617
Spain Government Bond, 3,250 %, 30/04/34	2 820 000	3 007 245

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.

CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

Principales ventes	USD nominal	Produit USD
United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, 15/11/33	11 810 000	12 009 630
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 31/01/30	11 230 000	10 801 538
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, 31/10/27	10 645 000	10 543 593
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, 30/04/25	7 835 000	7 498 342
China Development Bank, 2,630 %, 01/08/34	45 380 000	6 399 669
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,500 %, 30/04/24	4 150 000	4 129 106
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, 28/02/26	3 775 000	3 761 648
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300 %, 15/02/33	3 500 000	3 751 392
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, 15/02/53	3 130 000	2 706 702
Japan Government Two Year Bond, 0,100 %, 01/01/26	382 050 000	2 468 532
United Kingdom Gilt, 0,625 %, 31/07/35	2 255 000	1 935 450
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, 15/08/28	1 505 000	1 477 491
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,000 %, 04/01/37	1 015 000	1 257 831
Australia Government Bond, 3,250 %, 21/04/25	1 680 000	1 103 866
CVS Health Corp, 5,300 %, 06/01/33	865 000	862 379
Intesa Sanpaolo SpA, 5,125 %, 29/08/31	715 000	838 825
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, 15/02/26	770 000	799 917
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, Zero Coupon Bond, 23/11/52	350 000	426 141
Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal, Zero Coupon Bond, 21/06/52	500 000	424 150
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, 19/05/33	350 000	342 624

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, 25/01/24	3 100 000	3 091 935
Saudi Government International Bond, 4,750 %, 16/01/30 144A	400 000	397 180
Saudi Government International Bond, 5,000 %, 16/01/34 144A	400 000	395 972
Saudi Government International Bond, 5,750 %, 16/01/54 144A	400 000	391 168
Juniper Networks Inc	2 420	90 619
PTC Inc	530	89 123
Analog Devices Inc	468	87 695
Teradyne Inc	785	75 957
Skyworks Solutions Inc	749	75 955
Enphase Energy Inc	773	75 439
Verizon Communications Inc	1 128	43 782
Nasdaq Inc	708	39 928
Centene Corp	498	38 981
Humana Inc	85	38 942
Quest Diagnostics Inc	273	38 253
Amcor PLC	3 793	36 841
T-Mobile US Inc	205	33 164
Match Group Inc	884	32 412
Broadcom Inc	28	30 892
Brown & Brown Inc	371	28 893

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

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.

CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

Principales ventes	USD nominal	Produit USD
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 04/09/24	2 365 000	2 356 339
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 25/01/24	800 000	798 366
Uruguay Government International Bond, 8,250 %, 21/05/31	27 411 000	673 462
Mexican Bonos, 7,750 %, 29/05/31	10 086 600	555 360
Republic of South Africa Government Bond, 8,000 %, 31/01/30	11 457 300	553 637
Colombian TES, 7,750 %, 18/09/30	1 855 500 000	435 105
Saudi Government International Bond, 5,000 %, 16/01/34 144A	400 000	398 000
Saudi Government International Bond, 4,750 %, 16/01/30 144A	400 000	396 252
Saudi Government International Bond, 5,750 %, 16/01/54 144A	400 000	393 452
Gaci First Investment Co, 4,875 %, 14/02/35	390 000	372 489
Gaci First Investment Co, 5,125 %, 14/02/53	390 000	340 275
Malaysia Government Bond, 2,632 %, 15/04/31	1 360 000	267 261
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 30/01/24	260 000	259 279
Microsoft Corp	566	217 674
Teradyne Inc	1 761	184 662
General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, 04/06/26	125 000	125 413
Texas Instruments Inc	654	112 092
Enphase Energy Inc	885	108 158
Keysight Technologies Inc	705	106 891
Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 09/15/30	1 497 000 000	97 353

* Le Fonds a cessé ses activités le 19 mars 2024.

