

Threadneedle (Lux)

Rapport annuel et comptes audités

Société d'investissement à capital variable

31 mars 2023

SICAV : un Organisme de placement collectif en valeurs mobilières luxembourgeois en vertu de la partie I de la loi du 17 décembre 2010, telle qu'amendée R.C.S. Luxembourg B-50.216

Table des matières

Informations sur la Société	4	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	76
Rapport du Conseil d'administration	5	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	77
Performance	8	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	78
Rapport des Commissaires aux comptes indépendants	9	États des Portefeuilles	
Comptes :		Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	80
Comptes consolidés pour Threadneedle (Lux)	12	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	89
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	13	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	95
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	15	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	104
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	17	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	109
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	19	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	116
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	20	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	123
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	22	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	127
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	23	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	133
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	24	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	137
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	25	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	146
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	26	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	150
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	28	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	152
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	30	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	155
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	31	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	170
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	32	Threadneedle (Lux) - Global Focus	172
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	34	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	174
Threadneedle (Lux) - Global Focus	35	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	177
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	37	Threadneedle (Lux) - Global Select	179
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	38	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	181
Threadneedle (Lux) - Global Select	40	Threadneedle (Lux) - American	183
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	41	Threadneedle (Lux) - American Select	184
Threadneedle (Lux) - American	43	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	185
Threadneedle (Lux) - American Select	45	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	187
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	47	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	189
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	48	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	191
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	49	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	193
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	50	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	195
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	51	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	197
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	53	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	199
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	55	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	201
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	57	Threadneedle (Lux) - European Select	203
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	58	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	205
Threadneedle (Lux) - European Select	60	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	207
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	62	Threadneedle (Lux) - Global Technology	209
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	63	Threadneedle (Lux) - UK Equities	210
Threadneedle (Lux) - Global Technology	64	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	211
Threadneedle (Lux) - UK Equities	65	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	212
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	67	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	214
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	69	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	220
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	70	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	223
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	71	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	224
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	73	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	225
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	75	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	227

*Voir annexe 1.

Table des matières

(suite)

Annexes aux Comptes	228
Exposition globale au risque (non audité)	343
Informations aux Actionnaires (non audité)	345
Informations concernant les investisseurs en Suisse (non audité)	348
Performance des Classes d'actions (non audité)	349
Règlement relatif aux opérations de financement sur titres (non audité)	375
Règlement relatif à la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (SFDR) (non audité)	377
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond Fund	377
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	385
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	393
Threadneedle (Lux) - Global Focus	401
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	409
Threadneedle (Lux) - Global Select	418
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	426
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	434
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	443
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	452
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	461
Threadneedle (Lux) - European Select	469
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	477
Annuaire	487

Aucune souscription ne peut être acceptée sur la base des rapports financiers. Les souscriptions ne sont valables que si elles sont effectuées sur la base du prospectus accompagné du dernier rapport annuel et du dernier rapport semestriel si celui-ci a été publié ultérieurement.

Ce rapport est une traduction de la version originale en anglais. En cas d'ambiguïté, la version en langue anglaise fera foi dans les limites autorisées par la loi applicable.

Informations sur la Société

Société

Threadneedle (Lux)
R.C.S. Luxembourg B-50.216

Siège social

31 Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Grand-Duché de Luxembourg

Société de gestion

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Conseil d'administration

Claude Kremer
Administrateur non exécutif indépendant
Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Julie Griffiths
Directrice mondiale du risque d'investissement
Columbia Threadneedle Investments
Londres
Royaume-Uni

Annemarie Nicole Arens
Administratrice non exécutive indépendante
Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Joseph Patrick LaRocque
Administrateur non exécutif indépendant
Maryland
États-Unis d'Amérique

Thomas Seale
Administrateur non exécutif indépendant
Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Rapport du Conseil d'administration

Les marchés financiers connaissent une forte volatilité depuis 12 mois. Avant même l'invasion russe de l'Ukraine fin février 2022, les pressions inflationnistes se sont intensifiées en raison des perturbations liées à la pandémie dans les chaînes d'approvisionnement mondiales. Une nouvelle hausse des prix de l'énergie due à la guerre a continué de faire grimper l'inflation à travers le monde.

Ayant minimisé les risques d'inflation, les jugeant « transitoires », pendant une grande partie de l'année 2021, les banques centrales aux États-Unis, au Royaume-Uni et en Europe ont relevé les taux d'intérêt de manière agressive en 2022 et au premier trimestre 2023. Aux États-Unis, la Réserve fédérale (Fed) a relevé ses taux d'intérêt de la fourchette cible de 0,25-0,50 % fin mars 2022 à 4,75-5,0 %. Au Royaume-Uni, la Banque d'Angleterre (BoE) a relevé le taux de base de 0,75 % à 4,25 %, tandis que la Banque centrale européenne (BCE) a également augmenté les taux. En revanche, la Banque du Japon a maintenu ses taux à -0,1 % tout au long de l'année, mais a relevé son plafond sur les rendements des obligations d'État à 10 ans fin 2022. Cela a été largement interprété comme la première étape de sa politique monétaire ultra-souple.

Au fil de l'année 2022, la perspective d'une récession a encore pesé sur la confiance des investisseurs. Les problèmes liés à la chaîne d'approvisionnement, la hausse des taux d'intérêt et la politique chinoise « zéro Covid » ont tous contribué au ralentissement de la croissance mondiale. En outre, la guerre en Ukraine a poussé les prix de l'énergie à la hausse en Europe, réduisant ainsi les budgets des consommateurs et entraînant une flambée des coûts d'exploitation des entreprises. Vers la fin de la période, la faiblesse des données économiques mondiales et le ralentissement de l'inflation ont alimenté les espoirs que les principales banques centrales soient sur le point de mettre fin à leur cycle actuel de hausses des taux.

La volatilité du marché a grimpé en mars, suite à l'annonce de l'effondrement de la Silicon Valley Bank (SVB) et des problèmes rencontrés par deux autres petits prêteurs américains. Les rendements des obligations d'État (qui évoluent à l'inverse des cours) ont connu quelques-unes des plus fortes baisses depuis plusieurs décennies, en particulier sur les obligations à plus courte échéance, les investisseurs anticipant moins de hausses des taux d'intérêt. Les spreads de crédit (les primes de rendement sur les obligations d'État « sans risque ») se sont élargis en mars après un resserrement au cours des deux premiers mois de l'année, en particulier dans le crédit à haut rendement (HY).

La faillite de la SVB, puis sa mise en liquidation et son rachat par la Federal Deposit Insurance Corporation ont fait trembler l'ensemble du secteur bancaire et attiré l'attention sur les pertes subies par les portefeuilles obligataires des banques en raison de la hausse des taux d'intérêt. Les actions bancaires ont chuté, en particulier celles des prêteurs plus faibles, et en Suisse, les régulateurs ont facilité le rachat de Credit Suisse en difficulté par son principal concurrent UBS. Vers la fin du mois de mars, les actions bancaires se sont stabilisées et, au moment de la rédaction de ce document, des signes indiquent que les craintes initiales de contagion ont été contenues.

L'impact le plus immédiat de la crise a été de réduire les attentes quant à l'évolution des taux d'intérêt, sous l'effet notamment de la supposée réticence des banques centrales à prendre le risque d'une nouvelle détresse dans le secteur bancaire. Les troubles bancaires, en particulier aux États-Unis, devraient également entraîner un resserrement des conditions de crédit et donc limiter la croissance et l'inflation à la marge. Le président de la Fed, Jerome Powell, a déclaré que cela aurait probablement le même impact qu'une hausse des taux.

Au Royaume-Uni, les inquiétudes concernant les finances du pays se sont accentuées en septembre, avec la présentation par l'ancien chancelier de l'Échiquier Kwasi Kwarteng de son « mini-budget » de réduction des taxes. Le manque d'informations sur le financement ou les habituelles prévisions indépendantes de l'Office for Budget Responsibility ont surpris les investisseurs. Par conséquent, les actions ont chuté, les rendements des gilts se sont envolés et la livre sterling a presque atteint la parité avec le dollar. La hausse soudaine des rendements des gilts représentait un risque important pour un certain nombre de fonds de pension britanniques. La Banque d'Angleterre est donc intervenue pour calmer les marchés en s'engageant à acheter jusqu'à 65 milliards de livres sterling de gilts à long terme. En octobre, la livre sterling s'est redressée et les rendements des gilts ont chuté alors que la Première ministre Liz Truss a limogé Kwasi Kwarteng chancelier de l'Échiquier avant d'être elle-même rapidement remplacée par Rishi Sunak. Le nouveau chancelier, Jeremy Hunt, est revenu sur la plupart des promesses de son prédécesseur et a annoncé des hausses d'impôts et des réductions des dépenses. Le budget de Hunt au printemps suivant ne contenait que quelques surprises. Le chancelier a déclaré que le Royaume-Uni était susceptible d'éviter une récession en 2023 et a réitéré l'engagement du gouvernement à réduire de moitié l'inflation, à renforcer les finances publiques et à stimuler la croissance économique.

Dans ce contexte difficile, le MSCI ACWI a dégagé un rendement de -5,1 % en devise locale sur la période de 12 mois considérée.

Parmi les principales régions d'actions, l'Europe hors Royaume-Uni et le Japon ont obtenu les meilleurs résultats en devises locales et ont affiché des rendements positifs. Ces marchés fortement exportateurs ont été stimulés par la faiblesse de leurs devises respectives face au dollar américain. Vers la fin de la période, les actions européennes hors Royaume-Uni ont également bénéficié de l'amélioration des perspectives économiques de la région. Les actions britanniques ont également progressé au cours de l'année, soutenues par la faiblesse de la livre sterling face au dollar. L'exposition importante du marché aux valeurs énergétiques et minières s'est également avérée avantageuse compte tenu des fortes hausses des cours des matières premières sous-jacentes suite à l'invasion russe.

Les marchés émergents (ME) ont sous-performé, initialement sous l'effet de la faiblesse des actions chinoises, la politique « zéro Covid » de Pékin ayant fortement pesé sur l'activité économique. La confiance a également été mise à mal par une crise en plein essor dans le secteur immobilier et par la poursuite des mesures de répression réglementaires. Plus tard sur cette période, les actions chinoises ont fortement rebondi, Pékin ayant levé la plupart de ses restrictions liées à la COVID-19 et semblant assouplir sa répression à l'égard des grandes entreprises. Les États-Unis ont enregistré les plus mauvais résultats, pénalisés par les épisodes de faiblesse des titres de croissance et une série de revenus de sociétés décevants pour le dernier trimestre 2022.

En ce qui concerne les titres à revenu fixe, les rendements des obligations d'État de base ont fortement augmenté au cours de la période, les investisseurs ayant réagi aux fortes hausses des taux d'intérêt de la Fed, de la BoE et de la BCE. Le rendement des bons du Trésor américain à 10 ans a augmenté de 113 points de base (pb), clôturant mars 2023 à 3,47 %. Les équivalents britanniques et allemands ont respectivement augmenté de 188 points de base à 3,49 % et de 174 points de base à 2,29 %. Les marchés des obligations d'entreprises ont également été faibles sur une grande partie de la période, l'impact négatif de la hausse des rendements obligataires étant aggravé par l'élargissement des spreads de crédit. Cependant, les spreads se sont resserrés par rapport au quatrième trimestre 2022, dans un contexte d'apaisement des craintes liées au resserrement monétaire, les spreads de rendement des obligations IG mondiales ayant terminé l'année avec une augmentation de plus de 30 points de base. Les spreads de haut rendement en euro se sont également élargis au cours de la période.

Rapport du Conseil d'administration

(suite)

Au sein du portefeuille Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity Fund, les nouvelles participations au cours de la période comprenaient Singapur Telecommunications Singtel, BYD et Parade Technologies. SingTel est le plus grand fournisseur de services de télécommunications de Singapour et le deuxième plus important en Australie grâce à la société Optus qu'il détient. La société détient également des participations dans plusieurs autres sociétés de télécommunications de la région. La valorisation semblait attrayante et les bénéfices semblent résistants, tandis que les actions offrent un bon rendement de dividende. BYD est l'un des principaux constructeurs automobiles en Chine et la plus grande marque de véhicules électriques (VE) en termes de ventes. La société est également un important fournisseur de batteries et de composants de téléphones portables. Nous sommes optimistes quant à la croissance des volumes de ventes de véhicules électriques de BYD et il existe un potentiel de marges plus élevées, grâce à l'amélioration de la gamme de produits de la société. Les perspectives pour la société taïwanaise de semi-conducteurs fables Parade Technologies semblent encourageantes, le processus de déstockage arrivant à son terme. Par ailleurs, nous avons acheté Kasikornbank, l'un des quatre principaux groupes bancaires de Thaïlande. La banque devrait bénéficier de la reprise de l'économie thaïlandaise, les secteurs clés tels que le tourisme et la vente au détail ayant fortement rebondi après la COVID-19. Nous avons liquidé la société chinoise Baidu, car nous avons estimé que la société pourrait être impactée par les restrictions à l'exportation de semi-conducteurs imposées par les États-Unis. Outre Baidu, les autres ventes comprenaient OCBC et Sea à Singapour et Lotte Chilsung Beverage en Corée. Ces actions ont été vendues pour augmenter les positions en Chine, telles qu'Alibaba et China Construction Bank, où les valorisations ont offert la possibilité d'une nouvelle réévaluation compte tenu de l'amélioration des perspectives après la réouverture post-pandémie.

Au sein du portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Select Fund, les nouvelles positions au cours de la période comprenaient TotalEnergies, PepsiCo et Elevance Health. Nous privilégions TotalEnergies pour sa gamme de produits diversifiée, sa forte présence internationale et sa solide position sur le marché. En outre, la société a une longueur d'avance sur ses pairs dans la construction d'une activité renouvelable. PepsiCo est l'un des principaux fournisseurs mondiaux de produits alimentaires, de boissons et de snacks. Nous pensons que son portefeuille de marques de haute qualité devrait soutenir une solide croissance du chiffre d'affaires avec une faible volatilité. PepsiCo bénéficie également d'une part de marché élevée, d'une fidélité des clients et d'un pouvoir de fixation des prix élevé. Elevance Health est l'un des principaux fournisseurs d'assurance santé aux États-Unis. L'entreprise possède l'une des marques les plus reconnaissables dans le pays et bénéficie d'une envergure importante dans le secteur, ce qui contribue à générer des avantages en termes de coûts et à fidéliser la clientèle. Elevance Health devrait également bénéficier de la croissance de la demande en assurance maladie. Nous avons détenu des positions dans SVB Financial et First Republic. En tant que leader en matière de financement pour le secteur du capital-investissement et du capital-risque, SVB a affiché un large éventail d'avantages concurrentiels et a fourni une exposition bancaire différenciée pour le portefeuille. Toutefois, en raison des difficultés rencontrées dans le secteur des technologies et de la raréfaction des nouveaux financements, la banque a enregistré une fuite des dépôts, ce qui a entraîné un risque potentiel de liquidité dans le bilan et a conduit aux événements du mois de mars. L'échec de la SVB et la perte de confiance qui en résulte dans les banques régionales américaines ont également eu un impact sur First Republic. Nous avons vendu notre position dans cette dernière mi-mars avant son quasi-effondrement et son rachat forcé par JPMorgan en avril. Nous avons également vendu Samsung Electronics suite à la solide performance de l'action et utilisé le bénéfice pour établir une participation dans Micron Technology, qui a un profil risque-rendement supérieur.

Au sein du portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Focus Fund, nous avons ouvert un certain nombre de positions au cours de la période, notamment HDFC Bank, Legrand et Waste Connections. Nous avons acheté HDFC, la principale banque indienne du secteur privé, après avoir vendu ICICI Bank, car nous voulions concentrer notre exposition au secteur dans une seule participation, et nous pensons que HDFC dispose d'un meilleur historique des prêts à long terme. Legrand est un leader dans le domaine des équipements électriques basse tension et bénéficie d'une part de marché très élevée, en particulier sur les marchés à faible croissance comme l'Italie et la France. Nous privilégions Legrand pour sa présence internationale, qui devrait selon nous se développer au fil du temps, en particulier aux États-Unis et sur les marchés émergents. Waste Connections est une société nord-américaine de services intégrés de traitement des déchets qui fournit des services de collecte, de transfert, d'élimination et de recyclage des déchets. Elle jouit d'une position de leader sur le marché américain et possède la meilleure performance à long terme parmi ses pairs. La société dispose également d'une stratégie opérationnelle solide ciblant les communautés des banlieues et les communautés rurales plutôt que les villes, ce qui lui confère un pouvoir de négociation accru ainsi que des avantages en termes d'échelle et de coûts. Les ventes comprenaient Amazon, Adobe et Tryg.

Les nouvelles participations dans le portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Equity Income Fund comprenaient AbbVie, PNC et SMC. AbbVie recherche et développe des produits pharmaceutiques. La société peut se targuer d'une forte croissance de ses nouveaux produits, grâce à deux médicaments de premier plan : Skyrizi, un médicament contre le psoriasis, et Rinvoq, contre les inflammations. AbbVie occupe également une position dominante sur le marché de l'esthétique, offrant un autre moteur de croissance et de diversification. PNC est une entreprise de services financiers diversifiée et bien gérée, avec une présence forte et croissante aux États-Unis. La société bénéficie de sa large gamme de produits, de sa technologie robuste et de sa réputation de longue date. L'action offre également un rendement de dividende élevé. SMC est le plus grand fabricant d'équipements pneumatiques au monde. La demande pour ses produits augmente, en particulier dans le secteur de l'automatisation. SMC bénéficie également d'une grande position sur le marché, d'une large gamme de produits, d'une distribution étendue et de délais d'exécution rapides. Les ventes comprennent Valero Energy, car nous voulions réduire notre exposition cyclique. Nous avons également liquidé Crown Castle, car nous pensons qu'il sera difficile pour la société de maintenir sa croissance des dividendes dans un environnement plus inflationniste. Parmi les autres ventes figurent Disco Corporation et Manulife Financial.

Au sein du portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies Fund, nous avons ouvert de nouvelles positions sur Nemetschek et Rémy Cointreau. Nemetschek est un leader mondial du marché dans plusieurs régions et segments du secteur de la construction. La société bénéficie d'une base de revenus bien diversifiée, d'une équipe de direction solide et expérimentée et d'une position de marché bien établie. Nous privilégions également Nemetschek pour son leadership sur le plan de l'innovation. Rémy Cointreau produit et distribue des vins et spiritueux haut de gamme dans le monde entier. L'excellent portefeuille de marques de Rémy Cointreau lui confère un avantage concurrentiel et un fort pouvoir de fixation des prix. Nous pensons que la société est bien positionnée pour bénéficier de l'évolution des préférences des consommateurs vers les marques haut de gamme. Nous avons également ouvert une position sur Acushnet, une société qui produit et distribue des articles de golf. Acushnet devrait bénéficier d'une augmentation de la demande de balles de golf, et affiche un carnet de commandes satisfaisant, des stocks réduits et des niveaux de production qui augmentent progressivement. Nous avons vendu Evoqua Water Technologies avec bénéfice après que la société a reçu une offre de rachat moyennant une prime de Xylem. Parmi les autres ventes figurent Ritchie Bros Auctioneers et Inter Parfums.