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
Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, 18/09/27	570 000	556 538
Paprec Holding SA, 7,250 %, 17/11/29	400 000	424 985
Vodafone Group PLC, Zero Coupon Bond, 03/10/78	430 000	420 325
iliad SA, 1,875 %, 11/02/28	400 000	366 000
Valeo SE, 5,875 %, 12/04/29	300 000	317 048
Orsted AS, Zero Coupon Bond, 18/02/21	390 000	309 725
British Telecommunications PLC, Zero Coupon Bond, 03/10/54	310 000	308 346
Nykredit Realkredit AS, Zero Coupon Bond, 29/12/32	300 000	307 754
iliad SA, 5,375 %, 15/02/29	300 000	306 470
ABN AMRO Bank NV, Zero Coupon Bond, 22/02/33	300 000	306 010
Schaeffler AG, 4,750 %, 14/08/29	300 000	304 695
Saipem Finance International BV, 4,875 %, 30/05/30	300 000	300 070
Lloyds Banking Group PLC, Zero Coupon Bond, 05/04/34	300 000	298 438
Schaeffler AG, 4,500 %, 28/03/30	300 000	298 391
Valeo SE, 4,500 %, 11/04/30	300 000	297 178
SES SA, 2,875 %, 27/08/72	315 000	296 750
ELO SACA, 3,250 %, 23/07/27	300 000	278 149
CPI Property Group SA, Zero Coupon Bond, 23/04/27	300 000	264 125
Valeo SE, 1,000 %, 03/08/28	300 000	261 306
Cellnex Telecom SA, 1,750 %, 23/10/30	300 000	260 504

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.

CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

Principales ventes	EUR nominal	Produit EUR
Cellnex Telecom SA, 1,875 %, 26/06/29	600 000	549 468
Valeo SE, 1,000 %, 03/08/28	500 000	437 042
Électricité de France SA, Zero Coupon Bond, 01/06/73	400 000	361 600
Valeo SE, 5,875 %, 12/04/29	300 000	318 554
Forvia SE, 7,250 %, 15/06/26	300 000	315 915
Banco Santander SA, Zero Coupon Bond, 23/08/33	300 000	312 330
Nykredit Realkredit AS, Zero Coupon Bond, 29/12/32	300 000	308 909
ABN AMRO Bank NV, Zero Coupon Bond, 22/02/33	300 000	306 921
iliad SA, 5,375 %, 15/02/29	300 000	306 600
Jaguar Land Rover Automotive PLC, 4,500 %, 15/07/28	300 000	300 365
Nationwide Building Society, Zero Coupon Bond, 25/07/29	300 000	298 470
Telefonica Europe BV, Zero Coupon Bond, 22/09/72	300 000	295 940
Deutsche Lufthansa AG, 2,875 %, 16/05/27	300 000	288 900
WMG Acquisition Corp, 2,250 %, 15/08/31	315 000	275 573
Cellnex Telecom SA, 1,750 %, 23/10/30	300 000	266 319
Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc, 2,125 %, 15/08/26	300 000	256 130
Mundys SpA, 4,750 %, 24/01/29	225 000	228 231
Derichebourg SA, 2,250 %, 15/07/28	250 000	227 500
Webuild SpA, 3,625 %, 28/01/27	230 000	223 445
Webuild SpA, 7,000 %, 27/09/28 144A	200 000	214 976

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
Crédit Agricole SA, Zero Coupon Bond, 12/01/28	1 300 000	1 196 639
Bank of America Corp, Zero Coupon Bond, 24/08/28	1 235 000	1 115 705
BP Capital Markets PLC, 1,231 %, 08/05/31	1 250 000	1 067 997
Mercedes-Benz International Finance BV, 0,375 %, 08/11/26	1 100 000	1 019 260
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,750 %, 17/01/30	1 200 000	1 006 880
Mercedes-Benz Group AG, 1,500 %, 03/07/29	1 100 000	998 481
Mercedes-Benz International Finance BV, 3,250 %, 15/11/30	1 000 000	991 654
Banco Santander SA, Zero Coupon Bond, 09/01/28	900 000	897 620
UBS Group AG, Zero Coupon Bond, 01/03/29	750 000	856 005
CaixaBank SA, 0,750 %, 09/07/26	900 000	849 346
Ayvens SA, 4,375 %, 23/11/26	800 000	810 022
McDonald's Corp, 1,600 %, 15/03/31	900 000	797 689
BNI Finance BV, 3,875 %, 12/01/30	780 000	795 762
Duke Energy Corp, 3,750 %, 01/04/31	800 000	794 296
General Electric Co, 4,125 %, 19/09/35	765 000	782 248
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3,875 %, 09/05/28	750 000	760 524
Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1,650 %, 28/03/31	800 000	723 720
Fortive Corp, 3,700 %, 15/08/29	720 000	719 398
LKQ Dutch Bond BV, 4,125 %, 13/03/31	720 000	715 647
Eli Lilly & Co, 2,125 %, 03/06/30	750 000	708 742

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.

CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

Principales ventes	EUR nominal	Produit EUR
Mercedes-Benz International Finance BV, 0,375 %, 08/11/26	1 100 000	1 016 499
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,750 %, 17/01/30	1 200 000	1 015 716
Mercedes-Benz Group AG, 1,500 %, 03/07/29	1 100 000	1 011 712
CaixaBank SA, Zero Coupon Bond, 19/07/29	800 000	832 340
Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1,650 %, 28/03/31	920 000	827 936
Ayvens SA, 4,250 %, 18/01/27	800 000	812 320
Crédit Agricole SA, Zero Coupon Bond, 22/04/27	800 000	771 440
UBS AG/London, 5,500 %, 20/08/26	730 000	762 092
BNP Paribas SA, Zero Coupon Bond, 13/04/27	800 000	745 212
Orsted AS, 1,500 %, 26/11/29	820 000	736 241
LKQ Dutch Bond BV, 4,125 %, 13/03/31	720 000	722 998
Fortive Corp, 3,700 %, 15/08/29	720 000	721 132
Volkswagen Bank GmbH, 4,375 %, 03/05/28	700 000	717 188
Ayvens SA, 4,375 %, 23/11/26	700 000	709 331
Mercedes-Benz Finance Canada Inc, 3,000 %, 23/02/27	680 000	676 369
BNP Paribas SA, Zero Coupon Bond, 31/03/32	700 000	665 275
Bank of America Corp, Zero Coupon Bond, 04/05/27	660 000	634 128
Medtronic Global Holdings SCA, 1,125 %, 07/03/27	655 000	613 868
Swedbank AB, 1,300 %, 17/02/27	650 000	608 207
Groupe des Assurances du Crédit Mutuel SADIR, 3,750 %, 30/04/29	600 000	600 030

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

Principaux achats	EUR nominal	Coût EUR
Crédit Agricole SA, Zero Coupon Bond, 12/01/28	8 700 000	8 002 956
Bank of America Corp, Zero Coupon Bond, 24/08/28	8 485 000	7 648 860
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,750 %, 17/01/30	8 000 000	6 713 588
UBS Group AG, Zero Coupon Bond, 01/03/29	5 275 000	6 023 845
Banco Santander SA, Zero Coupon Bond, 09/01/28	5 400 000	5 385 920
LKQ Dutch Bond BV, 4,125 %, 13/03/31	5 085 000	5 093 323
Citigroup Inc, Zero Coupon Bond, 08/10/27	5 520 000	5 089 748
BNI Finance BV, 3,875 %, 12/01/30	4 820 000	4 917 445
Fortive Corp, 3,700 %, 15/08/29	4 900 000	4 896 649
Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 27/01/28	5 180 000	4 743 953
BNP Paribas SA, Zero Coupon Bond, 25/07/28	4 900 000	4 737 316
Crédit Agricole SA, 3,750 %, 22/01/34	4 500 000	4 507 010
Ayvens SA, 4,375 %, 23/11/26	4 400 000	4 455 177
HOCHTIEF AG, 4,250 %, 31/05/30	4 460 000	4 442 751
US Bancorp, Zero Coupon Bond, 21/05/32	4 345 000	4 346 104
Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 17/11/29	4 900 000	4 303 305
Commerzbank AG, Zero Coupon Bond, 14/09/27	4 400 000	4 273 611
Molnlycke Holding AB, 0,875 %, 05/09/29	4 900 000	4 192 636
CaixaBank SA, Zero Coupon Bond, 19/07/29	4 000 000	4 175 800
Eli Lilly & Co, 2,125 %, 03/06/30	4 405 000	4 173 890

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.

CALENDRIER DES ÉVOLUTIONS DU PORTEFEUILLE (suite)

Principales ventes	EUR nominal	Produit EUR
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 0,750 %, 17/01/30	8 000 000	6 767 807
CaixaBank SA, Zero Coupon Bond, 19/07/29	6 000 000	6 240 535
NatWest Group PLC, Zero Coupon Bond, 02/03/26	6 340 000	6 195 242
Crédit Agricole SA, Zero Coupon Bond, 22/04/27	6 400 000	6 171 520
Medtronic Global Holdings SCA, 1,125 %, 07/03/27	5 520 000	5 171 871
UBS AG/London, 5,500 %, 20/08/26	4 920 000	5 136 186
Fortive Corp, 3,700 %, 15/08/29	4 900 000	4 908 337
Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 03/10/27	5 200 000	4 902 171
UBS Group AG, Zero Coupon Bond, 14/01/28	5 345 000	4 894 951
Swedbank AB, 1,300 %, 17/02/27	5 225 000	4 885 990
BNP Paribas SA, Zero Coupon Bond, 13/04/27	5 200 000	4 841 124
Intesa Sanpaolo SpA, 4,875 %, 19/05/30	4 550 000	4 810 192
Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 27/01/28	5 180 000	4 795 330
Visa Inc, 1,500 %, 15/06/26	4 955 000	4 768 374
Fiserv Inc, 4,500 %, 24/05/31	4 500 000	4 701 808
Toyota Motor Credit Corp, 4,050 %, 13/09/29	4 540 000	4 690 240
BNP Paribas SA, 3,625 %, 01/09/29	4 600 000	4 597 685
Sanofi SA, 1,375 %, 21/03/30	5 000 000	4 511 279
Ayvens SA, 4,250 %, 18/01/27	4 400 000	4 467 502
Ayvens SA, 4,375 %, 23/11/26	4 200 000	4 256 105

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

ANNEXE I

Divulgation 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 nette par Action la plus faible	Valeur d'inventaire nette par Action la plus élevée
Classe d'Actions C/A (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	20,15	22,21
Période close le 30 juin 2024	21,58	22,40
Classe d'Actions C/D (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	11,09	12,33
Période close le 30 juin 2024	11,67	12,16
Classe d'Actions CT/A (USD)		
Période close 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
Exercice clos le 31 décembre 2023	9,27	10,21
Période close le 30 juin 2024	9,91	10,28
Classe d'Actions CT/DG (USD)		
Période close le 31 décembre 2022	9,15	10,17
Exercice clos le 31 décembre 2023	8,96	9,98
Période close le 30 juin 2024	9,37	9,78
Classe d'Actions CT/DM (USD)		
Période close 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 31 décembre 2023*	8,64	9,53
Période close le 30 juin 2024	9,08	9,44
Classe d'Actions F/A (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	13,42	14,82
Période close le 30 juin 2024	14,44	15,01

* La classe d'actions a été totalement rachetée le 3 avril 2023 et rouverte le 12 juin 2023.

ANNEXE I (suite)

Divulgation de la performance (suite)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

Classe d'Actions	Valeur d'inventaire nette par Action la plus faible	Valeur d'inventaire nette par Action la plus élevée
Classe d'Actions F/DM (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	7,48	8,30
Période close le 30 juin 2024	7,87	8,17
Classe d'Actions H-I/A (EUR)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	14,70	16,19
Période close le 30 juin 2024	15,71	16,29
Classe d'Actions H-I/D (EUR)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	8,11	9,17
Période close le 30 juin 2024	8,46	8,85
Classe d'Actions H-I/D (GBP)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	9,40	10,52
Période close le 30 juin 2024	9,87	10,30
Classe d'Actions H-N/A (CHF)		
Période close 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
Exercice clos le 31 décembre 2023	8,56	9,53
Période close le 30 juin 2024	9,03	9,39
Classe d'Actions H-N/A (EUR)		
Période close 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
Exercice clos le 31 décembre 2023	8,62	9,49
Période close le 30 juin 2024	9,21	9,55

ANNEXE I (suite)

Divulgation de la performance (suite)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

Classe d'Actions	Valeur d'inventaire nette par Action la plus faible	Valeur d'inventaire nette par Action la plus élevée
Classe d'Actions H-N1/A (EUR)		
Période close 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
Exercice clos le 31 décembre 2023	8,73	9,61
Période close le 30 juin 2024	9,32	9,67
Classe d'Actions H-R/A (EUR)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	9,12	10,04
Période close le 30 juin 2024	9,72	10,06
Classe d'Actions H-R/A (SGD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	9,88	10,87
Période close le 30 juin 2024	10,52	10,90
Classe d'Actions H-R/D (SGD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	7,33	8,23
Période close le 30 juin 2024	7,64	8,00
Classe d'Actions H-RE/DM (AUD)		
Période close 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
Exercice clos le 31 décembre 2023	8,01	9,00
Période close le 30 juin 2024	8,36	8,71
Classe d'Actions H-S/D (EUR)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	6,50	7,34
Période close le 30 juin 2024	6,78	7,09