Rapport du Conseil d'administration

(suite)

Au sein du portefeuille Threadneedle (Lux) - UK Equities Fund, les nouvelles participations incluaient SSE, Ashtead et Spectris. SSE est l'un des principaux développeurs et exploitants d'énergies renouvelables et d'infrastructures à faibles émissions de carbone pour le secteur du transport et de la distribution d'électricité. L'entreprise exploite un portefeuille équilibré d'actifs comprenant des réseaux électriques, ainsi que des énergies renouvelables, ce qui lui permet d'obtenir de bons résultats dans des conditions de marché volatiles. L'entreprise de location d'équipements Ashtead s'est cotée à une valorisation attrayante ; la société possède également de solides fondamentaux et bénéficie d'une croissance du chiffre d'affaires, renforcée par des acquisitions complémentaires. Nous avons rouvert une position sur Spectris (après avoir vendu l'action avec bénéfice fin 2021) après que la société a vendu sa division Omega à un prix supérieur aux attentes. L'activité restante de la société est d'excellente qualité, avec un bilan net de trésorerie. Nous avons également ouvert une position sur la société de logiciels Aveva au début de la période. Les actions ont ensuite bondi après une offre de Schneider Electric, après quoi nous avons vendu l'action en réalisant une plus-value. Parmi les autres ventes figurent Smiths Group, Imperial Brands, BAE et Hunting.

Au sein du portefeuille Threadneedle (Lux) - UK Equity Income Fund, nous avons ouvert des positions sur Smith & Nephew, Hikma Pharmaceuticals et Travis Perkins. Les actions du fabricant de dispositifs médicaux Smith & Nephew ont été sous-évaluées par rapport à ses pairs et à la valeur potentielle de ses divisions globales. Avec le lancement de nouveaux produits, nous sommes optimistes quant aux perspectives à moyen et long terme de la société. Hikma est le principal acteur des segments des injectables et des produits de marque, qui ont des barrières à l'entrée importantes et un fort potentiel de croissance, tout en offrant de bons rendements. La société s'intéresse également à des domaines tels que l'industrie pharmaceutique spécialisée, la fabrication sous licence et les médicaments biosimilaires. Le distributeur de matériaux de construction Travis Perkins dispose d'un bilan solide et n'a pas de dette financière. Le rendement de dividende est attrayant et amorti par une couverture des bénéfices confortable. Nous avons liquidé JD Wetherspoon en raison de préoccupations concernant le bilan de la société et l'indépendance des administrateurs. Nous avons également vendu United Utilities pour financer une nouvelle position sur SSE, un important développeur et exploitant d'énergies renouvelables et d'infrastructures à faible émission de carbone.

Au sein des portefeuilles Threadneedle (Lux) - American Fund et Threadneedle (Lux) - American Select Fund, les nouvelles participations comprenaient Intuitive Surgical et Procter & Gamble. Intuitive Surgical fabrique des équipements robotiques pour la chirurgie mini-invasive et offre une opportunité plus intéressante par rapport à ses pairs à grande capitalisation dans la catégorie des dispositifs médicaux en raison de l'énorme potentiel marché de la société dans le domaine de la chirurgie des tissus mous. Procter & Gamble offre un profil de bénéfices défensif à court terme et a historiquement été l'un des principaux pourvoyeurs de bénéfices de sa catégorie. L'amélioration du profil de croissance de la société permet d'obtenir un effet de levier opérationnel renforcé, ce qui devrait soutenir la croissance des bénéfices ainsi que le potentiel de rendement des actionnaires si les coûts transitoires et les difficultés liées au change s'atténuent. Parmi les ventes figurent CVS Health, Cisco Systems et Mirati Therapeutics.

Au sein du portefeuille Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies Fund, les nouvelles positions comprenaient Applied Industrial Technologies, Cable One et Stanley Black & Decker. Applied Industrial Technologies est un distributeur industriel axé sur les technologies de mouvement et d'automatisation. La société a une opportunité significative d'accroître son chiffre d'affaires, ses marges et ses flux de trésorerie disponibles en raison de ses gains de parts de marché continus, de son efficacité opérationnelle et de la tendance à la relocalisation de la fabrication. Cable One s'est démarquée de ses homologues à grande capitalisation en se concentrant principalement sur la fourniture de haut débit dans les zones rurales et en réduisant son intérêt pour la vidéo/télévision par câble. La société possède également de solides références en matière d'investissement responsable. Stanley Black & Decker a déployé d'importants efforts pour alléger son portefeuille ces dernières années et se concentrer sur les outils électriques et les fixations, ainsi que sur les marques bien connues et bénéficiant d'un bon soutien au niveau des détaillants. La société possède également de solides références en matière d'investissement responsable, notamment une stratégie et des informations bien définies. Parmi les ventes figurent Lamb Weston, Natus Medical et EVO Payments.

Les perspectives d'avenir montrent que l'inflation semble déjà avoir dépassé son pic aux États-Unis. Les prix récents du marché pour les baisses des taux d'intérêt aux États-Unis plus tard cette année semblent justifiés, et nous pensons qu'il est possible que de nouvelles réductions soient actualisées. Les risques à cet égard incluent la poursuite du resserrement du marché du travail aux États-Unis. Si la croissance des salaires ne ralentit pas de manière significative, la Fed pourrait continuer à relever les taux. En Europe et au Royaume-Uni, la baisse des prix de l'énergie se traduit par une plus grande confiance des consommateurs, ce qui devrait entraîner un regain de confiance des entreprises. Les économies réalisées au cours de la pandémie n'ont pas été mobilisées dans la même mesure qu'aux États-Unis, ce qui améliore encore la solidité relative des consommateurs britanniques et européens. Si l'inflation continue de ralentir et que l'attention portée aux hausses de taux diminue, les perspectives économiques des deux régions devraient continuer à s'améliorer en 2023.

À l'échelle mondiale, la politique chinoise « zéro Covid » a été un obstacle persistant en 2022. Avec l'abandon de cette politique, les problèmes de la chaîne d'approvisionnement qui ont été une source clé d'inflation et de compression des marges dans le monde entier devraient continuer à s'atténuer. L'assouplissement des restrictions devrait également stimuler les bénéfices des entreprises dans le monde. Certaines sociétés en Asie et en Europe sont susceptibles d'être les plus grands bénéficiaires compte tenu de la forte demande chinoise en semi-conducteurs et produits de luxe.

Un flux régulier de données économiques plus réjouissantes semble confirmer un « atterrissage en douceur » aux États-Unis, dans la zone euro et au Royaume-Uni, ce qui implique une contraction des bénéfices plus légère que ce que l'on craignait précédemment. Des récessions dans les grandes économies restent possibles cette année, avec des risques de baisse découlant du risque que l'inflation des salaires maintienne les banques centrales trop fermes. Les risques à la hausse comprennent la possibilité que le resserrement monétaire antérieur et la baisse des prix de l'énergie, respectivement, aient un effet plus important sur la baisse de l'inflation et l'augmentation de la confiance des consommateurs que ce qui est actuellement envisagé.

Dans l'ensemble, nous estimons qu'il existe encore de la valeur dans certains actifs à risque, en particulier les actions et obligations de sociétés dont les flux de trésorerie sont relativement défensifs.

Le Conseil d'administration

20 juin 2023

Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs. La valeur des investissements et des revenus qu'ils génèrent peut évoluer à la hausse comme à la baisse.

Performance

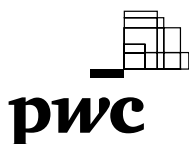
Performance des Portefeuilles de Threadneedle (Lux) pour l'exercice clos le 31 mars 2023 :

Portefeuille	Rendement sur 1 an*	
	Classe d'actions principale	
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	ZU	-5,74 %
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	ZE	-8,14 %
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	ZE	-5,56 %
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	ZE	-0,21 %
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	ZE	-8,95 %
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	-7,58 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AU	-3,29 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	ZU	-5,90 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AU	-2,67 %
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	ZU	-2,81 %
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	ZU	-4,76 %
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	AE	-6,30 %
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AU	-7,20 %
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	ZU	-4,27 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	ZE	-13,54 %
Threadneedle (Lux) - Global Focus	ZU	-8,44 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	ZU	-14,13 %
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	ZU	-3,61 %
Threadneedle (Lux) - Global Select	ZU	-11,01 %
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	ZE	-6,61 %
Threadneedle (Lux) - American	ZU	-9,38 %
Threadneedle (Lux) - American Select	ZU	-11,98 %
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	ZU	-8,02 %
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	ZU	-11,33 %
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	ZU	-14,36 %
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	ZU	-9,62 %
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	ZU	-7,20 %
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	AE	0,00 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	ZE	3,57 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	ZE	-12,46 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	ZE	-10,49 %
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	2,27 %
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	ZE	-5,25 %
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	ZUP	-10,29 %
Threadneedle (Lux) - Global Technology	ZU	-10,94 %
Threadneedle (Lux) - UK Equities	ZG	6,01 %
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	ZG	4,10 %
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity**	ZU	-5,05 %
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	ZU	-1,58 %
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	ZE	-4,52 %
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	ZE	-5,23 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	ZE	2,20 %
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	ZU	-14,12 %
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	ZU	-11,74 %
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	ZU	-10,07 %

Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

* La performance porte sur un exercice ou depuis la date de lancement pour les Classes d'actions lancées au cours de l'exercice.

**Voir annexe 1.



Rapport des Commissaires aux comptes indépendants

À l'attention des Actionnaires de
Threadneedle (Lux)

Notre avis

À notre avis, les comptes ci-joints donnent une image sincère et authentique de la situation financière de Threadneedle (Lux) (le « Fonds ») et de chacun de ses portefeuilles au 31 mars 2023 et des résultats de leurs opérations et des variations de leur actif net pour l'exercice clos à cette date, conformément aux dispositions légales et réglementaires en vigueur au Luxembourg en matière de préparation et de présentation des comptes.

Portée de notre audit

Les comptes du Fonds comprennent :

- l'état du portefeuille au 31 mars 2023 ;
- l'état consolidé des opérations et de la variation de l'actif net pour le Fonds et l'état des opérations et des variations de l'actif net pour chacun des portefeuilles pour l'exercice clos à cette date ; et
- l'état du portefeuille au 31 mars 2023 ; et
- les annexes aux comptes, qui incluent un résumé des principaux principes comptables.

Base de notre opinion

Nous avons effectué notre audit selon la Loi du 23 juillet 2016 relative à la profession de l'audit (Loi du 23 juillet 2016) et les Normes Internationales d'Audit (ISA) telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). Nos responsabilités en vertu de la Loi du 23 juillet 2016 et des ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF sont décrites plus en détail à la section « Responsabilités du réviseur d'entreprises agréé à l'égard de l'audit des comptes » de notre rapport.

Nous estimons que les éléments probants recueillis sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

Nous sommes indépendants du Fonds conformément au Code international de déontologie des professionnels comptables, incluant les Normes internationales d'indépendance, publié par l'International Ethics Standards Board for Accountants (Code IESBA) et tel qu'adopté pour le Luxembourg par la CSSF, et conformément aux obligations en matière de déontologie qui se rapportent à notre audit des comptes. Nous avons rempli nos autres responsabilités déontologiques en vertu de ces obligations.

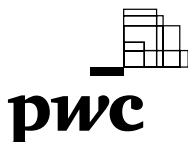
Autres informations

Le Conseil d'administration est responsable des autres informations. Celles-ci couvrent les informations présentées dans le rapport annuel, mais n'intègrent pas les comptes et notre rapport y afférent.

Notre opinion sur les comptes ne couvre pas les autres informations et nous n'exprimons aucune forme de conclusion d'assurance à leur égard.

*PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2 rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxembourg
T : +352 494848 1, F : +352 494848 2900, www.pwc.lu*

*Cabinet de révision agréé. Expert-comptable (autorisation gouvernementale n° 10028256)
R.C.S. Luxembourg B 65 477 - TVA LU25482518*



Dans le cadre de notre audit des comptes, notre responsabilité consiste à parcourir les autres informations identifiées ci-devant et, ce faisant, à considérer si les autres informations comportent des incohérences importantes avec les comptes ou nos connaissances obtenues lors de l'audit ou semblent significativement inexactes de toute autre manière. Si, sur la base de nos travaux, nous concluons à l'existence d'une inexactitude importante de ces autres informations, nous sommes tenus de le signaler. Nous n'avons rien à rapporter à cet égard.

Responsabilités du Conseil d'administration pour les comptes

Le Conseil d'administration est responsable de l'établissement et de la présentation sincère des comptes, conformément aux prescriptions légales et réglementaires relatives à l'établissement et à la présentation des comptes en vigueur au Luxembourg, ainsi que du contrôle interne que le Conseil d'administration juge nécessaire à la préparation des comptes qui ne comportent pas d'anomalies significatives, liées à des fraudes ou à d'autres erreurs.

Dans le cadre de la préparation des comptes, le Conseil d'administration est chargé d'évaluer la capacité du Fonds à poursuivre ses activités, de communiquer, le cas échéant, les points relatifs à la continuité des activités et d'utiliser la règle comptable de la continuité des activités à moins que le Conseil d'administration n'ait l'intention, ou n'ait pas d'autre alternative réaliste, que de liquider le Fonds, de fermer l'un de ses portefeuilles ou encore de cesser les activités.

Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé pour l'audit des comptes

Les objectifs de notre audit sont d'obtenir une assurance raisonnable que les comptes dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, et de publier un rapport d'audit qui inclut notre opinion. L'assurance raisonnable correspond à un niveau d'assurance élevé, mais ne garantit pas qu'un audit mené dans le respect de la Loi du 23 juillet 2016 et des ISA, telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, permettra de détecter systématiquement une éventuelle anomalie significative. Des anomalies peuvent résulter de fraudes ou d'erreurs et sont jugées significatives si, individuellement ou cumulées, on pourrait raisonnablement s'attendre à ce qu'elles influencent les décisions économiques prises sur la base des présents comptes.

Dans le cadre d'un audit conduit conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux ISA, telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, nous faisons preuve d'une appréciation professionnelle et conservons un scepticisme professionnel tout au long de l'audit. Par ailleurs, nous :

- identifions et évaluons les risques d'anomalies significatives des comptes, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, élaborons et appliquons des procédures d'audit en réponse à ces risques et recueillons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion. Le risque de non-détection d'une anomalie significative résultant d'une fraude est plus élevé que pour une anomalie découlant d'une erreur, car la fraude peut impliquer une collusion, des faux, des omissions délibérées, de fausses déclarations ou le contournement du contrôle interne ;
- prenons connaissance du contrôle interne en rapport avec l'audit afin de définir des procédures d'audit appropriées en la circonstance, et non dans le but d'exprimer une opinion sur le fonctionnement efficace du contrôle interne du Fonds ;
- apprécions le caractère approprié des principes comptables retenus et le caractère raisonnable des estimations comptables faites et des informations communiquées par le Conseil d'administration ;



- émettons des conclusions sur le caractère approprié de l'utilisation par le Conseil d'administration de la règle comptable de la continuité des activités et, sur la base des éléments probants recueillis, sur l'existence ou non d'une incertitude significative relative à des événements ou conditions susceptibles de jeter un sérieux doute sur la capacité du Fonds ou de l'un de ses portefeuilles à poursuivre ses activités. Si nous concluons qu'une incertitude significative existe, nous sommes tenus d'attirer l'attention dans notre rapport d'audit sur les informations à cet effet figurant dans les comptes ou, si de telles informations sont inadaptées, de modifier notre opinion. Nos conclusions se fondent sur les éléments probants recueillis jusqu'à la date de notre rapport d'audit. Toutefois, des événements ou conditions futurs pourraient avoir pour effet que le Fonds ou l'un de ses portefeuilles (à l'exception des Portefeuilles Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return, Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities et Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha, pour lesquels une décision de liquidation existe) cesse ses activités ;
- évaluons la présentation générale, la structure et le contenu des comptes, y compris les publications, et si les comptes reflètent une présentation sincère des opérations sous-jacentes et des événements.

Nous échangeons avec les personnes en charge de la gouvernance eu égard, notamment, au périmètre et calendrier planifiés de l'audit et les découvertes importantes lors de l'audit, y compris toute déficience importante dans le contrôle interne que nous avons identifiée lors de notre audit.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Représentée par

Luxembourg, le 21 juin 2023

Serene Shtayyeh

Comptes consolidés pour Threadneedle (Lux)

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2, 18	16.556.964.184
Avoirs en banque et liquidités	2	179.121.736
Dépôts à terme	2, 19	14.974.756
À recevoir sur ventes de titres		55.870.265
À recevoir sur souscriptions		15.613.347
Intérêts à recevoir sur swaps	2	7.298.009
Dividendes à recevoir sur swaps	2	206.059
Intérêts et dividendes nets à recevoir		46.016.138
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	15.232.547
Plus-value nette latente sur swaps	2, 10	3.092.456
Plus-value nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	410.364
Autres actifs	20	18.554.447
Total de l'actif		16.913.354.308
Passifs		
Découverts bancaires		(45)
Options (position courte) à la valeur de marché	2, 12	(377.061)
À payer sur achats de titres		(61.428.459)
À payer sur rachats		(20.430.368)
Intérêts payables sur swaps	2	(2.695.192)
Dividendes payables sur swaps	2	(391.625)
Versement initial reçu sur swaps	2	(57.508)
(Moins-value) nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	(1.868.149)
(Moins-value) nette latente sur swaps	2, 10	(8.496.516)
(Moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	(10.099.036)
Commissions de gestion à payer	5	(14.232.573)
Impôts à payer	3	(25.824)
Autres passifs		(2.504.147)
Total du passif		(122.606.503)
Total de l'actif net		16.790.747.805

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		20.624.583.517
Revenus		
Dividendes, nets	2	202.616.366
Intérêts sur obligations, nets	2	104.565.914
Intérêts bancaires	2	3.691.072
Produits de dividendes sur swaps		700
Produits d'intérêt sur swaps		11.160.168
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		745.046
Autres revenus		1.446.413
Total des revenus		324.225.679
Charges		
Commissions de gestion	5	(170.403.469)
Intérêts bancaires	2	(744.885)
Charges de dividendes sur swaps		(2.065.012)
Charges d'intérêt sur swaps		(28.319.317)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(707.995)
Charges d'exploitation	3, 5	(31.043.025)
Frais divers	4	(1.752)
Total des charges		(233.285.455)
Revenu net sur investissements		90.940.224
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(456.297.502)
(Moins-value) nette réalisée sur swaps		(20.930.559)
Plus-value nette réalisée sur options		365.179
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(49.452.671)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		93.828.629
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(9.977.161)
(Moins-value) nette réalisée sur restitution d'impôt		(68)
(Moins-value) nette réalisée		(442.464.153)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(1.129.292.925)
Variation de la plus-value nette latente sur swaps		1.286.803
Variation de la plus-value nette latente sur options		24.932
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(9.946.578)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(35.560.181)
Variation nette de la (moins-value) latente		(1.173.487.949)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(1.525.011.878)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		4.757.553.155
Rachats d'actions		(6.729.787.549)
Dividendes	7	(51.678.952)
Total de l'évolution du capital		(2.023.913.346)
Écarts de change	2	(307.250.585)
Variation des investissements croisés dans les Portefeuilles	18	22.340.097
Actif net à la fin de l'exercice		16.790.747.805

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	795.139.447
Avoirs en banque et liquidités	2	17.657.236
À recevoir sur ventes de titres		28.189.947
À recevoir sur souscriptions		1.422.255
Intérêts à recevoir sur swaps	2	108.086
Intérêts et dividendes nets à recevoir		7.131.944
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	4.390.217
Total de l'actif		854.039.132
Passifs		
À payer sur achats de titres		(17.649.418)
À payer sur rachats		(1.139.392)
Intérêts payables sur swaps	2	(125.440)
(Moins-value) nette latente sur swaps	2, 10	(39.609)
(Moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	(709.109)
Commissions de gestion à payer	5	(180.908)
Autres passifs		(69.951)
Total du passif		(19.913.827)
Total de l'actif net		834.125.305

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEC	1.582.554,099
Classe AEH	1.232.059,977
Classe AKH	70,000
Classe ANH	788,000
Classe AU	850.426,238
Classe AUP	119.079,612
Classe DEC	84.212,698
Classe DEH	221.583,196
Classe DU	195.901,800
Classe DUP	54.784,490
Classe IEC	9.947.624,918
Classe IEH	1.820.155,984
Classe IEP	74,000
Classe IGC	616,000
Classe IGH	1.390.517,542
Classe IKH	80.378,000
Classe INH	785,000
Classe IU	137.275,508
Classe IUP	278.252,656
Classe NEC	458.377,092
Classe NEH	115.600,495
Classe NGC	37.860.342,347
Classe NGH	2.569.628,591
Classe NU	1.760.849,599
Classe NUP	115.563,000
Classe XEH	84,000
Classe XFH	92,000
Classe XGH	9.880.474,395
Classe XU	100,000
Classe ZEH	4.267.530,750
Classe ZFH	93,000
Classe ZGH	47.023,907
Classe ZU	619.444,588

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		512.857.786
Revenus		
Dividendes, nets	2	412.859
Intérêts sur obligations, nets	2	17.816.180
Intérêts bancaires	2	453.223
Produits d'intérêt sur swaps		2.439.164
Autres revenus		15
Total des revenus		21.121.441
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.711.049)
Intérêts bancaires	2	(95.962)
Charges d'intérêt sur swaps		(2.677.206)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(230.322)
Charges d'exploitation	3, 5	(746.019)
Frais divers	4	(103)
Total des charges		(5.460.661)
Revenu net sur investissements		15.660.780
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(46.351.334)
(Moins-value) nette réalisée sur swaps		(154.422)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(4.550.629)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		7.938.224
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(6.318.855)
(Moins-value) nette réalisée		(49.437.016)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(9.766.807)
Variation de la plus-value nette latente sur swaps		1.447.518
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(2.781.504)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(2.383.300)
Variation nette de la (moins-value) latente		(13.484.093)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(47.260.329)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		519.839.894
Rachats d'actions		(139.300.262)
Dividendes	7	(12.011.784)
Total de l'évolution du capital		368.527.848
Actif net à la fin de l'exercice		834.125.305

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	834.125.305	512.857.786	505.611.566

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEC	8,7274 ¹	9,8883 ¹	10,7710 ¹
Classe AEH	10,3414 ¹	11,3032 ¹	12,0116 ¹
Classe AKH	104,4023 ²	113,5556 ²	120,4075 ²
Classe ANH	9,3808 ³	10,1321 ³	10,6766 ³
Classe AU	12,0789	12,8471	13,5238
Classe AUP	10,2933	11,3413	12,2255
Classe DEC	7,8703 ¹	8,9807 ¹	9,8546 ¹
Classe DEH	9,7853 ¹	10,7729 ¹	11,5352 ¹
Classe DU	10,4059	11,1512	11,8269
Classe DUP	9,0388	10,0429	10,9155
Classe IEC	8,6087 ¹	9,7281 ¹	10,5732 ¹
Classe IEH	10,6546 ¹	11,6146 ¹	12,3172 ¹
Classe IEP	10,3441 ¹	11,0997 ¹	11,3003 ¹
Classe IGC	8,9969 ⁴	10,0201 ⁴	10,8060 ⁴
Classe IGH	11,5557 ⁴	12,4075 ⁴	13,0594 ⁴
Classe IKH	107,4977 ²	116,6619 ²	123,3018 ²
Classe INH	9,4739 ³	10,2127 ³	10,7232 ³
Classe IU	12,4379	13,1938	13,8609
Classe IUP	9,5805	10,5391	11,3406
Classe NEC	8,6991 ¹	9,8160 ¹	10,6452 ¹
Classe NEH	9,7048 ¹	10,5687 ¹	11,1857 ¹
Classe NGC	8,8347 ⁴	9,8219 ⁴	10,5683 ⁴
Classe NGH	10,2097 ⁴	10,9467 ⁴	11,4987 ⁴
Classe NU	10,8438	11,4874	12,0441
Classe NUP	9,6764	10,6244	11,4076
Classe XEH	8,5918 ¹	9,3311 ¹	9,8476 ¹
Classe XFH	8,4935 ⁵	9,2943 ⁵	9,8342 ⁵
Classe XGH	10,1116 ⁴	10,8105 ⁴	11,3216 ⁴
Classe XU	8,9631	9,4664	9,8938
Classe ZEH	9,7722 ¹	10,6577 ¹	11,2951 ¹
Classe ZFH	8,3827 ⁵	9,2148 ⁵	9,8121 ⁵
Classe ZGH	11,5218 ⁴	12,3692 ⁴	13,0122 ⁴
Classe ZU	12,4147	13,1713	13,8304

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁴La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁵La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	78.612.807
Avoirs en banque et liquidités	2	1.170.316
À recevoir sur ventes de titres		308.798
À recevoir sur souscriptions		8.597
Intérêts à recevoir sur swaps	2	11.207
Intérêts et dividendes nets à recevoir		751.199
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	82.484
Autres actifs		14.479
Total de l'actif		80.959.887
Passifs		
À payer sur achats de titres		(584.734)
À payer sur rachats		(1)
Intérêts payables sur swaps	2	(18.084)
(Moins-value) nette latente sur swaps	2, 10	(90.403)
(Moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	(105.274)
Commissions de gestion à payer	5	(21.310)
Autres passifs		(6.678)
Total du passif		(826.484)
Total de l'actif net		80.133.403

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	97.083,650
Classe ANH	825,000
Classe IE	1.129.373,041
Classe IEP	535.456,801
Classe INH	817,000
Classe XE	84,000
Classe XFH	92,000
Classe XGH	72,000
Classe XUH	100,000
Classe ZE	10.456,091
Classe ZFH	92,000
Classe 1E	6.012.518,163
Classe 1G	132.220,412
Classe 2E	2.138.298,351
Classe 2G	69,000
Classe 3G	478.605,918
Classe 4E	3.444,353
Classe 4G	3.089.310,148
Classe 8E	361.321,298
Classe 8G	139.623,318
Classe 9G	70,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		127.675.204
Revenus		
Intérêts sur obligations, nets	2	1.733.528
Intérêts bancaires	2	5.206
Produits d'intérêt sur swaps		122.573
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		9.203
Autres revenus		13
Total des revenus		1.870.523
Charges		
Commissions de gestion	5	(296.214)
Intérêts bancaires	2	(9.074)
Charges d'intérêt sur swaps		(325.287)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(5.189)
Charges d'exploitation	3, 5	(102.792)
Total des charges		(738.556)
Revenu net sur investissements		1.131.967
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(9.759.473)
(Moins-value) nette réalisée sur swaps		(128.819)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(824.394)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		2.003.336
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		161.503
(Moins-value) nette réalisée		(8.547.847)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(1.730.303)
Variation de la plus-value nette latente sur swaps		264.444
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		162.407
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(879.367)
Variation nette de la (moins-value) latente		(2.182.819)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(9.598.699)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		15.241.844
Rachats d'actions		(53.159.234)
Dividendes	7	(25.712)
Total de l'évolution du capital		(37.943.102)
Actif net à la fin de l'exercice		80.133.403

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	80.133.403	127.675.204	157.999.564

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	9,2779	10,1243	10,7975
Classe ANH	9,1104 ¹	9,8409 ¹	10,4217 ¹
Classe IE	9,5112	10,3374	10,9588
Classe IEP	8,3544	9,2711	–
Classe INH	9,2841 ¹	9,9943 ¹	10,5063 ¹
Classe XE	8,8344	9,5748	10,1073
Classe XFH	8,7183 ²	9,5292 ²	10,0938 ²
Classe XGH	9,0433 ³	9,6585 ³	10,1315 ³
Classe XUH	9,1567 ⁴	9,6777 ⁴	10,1441 ⁴
Classe ZE	9,4441	10,2805	10,9309
Classe ZFH	8,5999 ²	9,4512 ²	10,0801 ²
Classe 1E	1,2624	1,3811	1,4728
Classe 1G	1,0210 ³	1,0743 ³	1,1548 ³
Classe 2E	9,5174	10,3490	10,9688
Classe 2G	9,2882 ³	9,7243 ³	10,3939 ³
Classe 3G	1,1557 ³	1,2099 ³	1,2941 ³
Classe 4E	9,6587	10,4502	11,0208
Classe 4G	9,7717 ³	10,1679 ³	10,8094 ³
Classe 8E	1,5938	1,7338	1,8383
Classe 8G	1,4020 ³	1,4667 ³	1,5677 ³
Classe 9G	9,2626 ³	9,7021 ³	10,3783 ³

¹La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

⁴La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	394.430.856
Avoirs en banque et liquidités	2	5.261.324
À recevoir sur ventes de titres		1.198.431
À recevoir sur souscriptions		73.785
Intérêts et dividendes nets à recevoir		5.669.608
Total de l'actif		406.634.004
Passifs		
À payer sur achats de titres		(2.538.738)
À payer sur rachats		(435.842)
(Moins-value) nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	(481.773)
(Moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	(80.768)
Commissions de gestion à payer	5	(279.988)
Autres passifs		(48.234)
Total du passif		(3.865.343)
Total de l'actif net		402.768.661

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	342,253
Classe AKH	81,000
Classe ANH	807,000
Classe IE	5.849.877,990
Classe IEP	6.024.823,785
Classe IKH	80,000
Classe INH	798,000
Classe XE	77,000
Classe ZE	39.985,677
Classe ZEP	120.094,000
Classe 1E	12.090.868,369
Classe 1EP	1.046.935,471
Classe 1G	234.473,801
Classe 1GP	3.374,897
Classe 1UT	119.164,536
Classe 2E	30.299,719
Classe 2EP	2.884,000
Classe 2FH	6.834,346
Classe 2G	68,000
Classe 2GP	75,000
Classe 3E	2.912.931,952
Classe 3EP	1.845.688,854
Classe 3FC	6.523,913
Classe 3FH	27.927,294
Classe 3G	737.641,440
Classe 3GP	58.701,986
Classe 4E	299,277
Classe 4G	65,000
Classe 8E	1.894.692,429
Classe 8EP	5.555.524,634
Classe 8FH	32.415,940
Classe 8G	9.193,774
Classe 8GP	5.021,867
Classe 9E	3.471.833,446
Classe 9EP	7.573,873
Classe 9FC	92,741
Classe 9FH	83,000
Classe 9G	67,000
Classe 9GP	75,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		437.563.292
Revenus		
Dividendes, nets	2	43.405
Intérêts sur obligations, nets	2	15.324.515
Intérêts bancaires	2	18.018
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		6.765
Autres revenus		584
Total des revenus		15.393.287
Charges		
Commissions de gestion	5	(3.164.958)
Intérêts bancaires	2	(14.800)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(3.292)
Charges d'exploitation	3, 5	(573.329)
Total des charges		(3.756.379)
Revenu net sur investissements		11.636.908
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(17.251.364)
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		2.810.337
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		388.516
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(492.964)
(Moins-value) nette réalisée		(14.545.475)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(20.642.556)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(1.702.941)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(174.313)
Variation nette de la (moins-value) latente		(22.519.810)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(25.428.377)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		97.023.824
Rachats d'actions		(101.198.233)
Dividendes	7	(5.191.845)
Total de l'évolution du capital		(9.366.254)
Actif net à la fin de l'exercice		402.768.661

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	402.768.661	437.563.292	601.800.632

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	10,1138	10,7825	11,2181
Classe AKH	95,0769 ¹	101,0117 ¹	104,9357 ¹
Classe ANH	9,6834 ²	10,2186 ²	10,5488 ²
Classe IE	10,2265	10,8198	11,1683
Classe IEP	8,4447	9,3088	9,9899
Classe IKH	97,5060 ¹	102,8317 ¹	105,8588 ¹
Classe INH	9,9336 ²	10,4003 ²	10,6479 ²
Classe XE	10,0295	10,5517	10,8140
Classe ZE	10,1957	10,7962	11,1495
Classe ZEP	8,4197	9,2891	9,9735
Classe 1E	9,9677	10,6162	11,0164
Classe 1EP	8,2294	9,1329	9,8573
Classe 1G	9,7341 ³	9,9707 ³	10,4297 ³
Classe 1GP	8,0597 ³	8,6028 ³	9,3569 ³
Classe 1UT	9,0587 ⁴	9,8080 ⁴	10,4752 ⁴
Classe 2E	10,2262	10,8306	11,1761
Classe 2EP	8,4747	9,3488	10,0267
Classe 2FH	10,0034 ⁵	10,6851 ⁵	11,0615 ⁵
Classe 2G	9,9771 ³	10,1723 ³	10,5872 ³
Classe 2GP	8,2855 ³	8,7869 ³	9,4995 ³
Classe 3E	10,2522	10,8528	11,1933
Classe 3EP	8,5292	9,4075	10,0878
Classe 3FC	8,3106 ⁵	9,2459 ⁵	9,9302 ⁵
Classe 3FH	10,0264 ⁵	10,7045 ⁵	11,0760 ⁵
Classe 3G	10,0112 ³	10,1921 ³	10,5964 ³
Classe 3GP	8,2268 ³	8,7267 ³	9,4331 ³
Classe 4E	10,5853	11,1273	11,3964
Classe 4G	10,5718 ³	10,6900 ³	11,0365 ³
Classe 8E	10,2071	10,8147	11,1642
Classe 8EP	8,4670	9,3469	10,0322
Classe 8FH	9,9839 ⁵	10,6685 ⁵	11,0486 ⁵
Classe 8G	9,9700 ³	10,1593 ³	10,5718 ³
Classe 8GP	8,2518 ³	8,7611 ³	9,4964 ³
Classe 9E	10,2702	10,8653	11,2018
Classe 9EP	8,5477	9,4214	10,0992
Classe 9FC	8,4020 ⁵	9,3284 ⁵	10,0032 ⁵
Classe 9FH	10,0637 ⁵	10,7239 ⁵	11,0918 ⁵
Classe 9G	10,0498 ³	10,2232 ³	10,6161 ³
Classe 9GP	8,3237 ³	8,8161 ³	9,5122 ³

¹La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

⁴La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

⁵La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	66.936.251
Avoirs en banque et liquidités	2	2.416.289
À recevoir sur ventes de titres		5.388
Intérêts et dividendes nets à recevoir		810.769
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	34.475
Autres actifs		3
Total de l'actif		70.203.175
Passifs		
À payer sur achats de titres		(178.128)
Commissions de gestion à payer	5	(14.019)
Autres passifs		(6.159)
Total du passif		(198.306)
Total de l'actif net		70.004.869

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	1.739,363
Classe AEP	312,510
Classe AKH	82,000
Classe ANH	82,000
Classe IE	316.313,308
Classe IEP	93.668,000
Classe IGC	8,000
Classe IGH	7,000
Classe IKH	82,000
Classe INH	816,000
Classe XE	378,910
Classe XGC	50.662,801
Classe XGH	187.795,591
Classe ZE	8,200

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	101,8726	102,3925	103,3869
Classe AEP	88,7739	92,7591	97,3234
Classe AKH	102,7200 ¹	102,9071 ¹	103,6634 ¹
Classe ANH	105,2758 ²	104,6701 ²	104,8255 ²
Classe IE	103,3939	103,5067	104,0942
Classe IEP	90,1405	93,8051	97,9620
Classe IGC	93,3526 ³	95,6430 ³	99,1215 ³
Classe IGH	106,5129 ³	105,1039 ³	105,0674 ³
Classe IKH	103,6474 ¹	103,4243 ¹	103,8150 ¹
Classe INH	10,5733 ²	10,4750 ²	10,4542 ²
Classe XE	104,9403	104,6355	104,8093
Classe XGC	94,5441 ³	96,4461 ³	99,6631 ³
Classe XGH	108,3422 ³	106,2932 ³	105,8053 ³
Classe ZE	103,1073	103,3293	104,0037

¹La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		108.281.110
Revenus		
Intérêts sur obligations, nets	2	3.319.131
Intérêts bancaires	2	9.946
Produits d'intérêt sur swaps		13.875
Autres revenus		266
Total des revenus		3.343.218
Charges		
Commissions de gestion	5	(106.261)
Intérêts bancaires	2	(11.283)
Charges d'exploitation	3, 5	(86.350)
Total des charges		(203.894)
Revenu net sur investissements		3.139.324
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(2.832.371)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(524.687)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(326.302)
(Moins-value) nette réalisée		(3.683.360)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(1.908.158)
Variation de la (moins-value) nette latente sur swaps		(10.110)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(433.051)
Variation nette de la (moins-value) latente		(2.351.319)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(2.895.355)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		36.495.370
Rachats d'actions		(71.328.517)
Dividendes	7	(547.739)
Total de l'évolution du capital		(35.380.886)
Actif net à la fin de l'exercice		70.004.869

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	70.004.869	108.281.110	87.774.729

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	348.288.199
Avoirs en banque et liquidités	2	4.825.278
À recevoir sur souscriptions		98.135
Intérêts et dividendes nets à recevoir		2.567.109
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	358.560
Total de l'actif		356.137.281
Passifs		
À payer sur rachats		(584.563)
(Moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 9	(700.622)
Commissions de gestion à payer	5	(92.597)
Autres passifs		(35.887)
Total du passif		(1.413.669)
Total de l'actif net		354.723.612

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	1.662.303,414
Classe AEP	45.336,000
Classe AFH	93,000
Classe AKH	86,000
Classe ANH	861,000
Classe ASC	100,000
Classe ASH	100,000
Classe AUC	100,000
Classe AUH	100,000
Classe ID	22.738.015,068
Classe IE	3.798.586,372
Classe IEP	2.541.188,149
Classe IFH	2.709.537,000
Classe IGH	73,000
Classe IKH	85,000
Classe INH	839,000
Classe ISC	100,000
Classe ISH	100,000
Classe IUC	83.135,804
Classe IUH	100,000
Classe LE	3.128.597,916
Classe NEP	111.878,641
Classe ZD	11.948.350,717
Classe ZE	2.657.416,258
Classe ZEP	581.208,140
Classe ZFH	3.489,000
Classe ZGC	5.535.129,078
Classe ZGH	808.400,965
Classe ZUH	1.592,141

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		397.016.310
Revenus		
Intérêts sur obligations, nets	2	5.157.630
Intérêts bancaires	2	16.188
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		68.723
Autres revenus		176
Total des revenus		5.242.717
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.120.123)
Intérêts bancaires	2	(15.165)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(42.821)
Charges d'exploitation	3, 5	(435.254)
Total des charges		(1.613.363)
Revenu net sur investissements		3.629.354
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(19.638.314)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(364.930)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		5.048.821
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(535.930)
(Moins-value) nette réalisée		(15.490.353)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(23.595.761)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(186.030)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(1.330.494)
Variation nette de la (moins-value) latente		(25.112.285)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(36.973.284)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		90.566.773
Rachats d'actions		(93.488.882)
Dividendes	7	(2.397.305)
Total de l'évolution du capital		(5.319.414)
Actif net à la fin de l'exercice		354.723.612

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	354.723.612	397.016.310	329.896.379

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	8,4945	9,3388	9,9729
Classe AEP	8,2347	9,1831	9,9137
Classe AFH	8,4045 ¹	9,3172 ¹	9,9710 ¹
Classe AKH	85,5720 ²	93,6342 ²	99,5278 ²
Classe ANH	8,6990 ³	9,4392 ³	9,9762 ³
Classe ASC	8,4958 ⁴	9,3030 ⁴	9,9703 ⁴
Classe ASH	8,7327 ⁴	9,4156 ⁴	9,9784 ⁴
Classe AUC	8,5577 ⁵	9,3072 ⁵	9,9704 ⁵
Classe AUH	8,7920 ⁵	9,4257 ⁵	9,9792 ⁵
Classe ID	8,6319 ⁶	9,4617 ⁶	10,0874 ⁶
Classe IE	9,1890	10,0871	10,7559
Classe IEP	8,5025	9,4700	10,2088
Classe IFH	8,8540 ¹	9,8039 ¹	10,4909 ¹
Classe IGH	8,7057 ⁷	9,4189 ⁷	9,9775 ⁷
Classe IKH	86,7033 ²	94,8504 ²	100,7592 ²
Classe INH	8,9315 ³	9,6877 ³	10,2330 ³
Classe ISC	8,5268 ⁴	9,3048 ⁴	9,9703 ⁴
Classe ISH	8,7507 ⁴	9,4173 ⁴	9,9784 ⁴
Classe IUC	8,5688 ⁵	9,3112 ⁵	9,9711 ⁵
Classe IUH	8,8069 ⁵	9,4334 ⁵	9,9799 ⁵
Classe LE	9,2177	10,1185	10,7895
Classe NEP	857,1354	954,3554	1028,6742
Classe ZD	8,6148 ⁶	9,4477 ⁶	10,0776 ⁶
Classe ZE	9,1569	10,0568	10,7290
Classe ZEP	8,4565	9,4219	10,1616
Classe ZFH	8,8373 ¹	9,7912 ¹	10,4827 ¹
Classe ZGC	8,9178 ⁷	9,7886 ⁷	10,4934 ⁷
Classe ZGH	9,2550 ⁷	10,0164 ⁷	10,6218 ⁷
Classe ZUH	9,0273 ⁵	9,6718 ⁵	10,2472 ⁵