ANNEXE I (suite)

Divulgation de la performance (suite)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

Classe d'Actions	Valeur d'inventaire nette par Action la plus faible	Valeur d'inventaire nette par Action la plus élevée
Classe d'Actions I/A (EUR)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	30,77	32,84
Période close le 30 juin 2024	32,51	34,34
Classe d'Actions I/A (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	17,19	19,00
Période close le 30 juin 2024	18,53	19,27
Classe d'Actions I/D (GBP)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	10,28	11,54
Période close le 30 juin 2024	10,63	10,96
Classe d'Actions I/D (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	10,28	11,43
Période close le 30 juin 2024	10,81	11,27
Classe d'Actions I/DG (USD)		
Période close le 31 décembre 2022	9,18	10,17
Exercice clos le 31 décembre 2023	9,04	10,02
Période close le 30 juin 2024	9,51	9,88
Classe d'Actions N/A (EUR)		
Période close le 31 décembre 2023	9,73	10,39
Période close le 30 juin 2024	10,28	10,86
Classe d'Actions N1/A (USD)		
Période close 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
Exercice clos le 31 décembre 2023	9,87	10,91
Période close le 30 juin 2024	10,64	11,06

ANNEXE I (suite)

Divulgation de la performance (suite)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

Classe d'Actions	Valeur d'inventaire nette par Action la plus faible	Valeur d'inventaire nette par Action la plus élevée
Classe d'Actions N1/D (USD)		
Période close 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
Exercice clos le 31 décembre 2023	8,03	8,94
Période close le 30 juin 2024	8,45	8,81
Classe d'Actions R/A (EUR)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	21,02	22,39
Période close le 30 juin 2024	22,16	23,35
Classe d'Actions R/A (SGD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	11,14	11,83
Période close le 30 juin 2024	11,71	12,27
Classe d'Actions R/A (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	15,33	16,92
Période close le 30 juin 2024	16,47	17,12
Classe d'Actions R/D (EUR)		
Période close le 31 décembre 2022	9,18	10,08
Exercice clos le 31 décembre 2023	8,72	9,45
Période close le 30 juin 2024	9,03	9,42
Classe d'Actions R/D (GBP)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	13,65	15,32
Période close le 30 juin 2024	14,12	14,55

ANNEXE I (suite)

Divulgation de la performance (suite)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

Classe d'Actions	Valeur d'inventaire nette par Action la plus faible	Valeur d'inventaire nette par Action la plus élevée
Classe d'Actions R/D (SGD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	7,96	8,46
Période close le 30 juin 2024	8,28	8,58
Classe d'Actions R/D (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	10,30	11,45
Période close le 30 juin 2024	10,83	11,29
Classe d'Actions R/DG (USD)		
Période close le 31 décembre 2022	9,20	10,22
Exercice clos le 31 décembre 2023	9,00	10,04
Période close le 30 juin 2024	9,41	9,80
Classe d'Actions R/DM (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	11,95	13,25
Période close le 30 juin 2024	12,57	13,05
Classe d'Actions RE/A (EUR)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	18,73	19,96
Période close le 30 juin 2024	19,71	20,73
Classe d'Actions RE/A (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	14,08	15,54
Période close le 30 juin 2024	15,11	15,69

ANNEXE I (suite)

Divulgation de la performance (suite)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (suite)

Classe d'Actions	Valeur d'inventaire nette par Action la plus faible	Valeur d'inventaire nette par Action la plus élevée
Classe d'Actions RE/D (USD)		
Période close 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
Exercice clos le 31 décembre 2023	9,70	10,69
Période close le 30 juin 2024	10,40	10,79
Classe d'Actions RE/DM (USD)		
Période close 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
Exercice clos le 31 décembre 2023	9,67	10,66
Période close le 30 juin 2024	10,37	10,77
Classe d'Actions S/A (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	17,26	19,08
Période close le 30 juin 2024	18,62	19,37
Classe d'Actions S/D (GBP)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	10,32	11,53
Période close le 30 juin 2024	10,76	11,08
Classe d'Actions S/D (USD)		
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
Exercice clos le 31 décembre 2023	12,49	13,90
Période close le 30 juin 2024	13,14	13,71

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 2024, les Fonds ne détenaient aucun instrument entrant dans le champ d'application du Règlement sur les OFT.