¹La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

⁴La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

⁵La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

⁶La Classe est libellée en DKK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

⁷La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	128.688.046
Avoirs en banque et liquidités	2	7.809.696
À recevoir sur souscriptions		133.695
Intérêts à recevoir sur swaps	2	57.140
Intérêts et dividendes nets à recevoir		1.566.253
Total de l'actif		138.254.830
Passifs		
À payer sur achats de titres		(335.435)
À payer sur rachats		(282.595)
Intérêts payables sur swaps	2	(79.908)
(Moins-value) nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	(81.880)
(Moins-value) nette latente sur swaps	2, 10	(282.967)
(Moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	(1.030.826)
Commissions de gestion à payer	5	(108.736)
Autres passifs		(20.508)
Total du passif		(2.222.855)
Total de l'actif net		136.031.975

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	1.904.852,642
Classe AEP	762.311,440
Classe AKH	81,000
Classe ANH	802,000
Classe AUH	1.916,000
Classe DE	1.002.501,131
Classe DEP	1.338.522,221
Classe DUH	87,000
Classe IE	1.212.557,303
Classe INH	792,000
Classe ZE	85,000

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	27,7961	30,0762	31,0867
Classe AEP	12,9611	14,5050	15,3978
Classe AKH	95,0129 ¹	102,4839 ¹	105,8567 ¹
Classe ANH	9,7316 ²	10,4094 ²	10,6864 ²
Classe AUH	10,7647 ³	11,3753 ³	11,6784 ³
Classe DE	25,7676	28,0352	29,1371
Classe DEP	9,6172	10,8231	11,5522
Classe DUH	10,4683 ³	11,1164 ³	11,4774 ³
Classe IE	28,4329	30,5812	31,4196
Classe INH	9,9751 ²	10,6102 ²	10,8071 ²
Classe ZE	8,9875	9,6862	-

¹La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		186.513.439
Revenus		
Intérêts sur obligations, nets	2	5.386.424
Intérêts bancaires	2	44.306
Produits d'intérêt sur swaps		720.066
Autres revenus		23
Total des revenus		6.150.819
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.416.880)
Intérêts bancaires	2	(25.921)
Charges d'intérêt sur swaps		(1.880.145)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(37.280)
Charges d'exploitation	3, 5	(299.216)
Frais divers	4	(11)
Total des charges		(3.659.453)
Revenu net sur investissements		2.491.366
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(10.906.882)
(Moins-value) nette réalisée sur swaps		(503.713)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(2.077.747)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		6.842.378
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(81.023)
(Moins-value) nette réalisée		(6.726.987)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(7.276.139)
Variation de la plus-value nette latente sur swaps		1.641.802
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		724.694
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(4.556.742)
Variation nette de la (moins-value) latente		(9.466.385)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(13.702.006)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		43.810.406
Rachats d'actions		(79.772.815)
Dividendes	7	(817.049)
Total de l'évolution du capital		(36.779.458)
Actif net à la fin de l'exercice		136.031.975

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	136.031.975	186.513.439	234.144.701

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	35.435.377
Avoirs en banque et liquidités	2	2.309.582
À recevoir sur souscriptions		125.391
Intérêts et dividendes nets à recevoir		453.160
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	310.224
Total de l'actif		38.633.734
Passifs		
À payer sur rachats		(2.632)
Commissions de gestion à payer	5	(35.259)
Autres passifs		(5.362)
Total du passif		(43.253)
Total de l'actif net		38.590.481

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEC	544.222,112
Classe AEH	244.955,999
Classe AKH	80,000
Classe ANH	792,000
Classe ASH	7.673,293
Classe AU	100.013,506
Classe AUP	706.620,595
Classe DEC	40.726,837
Classe DEH	137.896,034
Classe DU	176.490,195
Classe IEC	258.086,000
Classe IEH	412.310,970
Classe IU	2.093,260
Classe W	6.537,236
Classe WEH	7.298,489
Classe XUP	85,000
Classe ZU	100,000

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEC	10,2032 ¹	11,3376 ¹	12,9505 ¹
Classe AEH	19,3369 ¹	20,5319 ¹	22,5246 ¹
Classe AKH	91,8018 ²	96,8799 ²	105,9916 ²
Classe ANH	9,3874 ³	9,8352 ³	10,6943 ³
Classe ASH	13,2054 ⁴	13,7388 ⁴	14,9331 ⁴
Classe AU	21,1802	21,9017	23,7934
Classe AUP	6,7900	7,3555	8,3207
Classe DEC	7,3807 ¹	8,2123 ¹	9,3896 ¹
Classe DEH	14,8160 ¹	15,7465 ¹	17,2924 ¹
Classe DU	16,4720	17,0502	18,5415
Classe IEC	7,8180 ¹	8,6232 ¹	9,7778 ¹
Classe IEH	27,6949 ¹	29,1681 ¹	31,7423 ¹
Classe IU	10,9376	11,2198	12,0940
Classe W	29,1323	30,0194	32,4983
Classe WEH	19,0279 ¹	20,1302 ¹	22,0058 ¹
Classe XUP	9,7987	10,5075	11,7343
Classe ZU	8,9259	9,1419	–

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁴La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		40.997.023
Revenus		
Dividendes, nets	2	35.790
Intérêts sur obligations, nets	2	1.831.211
Intérêts bancaires	2	56.108
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		994
Autres revenus		7
Total des revenus		1.924.110
Charges		
Commissions de gestion	5	(410.709)
Intérêts bancaires	2	(3.104)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(17)
Charges d'exploitation	3, 5	(73.379)
Frais divers	4	(27)
Total des charges		(487.236)
Revenu net sur investissements		1.436.874
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(1.046.490)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(1.345.800)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		575.768
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		6.632
(Moins-value) nette réalisée		(1.809.890)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(1.896.734)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		4.692
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(192.573)
Variation nette de la (moins-value) latente		(2.084.615)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(2.457.631)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		5.374.104
Rachats d'actions		(4.754.070)
Dividendes	7	(568.945)
Total de l'évolution du capital		51.089
Actif net à la fin de l'exercice		38.590.481

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	38.590.481	40.997.023	47.451.659

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	29.271.015
Avoirs en banque et liquidités	2	776.856
À recevoir sur souscriptions		909
Intérêts et dividendes nets à recevoir		377.006
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	14.559
Total de l'actif		30.440.345
Passifs		
À payer sur rachats		(1.615)
Commissions de gestion à payer	5	(34.991)
Autres passifs		(5.174)
Total du passif		(41.780)
Total de l'actif net		30.398.565

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEC	46.569,415
Classe AEH	13.233,968
Classe AKH	82,000
Classe ANH	818,000
Classe ASH	272.273,409
Classe AU	47.418,475
Classe AUP	2.457.890,528
Classe DEH	20.054,742
Classe DU	18.318,766
Classe IEH	17.657,346
Classe IU	89,000
Classe SU	447,319
Classe SUP	41.856,044
Classe W	4.779,568
Classe XUP	89,000
Classe ZU	76,000

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEC	6,9476 ¹	8,0881 ¹	9,2177 ¹
Classe AEH	22,3440 ¹	24,6916 ¹	26,8384 ¹
Classe AKH	84,1314 ²	92,6360 ²	100,7566 ²
Classe ANH	8,5857 ³	9,3882 ³	10,1328 ³
Classe ASH	10,8469 ⁴	11,7200 ⁴	12,6134 ⁴
Classe AU	68,7292	73,6637	79,1694
Classe AUP	8,8962	10,0463	11,3182
Classe DEH	16,5765 ¹	18,3325 ¹	19,9465 ¹
Classe DU	48,7787	52,3331	56,3008
Classe IEH	24,8419 ¹	27,2289 ¹	29,3633 ¹
Classe IU	9,5573	10,1566	10,8581
Classe SU	27,5181	29,5378	31,7934
Classe SUP	8,5265	9,6466	10,8819
Classe W	57,6066	61,5266	65,8940
Classe XUP	8,8010	9,8204	10,9029
Classe ZU	11,1655	11,8658	12,6758

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁴La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		35.175.906
Revenus		
Dividendes, nets	2	38.265
Intérêts sur obligations, nets	2	1.589.216
Intérêts bancaires	2	32.309
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		213
Autres revenus		1
Total des revenus		1.660.004
Charges		
Commissions de gestion	5	(410.301)
Intérêts bancaires	2	(419)
Charges d'exploitation	3, 5	(71.257)
Frais divers	4	(27)
Total des charges		(482.004)
Revenu net sur investissements		1.178.000
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(1.620.695)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(43.230)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		169.316
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		26.489
(Moins-value) nette réalisée		(1.468.120)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(2.098.990)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(12.646)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(40.788)
Variation nette de la (moins-value) latente		(2.152.424)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(2.442.544)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		4.681.813
Rachats d'actions		(5.771.939)
Dividendes	7	(1.244.671)
Total de l'évolution du capital		(2.334.797)
Actif net à la fin de l'exercice		30.398.565

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	30.398.565	35.175.906	45.515.822

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	57.453.232
Avoirs en banque et liquidités	2	1.445.478
À recevoir sur souscriptions		769
Intérêts et dividendes nets à recevoir		739.989
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	292.959
Plus-value nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	43.953
Total de l'actif		59.976.380
Passifs		
À payer sur rachats		(2.561)
Commissions de gestion à payer	5	(39.272)
Autres passifs		(7.684)
Total du passif		(49.517)
Total de l'actif net		59.926.863

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEC	2.674.098,608
Classe AEH	216.289,827
Classe AKH	85,000
Classe ANH	835,000
Classe ASC	38.489,588
Classe ASH	14.267,454
Classe AU	336.766,572
Classe AUP	1.276.546,614
Classe DEH	84.792,632
Classe DU	120.201,933
Classe IE	173.632,512
Classe IEH	609.670,444
Classe XU	1.601.873,807
Classe XUP	184.900,129
Classe ZEH	15.664,000
Classe ZU	100,000

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEC	4,1720 ¹	4,6270 ¹	5,3304 ¹
Classe AEH	13,2333 ¹	13,9674 ¹	15,3274 ¹
Classe AKH	87,0471 ²	91,6130 ²	100,3800 ²
Classe ANH	8,9568 ³	9,3476 ³	10,1668 ³
Classe ASC	5,8342 ⁴	6,3399 ⁴	7,2335 ⁴
Classe ASH	10,1810 ⁴	10,5249 ⁴	11,4387 ⁴
Classe AU	16,6480	17,1041	18,5735
Classe AUP	4,5925	4,9572	5,6508
Classe DEH	10,2791 ¹	10,8662 ¹	11,9416 ¹
Classe DU	12,9190	13,2928	14,4565
Classe IE	9,6716 ¹	9,6301 ¹	9,8260 ¹
Classe IEH	15,3381 ¹	16,0698 ¹	17,5011 ¹
Classe XU	10,4820	10,6176	11,3638
Classe XUP	8,1382	8,6646	9,7360
Classe ZEH	9,8420 ¹	10,3126 ¹	11,2373 ¹
Classe ZU	9,0109	9,1782	—

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁴La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		91.108.424
Revenus		
Dividendes, nets	2	57.551
Intérêts sur obligations, nets	2	3.467.411
Intérêts bancaires	2	64.408
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		896
Total des revenus		3.590.266
Charges		
Commissions de gestion	5	(489.696)
Intérêts bancaires	2	(3.239)
Charges d'exploitation	3, 5	(122.092)
Frais divers	4	(6)
Total des charges		(615.033)
Revenu net sur investissements		2.975.233
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(5.204.832)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(1.494.902)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats à terme standardisés		(118.126)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(5.621)
(Moins-value) nette réalisée		(6.823.481)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(677.353)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(41.225)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats à terme standardisés		105.716
Variation nette de la (moins-value) latente		(612.862)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(4.461.110)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		6.041.953
Rachats d'actions		(31.718.963)
Dividendes	7	(1.043.441)
Total de l'évolution du capital		(26.720.451)
Actif net à la fin de l'exercice		59.926.863

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	59.926.863	91.108.424	115.675.743

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	112.901.000
Avoirs en banque et liquidités	2	4.196.333
À recevoir sur souscriptions		75.907
Intérêts et dividendes nets à recevoir		1.878.296
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	727.720
Autres actifs		59
Total de l'actif		119.779.315
Passifs		
À payer sur rachats		(21.032)
Commissions de gestion à payer	5	(59.786)
Autres passifs		(10.641)
Total du passif		(91.459)
Total de l'actif net		119.687.856

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEC	13.756,531
Classe AEH	18.063,550
Classe AKH	80,000
Classe ANH	802,000
Classe ASH	33.549,319
Classe AU	89.995,944
Classe AUP	210.482,229
Classe DEC	12.740,268
Classe DEH	19.397,812
Classe DU	35.828,686
Classe IEC	92,000
Classe IEH	1.910.014,092
Classe IKH	79,000
Classe INH	789,000
Classe ISC	395.606,558
Classe IU	3.951.994,297
Classe TEH	5.146,558
Classe XUP	90,000
Classe ZFH	82,000
Classe ZGH	58,000
Classe ZU	11.851,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		176.111.653
Revenus		
Intérêts sur obligations, nets	2	8.464.934
Intérêts bancaires	2	150.271
Autres revenus		1.800
Total des revenus		8.617.005
Charges		
Commissions de gestion	5	(870.643)
Intérêts bancaires	2	(6.655)
Charges d'exploitation	3, 5	(159.807)
Total des charges		(1.037.105)
Revenu net sur investissements		7.579.900
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(7.722.822)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(3.634.854)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats à terme standardisés		(4)
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		500.304
(Moins-value) nette réalisée		(10.857.376)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(6.275.992)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(65.679)
Variation nette de la (moins-value) latente		(6.341.671)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(9.619.147)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		24.347.190
Rachats d'actions		(70.897.147)
Dividendes	7	(254.693)
Total de l'évolution du capital		(46.804.650)
Actif net à la fin de l'exercice		119.687.856

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	119.687.856	176.111.653	210.577.608

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEC	10,3123 ¹	11,6239 ¹	12,5108 ¹
Classe AEH	30,0326 ¹	32,0422 ¹	32,7344 ¹
Classe AKH	96,4111 ²	102,5833 ²	104,5429 ²
Classe ANH	9,7797 ³	10,3445 ³	10,4867 ³
Classe ASH	14,4742 ⁴	15,1131 ⁴	15,3006 ⁴
Classe AU	36,5811	37,8984	38,3288
Classe AUP	11,4723	12,5588	13,3803
Classe DEC	7,7584 ¹	8,7567 ¹	9,4471 ¹
Classe DEH	21,5485 ¹	23,0395 ¹	23,5798 ¹
Classe DU	26,2017	27,1995	27,5635
Classe IEC	7,6761 ¹	8,5796 ¹	9,1542 ¹
Classe IEH	30,3547 ¹	32,1076 ¹	32,5065 ¹
Classe IKH	99,5072 ²	104,9731 ²	105,9750 ²
Classe INH	10,1091 ³	10,5900 ³	10,6374 ³
Classe ISC	8,5672 ⁴	9,3701 ⁴	–
Classe IU	11,5402	11,8564	11,8836
Classe TEH	10,8358 ¹	11,4601 ¹	11,6033 ¹
Classe XUP	9,6526	10,4751	10,9963
Classe ZFH	10,2174 ⁵	10,8909 ⁵	11,0919 ⁵
Classe ZGH	11,5898 ⁶	12,0954 ⁶	12,2029 ⁶
Classe ZU	13,4244	13,8130	13,8794

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁴La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁵La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁶La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	36.763.905
Avoirs en banque et liquidités	2	1.475.420
Dépôts à terme	2, 19	3.646.810
À recevoir sur ventes de titres		356.878
À recevoir sur souscriptions		300.513
Intérêts et dividendes nets à recevoir		349.037
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	197.394
Autres actifs		193
Total de l'actif		43.090.150
Passifs		
À payer sur rachats		(42.445)
Commissions de gestion à payer	5	(12.117)
Autres passifs		(4.342)
Total du passif		(58.904)
Total de l'actif net		43.031.246

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEH	88.205,787
Classe AKH	82,000
Classe AS	1.486,300
Classe ASC	5.226,779
Classe ASH	42.594,720
Classe AU	97.044,685
Classe AUP	554.163,295
Classe AVC	100,000
Classe AVH	100,000
Classe DEH	60.905,790
Classe IEH	1.340.239,593
Classe IGH	54,000
Classe ISH	97,000
Classe IU	41.197,659
Classe XU	1.471.726,985
Classe ZU	42.070,000
Classe ZUP	92,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		57.454.754
Revenus		
Intérêts sur obligations, nets	2	1.780.826
Intérêts bancaires	2	103.594
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		436
Autres revenus		1
Total des revenus		1.884.857
Charges		
Commissions de gestion	5	(148.344)
Intérêts bancaires	2	(2.526)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(95)
Charges d'exploitation	3, 5	(62.837)
Total des charges		(213.802)
Revenu net sur investissements		1.671.055
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(2.488.096)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(516.683)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		243.031
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(65.248)
(Moins-value) nette réalisée		(2.826.996)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(2.205.668)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		22.103
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(66.057)
Variation nette de la (moins-value) latente		(2.249.622)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(3.405.563)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		5.149.313
Rachats d'actions		(15.922.622)
Dividendes	7	(244.636)
Total de l'évolution du capital		(11.017.945)
Actif net à la fin de l'exercice		43.031.246

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	43.031.246	57.454.754	68.819.183

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEH	10,2955 ¹	11,1546 ¹	11,9604 ¹
Classe AKH	89,4224 ²	96,2683 ²	102,8729 ²
Classe AS	10,2715 ³	11,0373 ³	11,6426 ³
Classe ASC	8,9050 ³	9,8517 ³	10,8641 ³
Classe ASH	11,6360 ³	12,3554 ³	13,1327 ³
Classe AU	11,9774	12,6431	13,4327
Classe AUP	9,3483	10,2865	11,3378
Classe AVC	8,4255 ⁴	9,3713 ⁴	10,3878 ⁴
Classe AVH	10,1977 ⁴	10,8855 ⁴	11,6150 ⁴
Classe DEH	9,9699 ¹	10,8323 ¹	11,6515 ¹
Classe IEH	10,8634 ¹	11,6988 ¹	12,4708 ¹
Classe IGH	11,7523 ⁵	12,4646 ⁵	13,1827 ⁵
Classe ISH	12,3266 ³	13,0166 ³	13,7420 ³
Classe IU	12,6617	13,2854	14,0310
Classe XU	12,0581	12,6016	13,2554
Classe ZU	12,6515	13,2836	14,0429
Classe ZUP	9,0572	9,9161	10,8803

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁴La Classe est libellée en AUD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁵La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	441.234
Avoirs en banque et liquidités	2	70.958
Intérêts et dividendes nets à recevoir		3.268
Total de l'actif		515.460
Passifs		
(Moins-value) nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	(93.528)
Commissions de gestion à payer	5	(10.421)
Autres passifs		(3.604)
Total du passif		(107.553)
Total de l'actif net		407.907

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	19.286,564
Classe DE	19.192,968

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	10,7963	11,5219	11,3495
Classe AEP [#]	–	11,4169	11,2520
Classe DE	10,4040	11,1869	11,1024
Classe IE [#]	–	11,8436	11,5850
Classe IEP [#]	–	11,7510	11,4878
Classe LE [#]	–	11,9147	11,6371
Classe LEP [#]	–	11,8287	11,5394
Classe ZE [#]	–	11,7517	11,5196
Classe ZEP [#]	–	11,6583	11,4285

[#]Voir annexe 1.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		33.700.769
Revenus		
Intérêts sur obligations, nets	2	88.346
Intérêts bancaires	2	35.040
Autres revenus		4
Total des revenus		123.390
Charges		
Commissions de gestion	5	(184.331)
Intérêts bancaires	2	(5.195)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(5.100)
Charges d'exploitation	3, 5	(66.381)
Total des charges		(261.007)
(Moins-value) nette sur investissements		(137.617)
Plus-value nette réalisée sur ventes d'investissements		2.217.490
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		123.337
(Moins-value) nette réalisée sur contrats à terme standardisés		(555.793)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(84.550)
Plus-value nette réalisée		1.700.484
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(3.594.581)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(87.400)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(352.619)
Variation nette de la (moins-value) latente		(4.034.600)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(2.471.733)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		4.061.917
Rachats d'actions		(34.883.044)
Dividendes	7	(2)
Total de l'évolution du capital		(30.821.129)
Actif net à la fin de l'exercice		407.907

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	407.907	33.700.769	31.879.013

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	32.411.362
Avoirs en banque et liquidités	2	2.163.864
Dépôts à terme	2, 19	1.411.301
À recevoir sur souscriptions		87
Intérêts à recevoir sur swaps	2	9.759
Intérêts et dividendes nets à recevoir		122.413
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	183.181
Plus-value nette latente sur swaps	2, 10	96.637
Autres actifs		9.632
Total de l'actif		36.408.236
Passifs		
Découverts bancaires		(45)
À payer sur achats de titres		(278.117)
À payer sur rachats		(2.824)
Intérêts payables sur swaps	2	(4.880)
(Moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	(314.687)
Commissions de gestion à payer	5	(39.443)
Autres passifs		(8.278)
Total du passif		(648.274)
Total de l'actif net		35.759.962

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEC	61.474,388
Classe AEH	279.961,193
Classe AKH	74,000
Classe AU	236.279,127
Classe AUP	277.797,449
Classe DEH	94.209,106
Classe DU	162.881,488
Classe IEH	11.053,874
Classe IGH	24,000
Classe IU	264.680,590
Classe W	5.683,832
Classe ZU	100,000

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEC	11,8519 ¹	13,3778 ¹	14,0361 ¹
Classe AEH	24,9127 ¹	27,7017 ¹	28,7145 ¹
Classe AKH	97,4964 ²	108,2209 ²	112,0590 ²
Classe AU	39,0428	42,0736	43,1173
Classe AUP	14,3202	15,6687	16,2512
Classe DEH	17,7549 ¹	19,8712 ¹	20,7320 ¹
Classe DU	25,2586	27,3970	28,2598
Classe IEH	9,8952 ¹	10,9147 ¹	11,2478 ¹
Classe IGH	26,3907 ³	28,7174 ³	29,3439 ³
Classe IU	29,3576	31,4158	31,9704
Classe W	64,1635	69,2136	71,0014
Classe ZU	8,8409	9,4818	-

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		44.823.256
Revenus		
Dividendes, nets	2	272.012
Intérêts sur obligations, nets	2	206.149
Intérêts bancaires	2	81.775
Produits d'intérêt sur swaps		183.554
Total des revenus		743.490
Charges		
Commissions de gestion	5	(506.399)
Intérêts bancaires	2	(17.379)
Charges d'intérêt sur swaps		(32.621)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(9.091)
Charges d'exploitation	3, 5	(105.866)
Total des charges		(671.356)
Revenu net sur investissements		72.134
Plus-value nette réalisée sur ventes d'investissements		1.725.976
Plus-value nette réalisée sur swaps		62.731
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(1.718.964)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		905.155
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(300.854)
(Moins-value) nette réalisée sur restitution d'impôt		(138)
Plus-value nette réalisée		673.906
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(5.199.802)
Variation de la (moins-value) nette latente sur swaps		(183.126)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		203.320
Variation de la plus-value nette latente sur contrats à terme standardisés		497.655
Variation nette de la (moins-value) latente		(4.681.953)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(3.935.913)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		5.416.481
Rachats d'actions		(10.467.659)
Dividendes	7	(76.203)
Total de l'évolution du capital		(5.127.381)
Actif net à la fin de l'exercice		35.759.962

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	35.759.962	44.823.256	58.030.727

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	102.806.032
Avoirs en banque et liquidités	2	6.486.496
À recevoir sur ventes de titres		312.977
À recevoir sur souscriptions		67.102
Intérêts à recevoir sur swaps	2	1.761
Intérêts et dividendes nets à recevoir		650.054
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	105.827
Plus-value nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	366.411
Autres actifs		42.312
Total de l'actif		110.838.972
Passifs		
Options (position courte) à la valeur de marché	2, 12	(377.061)
À payer sur achats de titres		(555.674)
À payer sur rachats		(212.242)
Intérêts payables sur swaps	2	(2.161)
(Moins-value) nette latente sur swaps	2, 10	(5.730)
Commissions de gestion à payer	5	(132.294)
Autres passifs		(36.910)
Total du passif		(1.322.072)
Total de l'actif net		109.516.900

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	56.817,964
Classe AEC	4.181.222,806
Classe AEH	609.190,670
Classe AEP	2.210.186,318
Classe AS	100,000
Classe ASC	16.069,559
Classe ASH	639,122
Classe ASP	5.324,095
Classe AU	374.518,833
Classe AUM	40.835,903
Classe AUP	940.558,501
Classe DEC	2.242.637,357
Classe DEH	234.640,747
Classe DEP	230.012,621
Classe DU	333.249,275
Classe DUP	681.121,774
Classe ZE	73,000
Classe ZEC	93,000
Classe ZEH	72.750,621
Classe ZFH	85,000
Classe ZU	4.008,949
Classe ZUP	100,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		142.600.557
Revenus		
Dividendes, nets	2	1.540.862
Intérêts sur obligations, nets	2	1.933.158
Intérêts bancaires	2	143.405
Produits d'intérêt sur swaps		53.261
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		175.420
Autres revenus		113
Total des revenus		3.846.219
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.696.089)
Intérêts bancaires	2	(15.795)
Charges d'intérêt sur swaps		(62.971)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(86.425)
Charges d'exploitation	3, 5	(343.793)
Frais divers	4	(1)
Total des charges		(2.205.074)
Revenu net sur investissements		1.641.145
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(7.203.234)
Plus-value nette réalisée sur swaps		9.167
Plus-value nette réalisée sur options		365.179
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		1.234.162
(Moins-value) nette réalisée sur contrats à terme standardisés		(88.402)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(1.088.305)
(Moins-value) nette réalisée		(6.771.433)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(5.786.684)
Variation de la plus-value nette latente sur swaps		20.687
Variation de la plus-value nette latente sur options		24.932
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(740.533)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(310.150)
Variation nette de la (moins-value) latente		(6.791.748)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(11.922.036)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		10.342.076
Rachats d'actions		(27.710.504)
Dividendes	7	(3.793.193)
Total de l'évolution du capital		(21.161.621)
Actif net à la fin de l'exercice		109.516.900

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	109.516.900	142.600.557	175.207.757

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	11,5541 ¹	11,8451 ¹	11,1664 ¹
Classe AEC	6,8440 ¹	7,7505 ¹	8,1761 ¹
Classe AEH	16,5540 ¹	17,9084 ¹	18,0258 ¹
Classe AEP	8,7671 ¹	9,4049 ¹	9,2989 ¹
Classe AS	10,4496 ²	11,1952 ²	11,0946 ²
Classe ASC	8,2370 ²	9,1249 ²	9,5406 ²
Classe ASH	10,4766 ²	11,0880 ²	11,0586 ²
Classe ASP	8,1638 ²	9,1289 ²	9,4660 ²
Classe AU	19,5536	20,5295	20,4434
Classe AUM	8,8613	9,7159	10,1632
Classe AUP	8,3706	9,1953	9,6048
Classe DEC	6,4163 ¹	7,3229 ¹	7,7834 ¹
Classe DEH	9,3527 ¹	10,1960 ¹	10,3401 ¹
Classe DEP	8,1540 ¹	8,8122 ¹	8,7797 ¹
Classe DU	11,9278	12,6175	12,6591
Classe DUP	7,5370	8,3429	8,7793
Classe ZE	11,8898 ¹	12,1429 ¹	11,3949 ¹
Classe ZEC	7,6027 ¹	8,5885 ¹	9,0180 ¹
Classe ZEH	10,0654 ¹	10,8301 ¹	10,8464 ¹
Classe ZFH	9,8346 ³	10,6752 ³	10,7251 ³
Classe ZU	11,5140	12,0281	11,9183
Classe ZUP	8,4589	9,2576	9,6307

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	4.832.284
Avoirs en banque et liquidités	2	253.059
À recevoir sur ventes de titres		479
Intérêts et dividendes nets à recevoir		21.959
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	816
Autres actifs	20	33.653
Total de l'actif		5.142.250
Passifs		
À payer sur achats de titres		(2.555)
Commissions de gestion à payer	5	(2.896)
Autres passifs		(603)
Total du passif		(6.054)
Total de l'actif net		5.136.196

NOMBRE D'ACTION EN CIRCULATION

Classe AE	100,000
Classe AEC	100,000
Classe AEH	9.236,091
Classe AU	100,000
Classe AUP	100,000
Classe IE	100,000
Classe IEH	100,000
Classe IG	100,000
Classe IU	100,000
Classe LE	97.000,000
Classe LG	100,000
Classe XU	100,000
Classe ZE	100,000
Classe ZEC	100,000
Classe ZEH	100,000
Classe ZU	498.187,100
Classe ZUP	100,000

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	8,6814 ¹	10,1300 ¹	13,1238 ¹
Classe AEC	7,3738 ¹	9,3082 ¹	13,0744 ¹
Classe AEH	7,6264 ¹	9,4264 ¹	13,1208 ¹
Classe AU	8,0834	9,6534	13,2113
Classe AUP	7,8220	9,5286	13,1684
Classe IE	8,8953 ¹	10,2725 ¹	13,1851 ¹
Classe IEH	7,8154 ¹	9,5604 ¹	13,1794 ¹
Classe IG	8,5458 ²	9,4923 ²	12,2808 ²
Classe IU	8,2860	9,7979	13,2780
Classe LE	8,9650 ¹	10,3264 ¹	13,2092 ¹
Classe LG	8,6130 ²	9,5344 ²	12,2989 ²
Classe XU	8,4163	9,8914	13,3214
Classe ZE	8,8591 ¹	10,2464 ¹	13,1739 ¹
Classe ZEC	7,5103 ¹	9,4153 ¹	13,1241 ¹
Classe ZEH	7,7713 ¹	9,5353 ¹	13,1675 ¹
Classe ZU	8,2349	9,7613	13,2623
Classe ZUP	7,9637	9,6378	13,2192

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.²La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		6.094.426
Revenus		
Dividendes, nets	2	81.634
Intérêts bancaires	2	4.983
Total des revenus		86.617
Charges		
Commissions de gestion	5	(35.610)
Charges d'exploitation	3, 5	(9.711)
Total des charges		(45.321)
Revenu net sur investissements		41.296
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(821.291)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(5.487)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(3.106)
(Moins-value) nette réalisée		(829.884)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(165.251)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(240)
Variation nette de la (moins-value) latente		(165.491)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(954.079)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		508
Rachats d'actions		(4.598)
Dividendes	7	(61)
Total de l'évolution du capital		(4.151)
Actif net à la fin de l'exercice		5.136.196

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	5.136.196	6.094.426	9.412.889

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	1.853.829.794
Avoirs en banque et liquidités	2	3.068.643
À recevoir sur ventes de titres		7.319.697
À recevoir sur souscriptions		1.123.378
Intérêts et dividendes nets à recevoir		2.437.986
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	1.869.364
Autres actifs	20	739.993
Total de l'actif		1.870.388.855
Passifs		
À payer sur achats de titres		(4.857.089)
À payer sur rachats		(1.960.748)
Commissions de gestion à payer	5	(1.737.830)
Autres passifs		(237.785)
Total du passif		(8.793.452)
Total de l'actif net		1.861.595.403

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEH	1.427.641,871
Classe AEP	4.022.716,513
Classe ASH	88.568,115
Classe AU	6.704.765,850
Classe AUP	34.292,333
Classe DEH	737.762,471
Classe DU	1.516.437,783
Classe IE	5.387.913,894
Classe IEH	3.964.562,783
Classe IU	25.682.526,076
Classe IUP	51.356,992
Classe W	4.738,351
Classe XU	2.762.066,512
Classe ZE	4.434.997,017
Classe ZEH	243.060,968
Classe ZEP	3.744.094,085
Classe ZFH	75,000
Classe ZG	608.086,828
Classe ZU	663.955,692

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		2.405.094.415
Revenus		
Dividendes, nets	2	18.797.252
Intérêts bancaires	2	175.757
Autres revenus		370
Total des revenus		18.973.379
Charges		
Commissions de gestion	5	(20.848.148)
Intérêts bancaires	2	(48.665)
Charges d'exploitation	3, 5	(3.565.898)
Total des charges		(24.462.711)
(Moins-value) nette sur investissements		(5.489.332)
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(106.284.065)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(10.540.289)
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		370.792
(Moins-value) nette réalisée sur restitution d'impôt		(188)
(Moins-value) nette réalisée		(116.453.750)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(126.431.618)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(4.820)
Variation nette de la (moins-value) latente		(126.436.438)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(248.379.520)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		587.900.273
Rachats d'actions		(881.035.864)
Dividendes	7	(1.983.901)
Total de l'évolution du capital		(295.119.492)
Actif net à la fin de l'exercice		1.861.595.403

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	1.861.595.403	2.405.094.415	1.676.310.766

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEH	52,8087 ¹	60,3566 ¹	57,4173 ¹
Classe AEP	19,5948 ¹	21,3430 ¹	19,1012 ¹
Classe ASH ²	9,9814 ²	–	–
Classe AU	93,4160	102,8279	96,5311
Classe AUP	14,6282	16,3197	15,4283
Classe DEH	37,5629 ¹	43,2512 ¹	41,4515 ¹
Classe DU	47,8351	53,0512	50,1776
Classe IE	19,5074 ¹	20,7896 ¹	18,3198 ¹
Classe IEH	14,4633 ¹	16,3912 ¹	15,4630 ¹
Classe IU	19,4038	21,1779	19,7127
Classe IUP	15,2319	16,8469	15,7922
Classe W	142,8921	157,1578	147,4604
Classe XU	22,8844	24,7993	22,8996
Classe ZE	21,9599 ¹	23,4189 ¹	20,6574 ¹
Classe ZEH	10,4027 ¹	11,7932 ¹	11,1310 ¹
Classe ZEP	20,4842 ¹	22,1355 ¹	19,6580 ¹
Classe ZFH	10,3229 ³	11,7503 ³	11,1109 ³
Classe ZG	22,5389 ⁴	23,1166 ⁴	20,5546 ⁴
Classe ZU	23,4612	25,6233	23,8745

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁴La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁵Voir annexe 1.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	342.123.884
Avoirs en banque et liquidités	2	8.086.511
À recevoir sur ventes de titres		17.506
À recevoir sur souscriptions		1.108
Intérêts et dividendes nets à recevoir		1.235.304
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	20.726
Autres actifs	20	2.330.687
Total de l'actif		353.815.726
Passifs		
À payer sur rachats		(11.223)
Commissions de gestion à payer	5	(69.895)
Autres passifs		(28.611)
Total du passif		(109.729)
Total de l'actif net		353.705.997

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEH	16.393,606
Classe AU	34.541,373
Classe DEH	47.894,407
Classe DU	63.604,139
Classe IE	33.292,215
Classe IEH	41.024,410
Classe IU	4.747.899,224
Classe XU	29.731.456,869
Classe ZU	127.516,669
Classe 1E	3.134.661,702
Classe 1U	2.236.201,250
Classe 2E	2.016.097,894
Classe 2U	53,000
Classe 8E	390,015
Classe 8U	1.640.029,266

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEH	24,5593 ¹	29,8455 ¹	42,3802 ¹
Classe AU	41,7317	48,9816	68,3931
Classe DEH	17,2383 ¹	21,1131 ¹	30,1969 ¹
Classe DU	28,7652	34,0169	47,8562
Classe IE	10,4209 ¹	11,8421 ¹	15,5210 ¹
Classe IEH	15,0434 ¹	18,1198 ¹	25,5028 ¹
Classe IU	10,1101	11,7660	16,2895
Classe XU	8,8771	10,2512	-
Classe ZU	9,6637	11,2539	15,5962
Classe 1E	1,2435 ¹	1,4248 ¹	1,8817 ¹
Classe 1U	1,3508	1,5851	2,2113
Classe 2E	11,4983 ¹	13,0947 ¹	17,1886 ¹
Classe 2U	11,0215	12,8579	17,8242
Classe 8E	1,3737 ¹	1,5656 ¹	2,0559 ¹
Classe 8U	1,4931	1,7421	2,4165

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		134.106.881
Revenus		
Dividendes, nets	2	4.254.148
Intérêts bancaires	2	233.375
Autres revenus		586.590
Total des revenus		5.074.113
Charges		
Commissions de gestion	5	(943.672)
Intérêts bancaires	2	(5.003)
Charges d'exploitation	3, 5	(352.555)
Total des charges		(1.301.230)
Revenu net sur investissements		3.772.883
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(29.933.966)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(116.470)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(198.004)
(Moins-value) nette réalisée		(30.248.440)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(14.528.395)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(1.848)
Variation nette de la (moins-value) latente		(14.530.243)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(41.005.800)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		302.224.814
Rachats d'actions		(41.619.898)
Total de l'évolution du capital		260.604.916
Actif net à la fin de l'exercice		353.705.997

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

USD	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
	353.705.997	134.106.881	170.104.097

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	167.602.520
Avoirs en banque et liquidités	2	303.605
À recevoir sur souscriptions		153.508
Intérêts et dividendes nets à recevoir		380.373
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	54.167
Autres actifs	20	155.360
Total de l'actif		168.649.533
Passifs		
À payer sur rachats		(86.331)
Commissions de gestion à payer	5	(142.165)
Autres passifs		(24.022)
Total du passif		(252.518)
Total de l'actif net		168.397.015

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEC	326,000
Classe AUP	84,000
Classe DEC	77,000
Classe DUP	49.298,838
Classe IU	218.786,000
Classe TE	66,000
Classe ZU	75,000
Classe 1E	1.625.996,038
Classe 1EP	1.424.333,754
Classe 1SC	434.065,976
Classe 1SH	36.070,165
Classe 1ST	80.840,493
Classe 1U	321.124,663
Classe 1UP	396.270,792
Classe 1VT	5.746,136
Classe 2E	760.261,534
Classe 2EP	72,000
Classe 2U	75,000
Classe 2UP	82,000
Classe 3E	140.997,353
Classe 3EP	7.208.679,900
Classe 3U	9.575,003
Classe 3UP	20.172,115
Classe 8E	119.354,234
Classe 8EP	236,808
Classe 8U	8.233,578
Classe 8UP	105.481,704
Classe 9E	65,000
Classe 9EP	72,000
Classe 9U	74,000
Classe 9UP	82,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		215.918.713
Revenus		
Dividendes, nets	2	4.283.771
Intérêts bancaires	2	44.133
Autres revenus		320
Total des revenus		4.328.224
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.740.683)
Intérêts bancaires	2	(1.041)
Charges d'exploitation	3, 5	(299.467)
Total des charges		(2.041.191)
Revenu net sur investissements		2.287.033
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(2.724.776)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(33.831)
(Moins-value) nette réalisée		(2.758.607)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(9.308.678)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		7.909
Variation nette de la (moins-value) latente		(9.300.769)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(9.772.343)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		18.729.941
Rachats d'actions		(52.847.962)
Dividendes	7	(3.631.334)
Total de l'évolution du capital		(37.749.355)
Actif net à la fin de l'exercice		168.397.015

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	168.397.015	215.918.713	220.612.038

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEC	9,7529 ¹	10,9032 ¹	10,8646 ¹
Classe AUP	10,8746	11,7207	11,5197
Classe DEC	9,5329 ¹	10,7205 ¹	10,7367 ¹
Classe DUP	10,6321	11,5104	11,3689
Classe IU	13,0416	13,5078	12,8194
Classe TE	13,6889 ¹	13,8508 ¹	12,4675 ¹
Classe ZU	12,9971	13,4839	12,8038
Classe 1E	13,3500 ¹	13,6005 ¹	12,3011 ¹
Classe 1EP	11,5606 ¹	12,1468 ¹	11,2887 ¹
Classe 1SC	10,5266 ²	11,4630 ²	11,2960 ²
Classe 1SH	12,1716 ²	12,8545 ²	12,3246 ²
Classe 1ST	10,5621 ²	11,4849 ²	11,3150 ²
Classe 1U	12,6598	13,2084	12,6191
Classe 1UP	10,9443	11,7772	11,5601
Classe 1VT	10,0908 ³	11,1290 ³	11,0336 ³
Classe 2E	13,9684 ¹	14,1440 ¹	12,7149 ¹
Classe 2EP	11,9014 ¹	12,4187 ¹	11,4725 ¹
Classe 2U	13,0009	13,4831	12,8080
Classe 2UP	11,2898	12,0644	11,7699
Classe 3E	13,8013 ¹	13,9552 ¹	12,5276 ¹
Classe 3EP	11,9519 ¹	12,4603 ¹	11,4904 ¹
Classe 3U	13,0876	13,5528	12,8514
Classe 3UP	11,3470	12,1163	11,8020
Classe 8E	13,6859 ¹	13,8635 ¹	12,4677 ¹
Classe 8EP	11,8295 ¹	12,3593 ¹	11,4170 ¹
Classe 8U	12,9818	13,4674	12,7934
Classe 8UP	11,2439	12,0275	11,7367
Classe 9E	13,8492 ¹	13,9945 ¹	12,5555 ¹
Classe 9EP	11,9987 ¹	12,4988 ¹	11,5171 ¹
Classe 9U	13,1489	13,6064	12,8935
Classe 9UP	11,3777	12,1372	11,8108

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en AUD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

Threadneedle (Lux) - Global Select

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	581.342.531
Avoirs en banque et liquidités	2	1.435.988
À recevoir sur souscriptions		56.476
Intérêts et dividendes nets à recevoir		1.108.005
Autres actifs	20	219.772
Total de l'actif		584.162.772
Passifs		
À payer sur achats de titres		(10.335.752)
À payer sur rachats		(393.923)
Commissions de gestion à payer	5	(595.941)
Autres passifs		(70.749)
Total du passif		(11.396.365)
Total de l'actif net		572.766.407

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe IU	63.166,202
Classe ZU	1.378,995
Classe 1E	22.052.128,904
Classe 1U	64.240.462,842
Classe 2E	308.507,753
Classe 2U	2.988.061,507
Classe 3U	9.525.570,701
Classe 8E	63.716,592
Classe 8U	22.466.748,119
Classe 9U	2.167.420,935

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe IU	13,9844	15,7040	15,4100
Classe ZU	13,9429	15,6678	15,3846
Classe 1E	3,5100 ¹	3,8796 ¹	3,6305 ¹
Classe 1U	3,8129	4,3160	4,2662
Classe 2E	14,6149 ¹	16,0460 ¹	14,9212 ¹
Classe 2U	13,9132	15,6533	15,3787
Classe 3U	4,1009	4,6059	4,5175
Classe 8E	5,1839 ¹	5,6972 ¹	5,3010 ¹
Classe 8U	5,6311	6,3379	6,2292
Classe 9U	14,0355	15,7566	15,4477

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		609.163.562
Revenus		
Dividendes, nets	2	6.874.698
Intérêts bancaires	2	61.913
Autres revenus		43
Total des revenus		6.936.654
Charges		
Commissions de gestion	5	(6.694.640)
Intérêts bancaires	2	(8.927)
Charges d'exploitation	3, 5	(807.216)
Total des charges		(7.510.783)
(Moins-value) nette sur investissements		(574.129)
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(6.034.796)
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		5.227
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		99.814
(Moins-value) nette réalisée		(5.929.755)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(60.066.305)
Variation nette de la (moins-value) latente		(60.066.305)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(66.570.189)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		137.576.486
Rachats d'actions		(107.403.452)
Total de l'évolution du capital		30.173.034
Actif net à la fin de l'exercice		572.766.407

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	572.766.407	609.163.562	605.915.496

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	1.685.070.914
Avoirs en banque et liquidités	2	1.342.668
À recevoir sur ventes de titres		1.360.576
À recevoir sur souscriptions		6.889.249
Intérêts et dividendes nets à recevoir		1.281.063
Autres actifs	20	350.195
Total de l'actif		1.696.294.665
Passifs		
À payer sur achats de titres		(6.219.076)
À payer sur rachats		(1.427.461)
(Moins-value) nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	(53.987)
Commissions de gestion à payer	5	(1.645.618)
Autres passifs		(375.818)
Total du passif		(9.721.960)
Total de l'actif net		1.686.572.705

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	14.522.792,970
Classe AEP	22.888.881,947
Classe AK	1.051.687,406
Classe AUP	68.493,848
Classe DE	1.734.284,581
Classe IE	5.790.708,485
Classe IEP	2.540.195,052
Classe NE	6.060.120,000
Classe XE	1.529.301,228
Classe XFH	78,000
Classe XG	41,000
Classe XGH	30,000
Classe XU	5.717.517,656
Classe ZE	1.992.369,249
Classe ZFH	328.953,539
Classe ZG	1.663.920,776
Classe ZGH	66.405,043
Classe ZU	5.551.812,150

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		1.892.718.184
Revenus		
Dividendes, nets	2	12.205.381
Intérêts bancaires	2	81.580
Autres revenus		1.957
Total des revenus		12.288.918
Charges		
Commissions de gestion	5	(19.137.829)
Intérêts bancaires	2	(7.954)
Charges d'exploitation	3, 5	(4.397.196)
Total des charges		(23.542.979)
(Moins-value) nette sur investissements		(11.254.061)
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(109.239.887)
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		1.028.891
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		684.503
(Moins-value) nette réalisée		(107.526.493)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(15.931.848)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(337.793)
Variation nette de la (moins-value) latente		(16.269.641)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(135.050.195)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		420.543.783
Rachats d'actions		(488.530.829)
Dividendes	7	(3.108.238)
Total de l'évolution du capital		(71.095.284)
Actif net à la fin de l'exercice		1.686.572.705

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	1.686.572.705	1.892.718.184	2.108.588.124

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	42,3307	45,6690	47,2890
Classe AEP	13,7161	14,9359	15,5848
Classe AK	124,8571 ¹	123,9807 ¹	126,8311 ¹
Classe AUP	12,6530 ²	14,1101 ²	15,5516 ²
Classe DE	31,9592	34,6525	36,0617
Classe IE	62,3619	66,7097	68,4913
Classe IEP	11,7372	12,6727	13,1106
Classe NE	13,7328	14,6609	15,0223
Classe XE	16,0222	17,0020	17,3169
Classe XFH	10,5007 ³	11,2077 ³	11,4338 ³
Classe XG	16,0392 ⁴	16,3517 ⁴	16,7790 ⁴
Classe XGH	22,0720 ⁴	23,1206 ⁴	23,4350 ⁴
Classe XU	9,7326 ²	10,5772 ²	11,3797 ²
Classe ZE	15,3242	16,4090	16,8641
Classe ZFH	14,9779 ³	16,1495 ³	16,6452 ³
Classe ZG	15,3455 ⁴	15,8031 ⁴	16,3719 ⁴
Classe ZGH	45,1878 ⁴	47,7950 ⁴	48,9276 ⁴
Classe ZU	14,1168 ²	15,4806 ²	16,8058 ²

¹La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

⁴La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

Threadneedle (Lux) - American

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	1.054.468.199
Avoirs en banque et liquidités	2	2.129.191
À recevoir sur souscriptions		545.614
Intérêts et dividendes nets à recevoir		650.555
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	1.915.892
Total de l'actif		1.059.709.451
Passifs		
À payer sur rachats		(590.406)
Commissions de gestion à payer	5	(916.219)
Autres passifs		(165.864)
Total du passif		(1.672.489)
Total de l'actif net		1.058.036.962

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEH	2.213.076,297
Classe AU	280.544,216
Classe DEH	44.016,944
Classe DU	610.689,401
Classe IEH	548.188,745
Classe IU	5.488.882,160
Classe W	1.598,035
Classe ZE	19.308,359
Classe ZEH	2.114.294,299
Classe ZU	60,000
Classe 1E	2.538.878,247
Classe 1EH	76.038,808
Classe 1EP	311.033,567
Classe 1U	11.864.112,005
Classe 2E	549.548,222
Classe 2U	8.300.540,060
Classe 3EH	34.852,469
Classe 3U	139.994,550
Classe 8E	449.826,278
Classe 8U	544.135,187
Classe 9EH	55,000
Classe 9U	364.819,350

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		1.241.417.577
Revenus		
Dividendes, nets	2	11.179.480
Intérêts bancaires	2	110.174
Total des revenus		11.289.654
Charges		
Commissions de gestion	5	(11.337.989)
Intérêts bancaires	2	(10.475)
Charges d'exploitation	3, 5	(2.062.268)
Total des charges		(13.410.732)
(Moins-value) nette sur investissements		(2.121.078)
Plus-value nette réalisée sur ventes d'investissements		30.883.946
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(12.263.865)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(512.743)
Plus-value nette réalisée		18.107.338
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(154.112.696)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		21.480
Variation nette de la (moins-value) latente		(154.091.216)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(138.104.956)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		513.060.714
Rachats d'actions		(558.260.709)
Dividendes	7	(75.664)
Total de l'évolution du capital		(45.275.659)
Actif net à la fin de l'exercice		1.058.036.962

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	1.058.036.962	1.241.417.577	1.120.251.631

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - American

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEH	58,8005 ¹	67,7231 ¹	62,4805 ¹
Classe AU	106,4713	118,2788	107,7058
Classe DEH	43,1697 ¹	49,9448 ¹	46,2355 ¹
Classe DU	41,1268	45,8481	41,8962
Classe IEH	64,4833 ¹	73,6686 ¹	67,3710 ¹
Classe IU	73,9691	81,4356	73,4915
Classe W	142,5123	157,8424	143,3024
Classe ZE	16,4747 ¹	17,7345 ¹	15,1672 ¹
Classe ZEH	13,7004 ¹	15,6669 ¹	14,3367 ¹
Classe ZU	15,4537	17,0528	15,4031
Classe 1E	15,6752 ¹	16,9814 ¹	14,6201 ¹
Classe 1EH	13,2250 ¹	15,2219 ¹	14,0242 ¹
Classe 1EP	14,6508 ¹	16,1234 ¹	14,0455 ¹
Classe 1U	14,7080	16,3179	14,8399
Classe 2E	16,1119 ¹	17,3483 ¹	14,8451 ¹
Classe 2U	15,1153	16,6678	15,0659
Classe 3EH	13,6917 ¹	15,6415 ¹	14,2960 ¹
Classe 3U	15,2372	16,7719	15,1327
Classe 8E	16,0815 ¹	17,3225 ¹	14,8290 ¹
Classe 8U	15,0839	16,6398	15,0466
Classe 9EH	13,7283 ¹	15,6785 ¹	14,3200 ¹
Classe 9U	15,2580	16,7881	15,1413

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

Threadneedle (Lux) - American Select

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	330.705.270
Avoirs en banque et liquidités	2	1.220.867
Dépôts à terme	2, 19	5.001.325
À recevoir sur souscriptions		25.733
Intérêts et dividendes nets à recevoir		326.155
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	16.587
Total de l'actif		337.295.937
Passifs		
À payer sur rachats		(92.641)
Commissions de gestion à payer	5	(408.968)
Autres passifs		(47.276)
Total du passif		(548.885)
Total de l'actif net		336.747.052

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AD	405,000
Classe AEH	15.035,842
Classe AN	524,000
Classe AU	127.456,818
Classe DEH	16.847,894
Classe DU	90.644,247
Classe ID	399,000
Classe IE	54,000
Classe IEH	4.765,789
Classe IN	517,000
Classe W	4.870,367
Classe ZEH	53,000
Classe ZU	8.884,396
Classe 1E	12.746.178,468
Classe 1EH	63.824,804
Classe 1EP	380.361,416
Classe 1U	37.872.414,659
Classe 2EH	712,000
Classe 2U	1.619,818
Classe 3E	831.550,449
Classe 3U	755.689,298
Classe 8EH	4.562,812
Classe 8U	1.857.228,876
Classe 9E	50,000
Classe 9U	3.235,874

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		413.688.020
Revenus		
Dividendes, nets	2	3.662.492
Intérêts bancaires	2	254.248
Total des revenus		3.916.740
Charges		
Commissions de gestion	5	(5.043.850)
Intérêts bancaires	2	(567)
Charges d'exploitation	3, 5	(582.430)
Total des charges		(5.626.847)
(Moins-value) nette sur investissements		(1.710.107)
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(32.938.293)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(115.969)
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		8.328
(Moins-value) nette réalisée		(33.045.934)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(17.431.050)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(7.893)
Variation nette de la (moins-value) latente		(17.438.943)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(52.194.984)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		22.616.857
Rachats d'actions		(47.328.161)
Dividendes	7	(34.680)
Total de l'évolution du capital		(24.745.984)
Actif net à la fin de l'exercice		336.747.052

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	336.747.052	413.688.020	438.535.319

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - American Select

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AD	14,4184 ¹	16,1001 ¹	14,0643 ¹
Classe AEH	36,3897 ²	43,2612 ²	40,4315 ²
Classe AN	17,0195 ³	16,2724 ³	14,6605 ³
Classe AU	34,9515	39,9888	36,9044
Classe DEH	24,5242 ²	29,3649 ²	27,6535 ²
Classe DU	30,3579	34,9947	32,5387
Classe ID	14,8718 ¹	16,4501 ¹	14,2588 ¹
Classe IE	14,9055 ²	16,5155 ²	14,3186 ²
Classe IEH	39,2277 ²	46,2659 ²	42,8992 ²
Classe IN	17,5368 ³	16,6107 ³	14,8493 ³
Classe W	37,0021	42,3137	39,0305
Classe ZEH	13,1870 ²	15,5785 ²	14,4664 ²
Classe ZU	14,9153	16,9458	15,5296
Classe 1E	5,5378 ²	6,1787 ²	5,3911 ²
Classe 1EH	3,8663 ²	4,5896 ²	4,2840 ²
Classe 1EP	5,2544 ²	5,9576 ²	5,2548 ²
Classe 1U	6,0164	6,8745	6,3360
Classe 2EH	13,6558 ²	16,1111 ²	14,9450 ²
Classe 2U	15,1476	17,2032	15,7585
Classe 3E	4,5811 ²	5,0705 ²	4,3890 ²
Classe 3U	4,9770	5,6415	5,1582
Classe 8EH	3,4274 ²	4,0452 ²	3,7559 ²
Classe 8U	6,9957	7,9480	7,2838
Classe 9E	15,9996 ²	17,7121 ²	15,3150 ²
Classe 9U	15,3123	17,3500	15,8570

¹La Classe est libellée en DKK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	459.733.127
Avoirs en banque et liquidités	2	1.037.476
À recevoir sur souscriptions		254.439
Intérêts et dividendes nets à recevoir		61.710
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	694.141
Total de l'actif		461.780.893
Passifs		
À payer sur rachats		(169.880)
Commissions de gestion à payer	5	(386.719)
Autres passifs		(65.108)
Total du passif		(621.707)
Total de l'actif net		461.159.186

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEH	146.813,264
Classe ASH	135,000
Classe AU	64.714,138
Classe DEH	19.309,039
Classe DU	59.936,971
Classe IE	7.475.903,485
Classe IU	1.185.843,630
Classe ZU	16.039,182
Classe 1E	562.304,921
Classe 1EP	1.120.043,835
Classe 1U	6.263.232,085
Classe 2U	1.506.944,461
Classe 3EH	4.009,863
Classe 3U	903.916,074
Classe 8U	1.233.977,903
Classe 9EH	3.812.813,617
Classe 9U	2.870.809,609

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEH	14,5673 ¹	16,5581 ¹	16,6368 ¹
Classe ASH ²	9,7371 ²	–	–
Classe AU	16,2313	17,7793	17,6124
Classe DEH	14,2416 ¹	16,2757 ¹	16,4357 ¹
Classe DU	15,8822	17,4841	17,4069
Classe IE	16,1245 ¹	17,1002 ¹	15,9009 ¹
Classe IU	16,8585	18,3099	17,9845
Classe ZU	16,7987	18,2631	17,9572
Classe 1E	17,2458 ¹	18,4235 ¹	17,2570 ¹
Classe 1EP	16,1333 ¹	17,4744 ¹	16,5639 ¹
Classe 1U	16,3330	17,8692	17,6803
Classe 2U	16,7817	18,2483	17,9455
Classe 3EH	15,1814 ¹	17,0721 ¹	17,0018 ¹
Classe 3U	16,8822	18,3319	18,0025
Classe 8U	16,7598	18,2318	17,9365
Classe 9EH	15,2029 ¹	17,1199 ¹	17,0449 ¹
Classe 9U	16,9176	18,3630	18,0258

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³Voir annexe 1.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		336.365.358
Revenus		
Dividendes, nets	2	3.488.382
Intérêts bancaires	2	58.021
Total des revenus		3.546.403
Charges		
Commissions de gestion	5	(3.476.243)
Intérêts bancaires	2	(1.323)
Charges d'exploitation	3, 5	(510.241)
Total des charges		(3.987.807)
(Moins-value) nette sur investissements		(441.404)
Plus-value nette réalisée sur ventes d'investissements		3.179.890
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(1.341.762)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(142.830)
Plus-value nette réalisée		1.695.298
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(39.221.286)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		536.115
Variation nette de la (moins-value) latente		(38.685.171)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(37.431.277)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		246.490.096
Rachats d'actions		(83.999.905)
Dividendes	7	(265.086)
Total de l'évolution du capital		162.225.105
Actif net à la fin de l'exercice		461.159.186

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

USD	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
	461.159.186	336.365.358	317.052.344

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	42.950.164
Avoirs en banque et liquidités	2	759.917
Intérêts et dividendes nets à recevoir		149.575
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	4.099
Autres actifs	20	530.884
Total de l'actif		44.394.639
Passifs		
Commissions de gestion à payer	5	(1.361)
Impôts à payer	3	(25.824)
Autres passifs		(5.686)
Total du passif		(32.871)
Total de l'actif net		44.361.768

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	1.735,856
Classe AF	51,000
Classe AS	938,481
Classe ASH	32.070,823
Classe AU	11.475,833
Classe DE	25.118,613
Classe IF	49,000
Classe ISH	71,000
Classe IU	51,000
Classe XU	1.237.862,746
Classe XUP	2.557.578,913
Classe ZE	45,000
Classe ZEH	3.844,269
Classe ZF	49,000
Classe ZG	60,000
Classe ZU	4.199,804

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	13,9231 ¹	15,4485 ¹	18,3066 ¹
Classe AF	12,7109 ²	14,5713 ²	18,6638 ²
Classe AS	9,9397 ³	11,4961 ³	14,2865 ³
Classe ASH	12,3807 ³	14,2590 ³	17,9279 ³
Classe AU	13,2011	15,0003	18,7762
Classe DE	13,0775 ¹	14,6194 ¹	17,4547 ¹
Classe IF	13,5353 ²	15,3389 ²	19,4667 ²
Classe ISH	13,3286 ³	15,2033 ³	18,9488 ³
Classe IU	14,1624	15,9526	19,7990
Classe XU	10,8872	12,1685	14,9820
Classe XUP	11,7028	13,4480	16,9577
Classe ZE	14,7099 ¹	16,2137 ¹	19,0713 ¹
Classe ZEH	11,8918 ¹	13,8883 ¹	17,5088 ¹
Classe ZF	13,4629 ²	15,3088 ²	19,4570 ²
Classe ZG	9,6689 ⁴	10,2500 ⁴	12,1521 ⁴
Classe ZU	14,0938	15,8950	19,7473

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁴La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		95.614.006
Revenus		
Dividendes, nets	2	1.401.445
Intérêts bancaires	2	22.346
Autres revenus		246.030
Total des revenus		1.669.821
Charges		
Commissions de gestion	5	(21.353)
Intérêts bancaires	2	(589)
Charges d'exploitation	3, 5	(91.494)
Total des charges		(113.436)
Revenu net sur investissements		1.556.385
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(2.851.035)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(13.564)
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		32.773
(Moins-value) nette réalisée		(2.831.826)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(9.704.069)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		938
Variation nette de la (moins-value) latente		(9.703.131)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(10.978.572)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		11.295.110
Rachats d'actions		(50.824.521)
Dividendes	7	(744.255)
Total de l'évolution du capital		(40.273.666)
Actif net à la fin de l'exercice		44.361.768

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

USD	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
	44.361.768	95.614.006	188.088.458

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	115.440.088
Avoirs en banque et liquidités	2	787.228
À recevoir sur souscriptions		1.262
Intérêts et dividendes nets à recevoir		412.537
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	13
Autres actifs	20	1.383.325
Total de l'actif		118.024.453
Passifs		
À payer sur achats de titres		(713.789)
À payer sur rachats		(69.160)
Commissions de gestion à payer	5	(121.005)
Autres passifs		(17.249)
Total du passif		(921.203)
Total de l'actif net		117.103.250

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	83,000
Classe AEH	83,000
Classe DE	83,000
Classe DEH	83,000
Classe IE	554.785,299
Classe IU	188.889,492
Classe ZU	19.857,424
Classe 1E	1.178.423,101
Classe 1U	22.268.734,091
Classe 2E	55,000
Classe 2U	1.583.661,487
Classe 3U	4.101.843,604
Classe 8E	670,407
Classe 8U	1.691.627,638
Classe 9U	131.715,243

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	7,7940 ¹	8,9696 ¹	–
Classe AEH	6,6394 ¹	8,0913 ¹	–
Classe DE	7,7281 ¹	8,9361 ¹	–
Classe DEH	6,5830 ¹	8,0618 ¹	–
Classe IE	11,2413 ¹	12,8045 ¹	14,5096 ¹
Classe IU	11,4782	13,3897	16,0271
Classe ZU	11,4362	13,3540	16,0024
Classe 1E	2,7919 ¹	3,2041 ¹	3,6581 ¹
Classe 1U	3,0330	3,5648	4,2991
Classe 2E	11,9878 ¹	13,6717 ¹	15,5085 ¹
Classe 2U	11,4208	13,3414	15,9916
Classe 3U	2,7558	3,2148	3,8480
Classe 8E	3,2110 ¹	3,6646 ¹	4,1593 ¹
Classe 8U	3,4904	4,0790	4,8912
Classe 9U	11,5069	13,4178	16,0542

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		142.380.978
Revenus		
Dividendes, nets	2	2.777.190
Intérêts bancaires	2	40.660
Autres revenus		518.334
Total des revenus		3.336.184
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.501.491)
Intérêts bancaires	2	(337)
Charges d'exploitation	3, 5	(213.337)
Frais divers	4	(265)
Total des charges		(1.715.430)
Revenu net sur investissements		1.620.754
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(10.513.890)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(8.257)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(52.945)
(Moins-value) nette réalisée		(10.575.092)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(11.774.789)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(3)
Variation nette de la (moins-value) latente		(11.774.792)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(20.729.130)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		21.492.955
Rachats d'actions		(26.041.553)
Total de l'évolution du capital		(4.548.598)
Actif net à la fin de l'exercice		117.103.250

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

USD	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
	117.103.250	142.380.978	343.930.526

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	260.750.521
Avoirs en banque et liquidités	2	6.443.734
À recevoir sur souscriptions		88.188
Intérêts et dividendes nets à recevoir		140.089
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	970.551
Total de l'actif		268.393.083
Passifs		
À payer sur rachats		(389.533)
Commissions de gestion à payer	5	(127.107)
Autres passifs		(55.881)
Total du passif		(572.521)
Total de l'actif net		267.820.562

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEC	52,844
Classe AEH	22.892,032
Classe AU	75.775,028
Classe AUP	8.906,274
Classe DU	6.382,200
Classe IU	1.426.416,499
Classe XS	69,000
Classe XSH	5.242.486,638
Classe ZEH	338.028,006
Classe ZFH	48,000
Classe ZGH	35,000
Classe ZU	3.592.736,411

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEC	16,0772 ¹	18,8839 ¹	17,5161 ¹
Classe AEH	27,0377 ¹	31,2589 ¹	28,6186 ¹
Classe AU	51,7687	57,7098	52,1802
Classe AUP	18,4680	20,8998	19,1464
Classe DU	25,5801	28,6587	26,0427
Classe IU	75,5875	83,5904	74,9789
Classe XS	18,3141 ²	20,4221 ²	18,0154 ²
Classe XSH	18,5872 ²	20,6253 ²	18,3848 ²
Classe ZEH	17,8024 ¹	20,4263 ¹	18,5596 ¹
Classe ZFH	17,3160 ³	19,9729 ³	18,1775 ³
Classe ZGH	18,7761 ⁴	21,2839 ⁴	19,2281 ⁴
Classe ZU	20,9441	23,1731	20,7962

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁴La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		379.069.017
Revenus		
Dividendes, nets	2	2.672.162
Intérêts bancaires	2	175.047
Total des revenus		2.847.209
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.643.430)
Intérêts bancaires	2	(7.796)
Charges d'exploitation	3, 5	(709.165)
Total des charges		(2.360.391)
Revenu net sur investissements		486.818
Plus-value nette réalisée sur ventes d'investissements		22.159.580
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(707.868)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(61.135)
Plus-value nette réalisée		21.390.577
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(59.348.888)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(93.723)
Variation nette de la (moins-value) latente		(59.442.611)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(37.565.216)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		45.664.053
Rachats d'actions		(119.344.926)
Dividendes	7	(2.366)
Total de l'évolution du capital		(73.683.239)
Actif net à la fin de l'exercice		267.820.562

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	267.820.562	379.069.017	484.292.226

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	125.538.670
Avoirs en banque et liquidités	2	1.531.165
À recevoir sur souscriptions		135.036
Intérêts et dividendes nets à recevoir		74.286
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	5.416
Total de l'actif		127.284.573
Passifs		
À payer sur rachats		(155.246)
Commissions de gestion à payer	5	(10.676)
Autres passifs		(10.537)
Total du passif		(176.459)
Total de l'actif net		127.108.114

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	1.819,435
Classe AEH	54,100
Classe AU	59,094
Classe AUP	63,640
Classe DE	15.027,698
Classe DEH	37.915,284
Classe DU	1.069,760
Classe IE	52,100
Classe IEC	58,100
Classe IEH	54,100
Classe IFH	59,100
Classe IG	17.930,113
Classe IU	57,576
Classe NE	23.087,450
Classe NG	5.919.787,311
Classe NU	1.911.462,394
Classe XG	59,000
Classe ZEH	54,100
Classe ZFH	60,100
Classe ZU	755,717

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		78.667.240
Revenus		
Dividendes, nets	2	1.197.855
Intérêts bancaires	2	3.932
Total des revenus		1.201.787
Charges		
Commissions de gestion	5	(95.896)
Charges d'exploitation	3, 5	(93.195)
Total des charges		(189.091)
Revenu net sur investissements		1.012.696
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(853.228)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(12.348)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(16.572)
(Moins-value) nette réalisée		(882.148)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(2.431.410)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(2.840)
Variation nette de la (moins-value) latente		(2.434.250)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(2.303.702)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		77.312.949
Rachats d'actions		(26.568.342)
Dividendes	7	(31)
Total de l'évolution du capital		50.744.576
Actif net à la fin de l'exercice		127.108.114

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	127.108.114	78.667.240	26.554.871

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	17,3387 ¹	18,2898 ¹	15,2404 ¹
Classe AEH	14,7127 ¹	16,4623 ¹	14,6709 ¹
Classe AU	16,9147	18,2540	16,0663
Classe AUP	15,0962	16,5908	14,8613
Classe DE	17,1314 ¹	18,1073 ¹	15,1186 ¹
Classe DEH	14,5482 ¹	16,3108 ¹	14,5633 ¹
Classe DU	16,7021	18,0794	15,9450
Classe IE	17,6533 ¹	18,5659 ¹	15,4165 ¹
Classe IEC	13,3367 ¹	15,1809 ¹	13,7286 ¹
Classe IEH	14,9688 ¹	16,7198 ¹	14,8479 ¹
Classe IFH	14,7703 ²	16,5489 ²	14,7157 ²
Classe IG	14,6434 ³	14,8037 ³	12,3891 ³
Classe IU	17,2386	18,5671	16,2814
Classe NE	14,2582 ¹	14,9581 ¹	12,3904 ¹
Classe NG	13,7199 ³	13,8493 ³	11,5750 ³
Classe NU	13,1041	14,0857	12,3331
Classe XG	13,7984 ³	13,9108 ³	11,6147 ³
Classe ZEH	14,9070 ¹	16,6597 ¹	14,8103 ¹
Classe ZFH	14,6835 ²	16,4549 ²	14,6448 ²
Classe ZU	17,1426	18,4729	16,2192

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	433.197.682
Avoirs en banque et liquidités	2	1.216.394
À recevoir sur souscriptions		184.892
Intérêts et dividendes nets à recevoir		629.632
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	24.948
Autres actifs		698.502
Total de l'actif		435.952.050
Passifs		
À payer sur rachats		(178.380)
Commissions de gestion à payer	5	(256.815)
Autres passifs		(42.592)
Total du passif		(477.787)
Total de l'actif net		435.474.263

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	138.144,612
Classe ASH	884.938,817
Classe AUH	5.301,591
Classe DE	143.717,026
Classe IE	2.322.201,033
Classe W	30.997,242
Classe XE	1.343.634,723
Classe ZE	646.420,857
Classe ZUH	5.381,483
Classe 1E	2.971.226,626
Classe 1EP	65,000
Classe 1G	160.738,427
Classe 1GP	59,000
Classe 2E	7.299.867,359
Classe 2G	449.433,863
Classe 2U	73,000
Classe 3E	94.817,983
Classe 3G	225.058,394
Classe 3GP	382,218
Classe 4E	416.408,472
Classe 4G	55,000
Classe 8E	215.710,164
Classe 8G	36.280,399
Classe 8U	73,000
Classe 9E	62,000
Classe 9G	56,000
Classe 9GP	57,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		475.145.184
Revenus		
Dividendes, nets	2	11.810.950
Intérêts bancaires	2	8.009
Autres revenus		308
Total des revenus		11.819.267
Charges		
Commissions de gestion	5	(2.947.776)
Intérêts bancaires	2	(9.285)
Charges d'exploitation	3, 5	(528.243)
Total des charges		(3.485.304)
Revenu net sur investissements		8.333.963
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(3.342.840)
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		274.019
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(150.000)
Plus-value nette réalisée sur restitution d'impôt		13
(Moins-value) nette réalisée		(3.218.808)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(5.743.050)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		38.773
Variation nette de la (moins-value) latente		(5.704.277)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(589.122)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		89.195.389
Rachats d'actions		(128.276.955)
Dividendes	7	(233)
Total de l'évolution du capital		(39.081.799)
Actif net à la fin de l'exercice		435.474.263

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	435.474.263	475.145.184	386.572.137

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	83,5774	83,5781	78,4220
Classe ASH	24,5969 ¹	24,0735 ¹	22,3960 ¹
Classe AUH	29,8927 ²	28,9294 ²	26,8262 ²
Classe DE	30,0559	30,1163	28,3149
Classe IE	59,7803	59,3341	55,2576
Classe W	69,9400	70,0340	65,8450
Classe XE	70,2841	69,2730	64,0957
Classe ZE	9,8833	9,8259	–
Classe ZUH	19,6715 ²	18,9486 ²	17,4726 ²
Classe 1E	13,3051	13,3070	12,4836
Classe 1EP	12,3086	12,6891	12,2262
Classe 1G	12,9932 ³	12,4978 ³	11,8186 ³
Classe 1GP	12,0282 ³	11,9244 ³	11,5799 ³
Classe 2E	13,6414	13,5821	12,6844
Classe 2G	13,3206 ³	12,7552 ³	12,0079 ³
Classe 2U	12,7149 ²	12,9544 ²	12,7712 ²
Classe 3E	13,7277	13,6488	12,7289
Classe 3G	13,4053 ³	12,8183 ³	12,0504 ³
Classe 3GP	12,4223 ³	12,2439 ³	11,8079 ³
Classe 4E	14,2809	14,0773	13,0161
Classe 4G	13,9701 ³	13,2403 ³	12,3357 ³
Classe 8E	13,6107	13,5570	12,6660
Classe 8G	13,2969 ³	12,7375 ³	11,9961 ³
Classe 8U	12,6872 ²	12,9310 ²	12,7491 ²
Classe 9E	13,7945	13,7069	12,7770
Classe 9G	13,4619 ³	12,8673 ³	12,0896 ³
Classe 9GP	12,4892 ³	12,3004 ³	11,8602 ³

¹La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	68.880.135
Avoirs en banque et liquidités	2	295.155
À recevoir sur ventes de titres		296.086
À recevoir sur souscriptions		77.762
Intérêts et dividendes nets à recevoir		88.980
Autres actifs		282.411
Total de l'actif		69.920.529
Passifs		
À payer sur achats de titres		(297.591)
À payer sur rachats		(80.199)
Commissions de gestion à payer	5	(47.463)
Autres passifs		(8.533)
Total du passif		(433.786)
Total de l'actif net		69.486.743

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	754,188
Classe AEP	38.312,313
Classe AUP	80,000
Classe DE	1.655,034
Classe DEP	17.413,058
Classe IE	1.179.227,428
Classe IEP	653.490,000
Classe ZE	65,000
Classe ZEP	22.802,000
Classe 1E	3.523.281,743
Classe 1EP	10.397.992,113
Classe 1G	170.467,092
Classe 1GP	329.566,345
Classe 2E	928.650,278
Classe 2EP	72,000
Classe 2G	58,000
Classe 2GP	63,000
Classe 3EP	71.251,006
Classe 3G	71.165,838
Classe 3GP	609.089,451
Classe 4GP	7.350.534,040
Classe 8E	252.431,001
Classe 8EP	860.721,752
Classe 8G	16.041,603
Classe 8GP	478.750,358
Classe 9EP	71,000
Classe 9G	57,000
Classe 9GP	263,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		60.925.035
Revenus		
Dividendes, nets	2	2.269.392
Intérêts bancaires	2	1.219
Autres revenus		140
Total des revenus		2.270.751
Charges		
Commissions de gestion	5	(505.592)
Intérêts bancaires	2	(3.127)
Charges d'exploitation	3, 5	(83.307)
Frais divers	4	(16)
Total des charges		(592.042)
Revenu net sur investissements		1.678.709
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(1.648.741)
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		4.295
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(47.310)
Plus-value nette réalisée sur restitution d'impôt		10
(Moins-value) nette réalisée		(1.691.746)
Variation de la plus-value nette latente sur investissements		1.600.038
Variation nette de la plus-value latente		1.600.038
Augmentation nette de l'actif net résultant des opérations		1.587.001
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		19.534.285
Rachats d'actions		(11.142.711)
Dividendes	7	(1.416.867)
Total de l'évolution du capital		6.974.707
Actif net à la fin de l'exercice		69.486.743

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	69.486.743	60.925.035	72.471.914

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	12,6500	12,2899	12,2123
Classe AEP	10,5858	10,7997	11,1512
Classe AUP	10,4337 ¹	10,9127 ¹	11,9099 ¹
Classe DE	12,4468	12,1356	12,1020
Classe DEP	10,4095	10,6571	11,0429
Classe IE	13,1920	12,6707	12,4632
Classe IEP	11,0419	11,1344	11,3788
Classe ZE	13,0688	12,6183	12,4458
Classe ZEP	10,9401	11,0767	11,3507
Classe 1E	2,0670	2,0062	1,9917
Classe 1EP	1,0503	1,0714	1,1057
Classe 1G	1,8160 ²	1,6952 ²	1,6964 ²
Classe 1GP	0,9240 ²	0,9066 ²	0,9428 ²
Classe 2E	13,0603	12,5994	12,4322
Classe 2EP	10,9561	11,0904	11,3572
Classe 2G	13,0785 ²	12,1240 ²	12,0502 ²
Classe 2GP	10,9385 ²	10,6484 ²	10,9938 ²
Classe 3EP	1,7311	1,7509	1,7928
Classe 3G	1,7759 ²	1,6454 ²	1,6343 ²
Classe 3GP	1,5112 ²	1,4708 ²	1,5182 ²
Classe 4GP	1,3545 ²	1,3081 ²	1,3394 ²
Classe 8E	2,2984	2,2182	2,1897
Classe 8EP	1,1545	1,1693	1,1990
Classe 8G	2,0212 ²	1,8760 ²	1,8667 ²
Classe 8GP	1,0142 ²	0,9875 ²	1,0208 ²
Classe 9EP	11,0341	11,1480	11,4256
Classe 9G	13,1481 ²	12,1739 ²	12,0857 ²
Classe 9GP	11,0089 ²	10,6983 ²	11,0352 ²

¹La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	389.364.672
Avoirs en banque et liquidités	2	1.777.342
À recevoir sur ventes de titres		96.560
À recevoir sur souscriptions		146.277
Intérêts et dividendes nets à recevoir		494.490
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	13.155
Autres actifs	20	698.593
Total de l'actif		392.591.089
Passifs		
À payer sur rachats		(292.531)
Commissions de gestion à payer	5	(455.822)
Autres passifs		(108.173)
Total du passif		(856.526)
Total de l'actif net		391.734.563

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	4.719.667,977
Classe ASH	374.732,185
Classe AUH	11.283,289
Classe DE	1.159.157,536
Classe DUH	275,000
Classe IE	1.679.106,647
Classe W	9.912,171
Classe XE	88,000
Classe ZE	3.323.243,164
Classe ZFH	5.601,004

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	43,8005	50,4135	53,6034
Classe ASH	30,8067 ¹	34,6658 ¹	36,5279 ¹
Classe AUH	12,0652 ²	13,4075 ²	14,0753 ²
Classe DE	38,7886	45,0490	48,3327
Classe DUH	11,5560 ²	12,9610 ²	13,7346 ²
Classe IE	55,8653	63,8189	67,3496
Classe W	73,1946	84,2877	89,6657
Classe XE	9,2026	10,4050	-
Classe ZE	11,2353	12,8349	13,5449
Classe ZFH	10,7434 ³	12,3467 ³	13,0545 ³

¹La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		673.597.948
Revenus		
Dividendes, nets	2	8.465.934
Intérêts bancaires	2	5.659
Autres revenus		233
Total des revenus		8.471.826
Charges		
Commissions de gestion	5	(6.053.423)
Intérêts bancaires	2	(11.620)
Charges d'exploitation	3, 5	(1.434.786)
Total des charges		(7.499.829)
Revenu net sur investissements		971.997
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(2.919.074)
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		615.400
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		44.589
Plus-value nette réalisée sur restitution d'impôt		13
(Moins-value) nette réalisée		(2.259.072)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(84.725.377)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		37.711
Variation nette de la (moins-value) latente		(84.687.666)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(85.974.741)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		48.474.706
Rachats d'actions		(244.363.350)
Total de l'évolution du capital		(195.888.644)
Actif net à la fin de l'exercice		391.734.563

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	391.734.563	673.597.948	967.772.792

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	743.105.034
Avoirs en banque et liquidités	2	2.558.722
À recevoir sur ventes de titres		189.075
À recevoir sur souscriptions		68.562
Intérêts et dividendes nets à recevoir		806.904
Autres actifs		1.831.816
Total de l'actif		748.560.113
Passifs		
À payer sur rachats		(972.164)
(Moins-value) nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	(396.052)
Commissions de gestion à payer	5	(630.516)
Autres passifs		(93.898)
Total du passif		(2.092.630)
Total de l'actif net		746.467.483

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe IE	1.048.877,064
Classe ZE	826.848,727
Classe 1E	19.388.025,495
Classe 1EP	675.169,392
Classe 1FH	200.873,710
Classe 1G	570.489,917
Classe 1UH	1.517.719,944
Classe 2E	15.340.003,969
Classe 2G	56,000
Classe 3E	11.816.237,955
Classe 3EP	936.181,220
Classe 3FH	638.906,591
Classe 3G	1.848.743,337
Classe 3GP	143.890,562
Classe 3UH	749.173,342
Classe 4E	1.785.471,465
Classe 4G	1.832.020,560
Classe 8E	3.611.191,677
Classe 8G	483.570,549
Classe 9E	5.836.490,672
Classe 9EP	64,000
Classe 9FH	23.354,059
Classe 9G	924.438,277
Classe 9GP	57,000
Classe 9UH	98.344,006

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		1.236.395.974
Revenus		
Dividendes, nets	2	17.313.945
Intérêts bancaires	2	5.628
Autres revenus		467
Total des revenus		17.320.040
Charges		
Commissions de gestion	5	(8.397.660)
Intérêts bancaires	2	(14.605)
Charges d'exploitation	3, 5	(1.281.715)
Total des charges		(9.693.980)
Revenu net sur investissements		7.626.060
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(39.497.577)
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		2.912.107
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		143.855
Plus-value nette réalisée sur restitution d'impôt		107
(Moins-value) nette réalisée		(36.441.508)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(105.230.833)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(104.432)
Variation nette de la (moins-value) latente		(105.335.265)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(134.150.713)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		53.526.211
Rachats d'actions		(408.967.070)
Dividendes	7	(336.919)
Total de l'évolution du capital		(355.777.778)
Actif net à la fin de l'exercice		746.467.483

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	746.467.483	1.236.395.974	1.980.272.935

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe IE	10,8544	12,1084	13,0732
Classe ZE	10,5207	11,7537	12,7094
Classe 1E	10,2286	11,4986	12,5109
Classe 1EP	9,5356	10,9343	12,0777
Classe 1FH	10,0750 ¹	11,3955 ¹	12,4182 ¹
Classe 1G	9,9865 ²	10,7968 ²	11,8416 ²
Classe 1UH	11,3113 ³	12,2785 ³	13,1915 ³
Classe 2E	10,5360	11,7673	12,7202
Classe 2G	10,2944 ²	11,0646 ²	12,0514 ²
Classe 3E	10,6150	11,8366	12,7747
Classe 3EP	9,9003	11,2596	12,3346
Classe 3FH	10,4566 ¹	11,7317 ¹	12,6823 ¹
Classe 3G	10,3626 ²	11,1130 ²	12,0901 ²
Classe 3GP	9,6655 ²	10,5711 ²	11,6735 ²
Classe 3UH	11,7341 ³	12,6338 ³	13,4644 ³
Classe 4E	11,0319	12,1985	13,0550
Classe 4G	12,0536 ²	12,8182 ²	13,8285 ²
Classe 8E	10,5187	11,7527	12,7095
Classe 8G	10,2696 ²	11,0354 ²	12,0297 ²
Classe 9E	10,6358	11,8550	12,7895
Classe 9EP	9,9388	11,2856	12,3547
Classe 9FH	10,4765 ¹	11,7487 ¹	12,6978 ¹
Classe 9G	10,3853 ²	11,1328 ²	12,1068 ²
Classe 9GP	9,7133 ²	10,6036 ²	11,7010 ²
Classe 9UH	11,7629 ³	12,6594 ³	13,4863 ³

¹La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

Threadneedle (Lux) - European Select

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	1.533.556.605
Avoirs en banque et liquidités	2	1.015.110
À recevoir sur ventes de titres		7.516.288
À recevoir sur souscriptions		92.605
Intérêts et dividendes nets à recevoir		237.239
Autres actifs	20	3.889.945
Total de l'actif		1.546.307.792
Passifs		
À payer sur achats de titres		(11.637.067)
À payer sur rachats		(538.509)
(Moins-value) nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	(185.379)
Commissions de gestion à payer	5	(1.681.414)
Autres passifs		(175.072)
Total du passif		(14.217.441)
Total de l'actif net		1.532.090.351

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	142.776,027
Classe AGH	19.585,978
Classe AUH	285.078,104
Classe DUH	66,000
Classe IE	515.704,670
Classe ZE	85,000
Classe ZG	15.240,197
Classe ZGH	155.247,985
Classe 1E	73.380.614,792
Classe 1EP	915.057,483
Classe 1SH	1.856.727,524
Classe 1U	31.307,338
Classe 1UH	1.009.285,750
Classe 2E	7.091.555,326
Classe 2EP	57,000
Classe 3E	1.833.432,086
Classe 3U	536.612,311
Classe 8E	1.891.370,362
Classe 8EP	26.200,536
Classe 9E	12.361.174,682
Classe 9U	63,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		1.623.386.971
Revenus		
Dividendes, nets	2	21.675.137
Intérêts bancaires	2	9.751
Autres revenus		1.422
Total des revenus		21.686.310
Charges		
Commissions de gestion	5	(18.786.796)
Intérêts bancaires	2	(17.533)
Charges d'exploitation	3, 5	(1.930.641)
Total des charges		(20.734.970)
Revenu net sur investissements		951.340
Plus-value nette réalisée sur ventes d'investissements		76.966.571
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		1.446.638
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		115.172
Plus-value nette réalisée sur restitution d'impôt		1
Plus-value nette réalisée		78.528.382
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(59.880.932)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(81.852)
Variation nette de la (moins-value) latente		(59.962.784)
Augmentation nette de l'actif net résultant des opérations		19.516.938
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		190.992.480
Rachats d'actions		(301.605.547)
Dividendes	7	(200.491)
Total de l'évolution du capital		(110.813.558)
Actif net à la fin de l'exercice		1.532.090.351

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	1.532.090.351	1.623.386.971	1.641.460.241

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Select

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	30,7946	30,1120	29,4285
Classe AGH	33,4259 ¹	32,2683 ¹	31,3771 ¹
Classe AUH	36,1250 ²	34,1941 ²	33,0305 ²
Classe DUH	15,0044 ²	14,2740 ²	13,8650 ²
Classe IE	45,1332	43,7595	42,4042
Classe ZE	9,3846	9,1184	–
Classe ZG	15,6331 ¹	14,5919 ¹	14,2678 ¹
Classe ZGH	34,7713 ¹	33,3203 ¹	32,1562 ¹
Classe 1E	14,7181	14,3703	14,0231
Classe 1EP	13,7522	13,6418	13,5040
Classe 1SH	15,6546 ³	14,9506 ³	14,4595 ³
Classe 1U	13,8087 ²	13,8075 ²	14,2325 ²
Classe 1UH	16,1804 ²	15,2829 ²	14,7401 ²
Classe 2E	15,1090	14,6652	14,2266
Classe 2EP	14,1356	13,9345	13,7092
Classe 3E	15,2310	14,7570	14,2900
Classe 3U	14,2879 ²	14,1771 ²	14,5014 ²
Classe 8E	15,0828	14,6457	14,2134
Classe 8EP	14,1062	13,9187	13,7016
Classe 9E	15,2571	14,7765	14,3031
Classe 9U	14,3329 ²	14,2172 ²	14,5368 ²

¹La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	1.435.047.467
Avoirs en banque et liquidités	2	2.853.132
À recevoir sur ventes de titres		3.284.167
À recevoir sur souscriptions		109.450
Intérêts et dividendes nets à recevoir		2.475.954
Autres actifs	20	3.421.498
Total de l'actif		1.447.191.668
Passifs		
À payer sur rachats (Moins-value) nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	(483.723) (147.122)
Commissions de gestion à payer	5	(1.668.332)
Autres passifs		(249.686)
Total du passif		(2.548.863)
Total de l'actif net		1.444.642.805

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe IE	853.471,477
Classe ZE	725.351,743
Classe 1E	88.762.917,241
Classe 1EP	3.453.434,339
Classe 1FH	61,000
Classe 2E	1.593.232,507
Classe 3E	4.869.874,696
Classe 3EP	80.358,418
Classe 3FH	778.300,982
Classe 8E	4.705.646,739
Classe 9E	4.769.673,471
Classe 9EP	555.375,000
Classe 9FH	221,000

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe IE	12,0030	12,6494	13,0435
Classe ZE	13,3280	14,0668	14,5269
Classe 1E	12,9677	13,7718	14,3106
Classe 1EP	12,1305	13,1298	13,8388
Classe 1FH	12,7811 ¹	13,6535 ¹	14,2143 ¹
Classe 2E	13,3491	14,0850	14,5412
Classe 3E	13,4001	14,1189	14,5559
Classe 3EP	12,5586	13,4851	14,0994
Classe 3FH	13,2238 ¹	14,0261 ¹	14,4944 ¹
Classe 8E	13,3279	14,0682	14,5297
Classe 9E	13,4533	14,1693	14,6020
Classe 9EP	12,5916	13,5144	14,1156
Classe 9FH	13,2294 ¹	14,0265 ¹	14,4918 ¹

¹La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		1.772.635.200
Revenus		
Dividendes, nets	2	27.358.454
Intérêts bancaires	2	951
Autres revenus		5.535
Total des revenus		27.364.940
Charges		
Commissions de gestion	5	(19.682.801)
Intérêts bancaires	2	(19.473)
Charges d'exploitation	3, 5	(2.944.646)
Total des charges		(22.646.920)
Revenu net sur investissements		4.718.020
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(2.509.703)
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		418.151
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(26.340)
Plus-value nette réalisée sur restitution d'impôt		74
(Moins-value) nette réalisée		(2.117.818)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(119.144.798)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(235.205)
Variation nette de la (moins-value) latente		(119.380.003)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(116.779.801)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		135.397.266
Rachats d'actions		(345.680.393)
Dividendes	7	(929.467)
Total de l'évolution du capital		(211.212.594)
Actif net à la fin de l'exercice		1.444.642.805

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	1.444.642.805	1.772.635.200	1.932.987.086

Au cours de la période de rapport précédente (du 1^{er} octobre 2022 au 31 mars 2023), le portefeuille de Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies Fund a respecté la limite d'investissement du PEA de 75 % minimum en Actions émises dans et cotées sur une Bourse de l'Espace économique européen. Le montant au 31 mars 2023 était de 81,06 %.

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	51.275.240
Avoirs en banque et liquidités	2	372.820
À recevoir sur ventes de titres		103.729
À recevoir sur souscriptions		3.393
Intérêts et dividendes nets à recevoir		244.326
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	68.771
Autres actifs	20	631.332
Total de l'actif		52.699.611
Passifs		
À payer sur achats de titres		(377.585)
À payer sur rachats		(29.699)
Commissions de gestion à payer	5	(34.682)
Autres passifs		(9.336)
Total du passif		(451.302)
Total de l'actif net		52.248.309

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEH	32.759,019
Classe AU	46.890,237
Classe AUP	179.982,457
Classe DEH	161.772,801
Classe DU	44.129,797
Classe DUP	27.505,940
Classe IEP	1.063.069,353
Classe IU	70,000
Classe W	19.129,778
Classe XU	1.307.720,471
Classe XUP	269.785,749
Classe ZG	51,000
Classe ZGH	6.917,198
Classe ZGP	56,000
Classe ZU	100,000
Classe ZUP	3.829,949

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEH	38,9105 ¹	45,2875 ¹	49,6140 ¹
Classe AU	101,8799	114,4216	123,7850
Classe AUP	11,5123	13,4844	15,1272
Classe DEH	27,2703 ¹	31,9765 ¹	35,2821 ¹
Classe DU	48,8592	55,2874	60,2623
Classe DUP	11,1252	13,1305	14,8423
Classe IEP	12,3493 ¹	14,0025 ¹	14,7448 ¹
Classe IU	11,8781	13,2161	14,1867
Classe W	75,1452	84,5649	91,6683
Classe XU	13,3803	14,7814	15,7291
Classe XUP	12,2763	14,1419	15,6032
Classe ZG	13,2498 ²	13,8913 ²	14,2390 ²
Classe ZGH	22,6597 ²	25,8292 ²	27,9288 ²
Classe ZGP	11,1818 ²	12,2208 ²	12,9909 ²
Classe ZU	8,8505	9,8775	—
Classe ZUP	13,5022	15,6966	17,4725

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		52.164.940
Revenus		
Dividendes, nets	2	1.729.457
Intérêts bancaires	2	19.994
Autres revenus		80.154
Total des revenus		1.829.605
Charges		
Commissions de gestion	5	(369.133)
Intérêts bancaires	2	(1.286)
Charges d'exploitation	3, 5	(103.429)
Frais divers	4	(49)
Total des charges		(473.897)
Revenu net sur investissements		1.355.708
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(473.648)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(55.465)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(42.377)
(Moins-value) nette réalisée		(571.490)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(6.288.886)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		25.349
Variation nette de la (moins-value) latente		(6.263.537)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(5.479.319)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		11.931.527
Rachats d'actions		(5.591.220)
Dividendes	7	(777.619)
Total de l'évolution du capital		5.562.688
Actif net à la fin de l'exercice		52.248.309

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

USD	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
	52.248.309	52.164.940	52.863.212

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	619.850.434
Avoirs en banque et liquidités	2	22.576.640
À recevoir sur ventes de titres		1.005.798
À recevoir sur souscriptions		715.198
Intérêts et dividendes nets à recevoir		219.813
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	824.792
Total de l'actif		645.192.675
Passifs		
À payer sur achats de titres		(638.341)
À payer sur rachats		(432.015)
Commissions de gestion à payer	5	(723.544)
Autres passifs		(141.167)
Total du passif		(1.935.067)
Total de l'actif net		643.257.608

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEH	628.244,882
Classe AS	851.750,116
Classe AU	3.117.132,234
Classe AUP	72.094,859
Classe BU	58.486,227
Classe DEH	285.567,362
Classe DU	553.054,756
Classe IE	670.072,960
Classe IEH	1.205.225,041
Classe IG	17.898,636
Classe IU	8.697.335,652
Classe ZEH	108.502,011
Classe ZFH	43.765,815
Classe ZG	32.679,256
Classe ZU	1.299.243,266

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEH	62,5310 ¹	73,7380 ¹	67,4347 ¹
Classe AS	22,3014 ²	25,6949 ²	23,0106 ²
Classe AU	87,0049	98,4809	88,8329
Classe AUP	18,4591	21,0644	19,1460
Classe BU	109,3899	124,3152	112,5857
Classe DEH	17,8847 ¹	21,1515 ¹	19,4109 ¹
Classe DU	127,1439	144,4193	130,7275
Classe IE	15,8873 ¹	17,4019 ¹	14,7271 ¹
Classe IEH	21,4521 ¹	25,0771 ¹	22,7318 ¹
Classe IG	22,0881 ³	23,2680 ³	19,8499 ³
Classe IU	15,5489	17,4419	15,5922
Classe ZEH	17,7747 ¹	20,7904 ¹	18,8611 ¹
Classe ZFH	20,7055 ⁴	24,2713 ⁴	22,0485 ⁴
Classe ZG	22,0003 ³	23,1988 ³	19,8092 ³
Classe ZU	40,1267	45,0572	40,3192

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁴La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		651.663.253
Revenus		
Dividendes, nets	2	3.583.118
Intérêts bancaires	2	255.996
Total des revenus		3.839.114
Charges		
Commissions de gestion	5	(8.210.961)
Intérêts bancaires	2	(8.490)
Charges d'exploitation	3, 5	(1.589.629)
Total des charges		(9.809.080)
(Moins-value) nette sur investissements		(5.969.966)
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(6.152.374)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(5.096.904)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(131.195)
(Moins-value) nette réalisée		(11.380.473)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(60.229.179)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(142.190)
Variation nette de la (moins-value) latente		(60.371.369)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(77.721.808)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		259.575.699
Rachats d'actions		(190.249.085)
Dividendes		(10.451)
Total de l'évolution du capital		69.316.163
Actif net à la fin de l'exercice		643.257.608

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

USD	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
	643.257.608	651.663.253	537.276.170

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 GBP
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	165.486.673
Avoirs en banque et liquidités	2	1.382.334
À recevoir sur souscriptions		350.176
Intérêts et dividendes nets à recevoir		520.056
Autres actifs		126
Total de l'actif		167.739.365
Passifs		
À payer sur rachats		(187.176)
(Moins-value) nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	(117.886)
Commissions de gestion à payer	5	(105.549)
Autres passifs		(27.333)
Total du passif		(437.944)
Total de l'actif net		167.301.421

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	98.316,766
Classe AEH	116.093,974
Classe AFH	7.192,000
Classe AG	390.355,107
Classe AGP	29.929,121
Classe DEH	8.344,846
Classe DG	75.395,788
Classe IE	562.634,940
Classe IEH	163.459,547
Classe IG	2.307.719,116
Classe IGP	221.925,062
Classe NEH	66,000
Classe NFH	73,000
Classe NG	57,000
Classe NGP	57,000
Classe NUH	78,000
Classe TEH	66,000
Classe TFH	73,000
Classe TG	57,000
Classe TGP	57,000
Classe TUH	78,000
Classe ZE	20.941,383
Classe ZEH	74.052,824
Classe ZFH	3.325,000
Classe ZG	147.037,906
Classe ZGP	116.311,257
Classe ZUH	57.569,000
Classe 3EH	1.174.832,427
Classe 3FH	49.785,040
Classe 3UH	1.805.391,582
Classe 9EH	9.707,339
Classe 9EP	2.589.832,979
Classe 9FH	85,000
Classe 9G	11.018,300
Classe 9UH	87,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 GBP
Actif net au début de l'exercice		274.453.238
Revenus		
Dividendes, nets	2	6.780.540
Intérêts bancaires	2	20.563
Total des revenus		6.801.103
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.706.828)
Intérêts bancaires	2	(1.991)
Charges d'exploitation	3, 5	(387.992)
Total des charges		(2.096.811)
Revenu net sur investissements		4.704.292
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(15.237.103)
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		812.976
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(46.033)
(Moins-value) nette réalisée		(14.470.160)
Variation de la plus-value nette latente sur investissements		5.339.132
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(81.045)
Variation nette de la plus-value latente		5.258.087
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(4.507.781)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		99.336.984
Rachats d'actions		(200.652.322)
Dividendes	7	(1.328.698)
Total de l'évolution du capital		(102.644.036)
Actif net à la fin de l'exercice		167.301.421

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
GBP	167.301.421	274.453.238	296.943.244

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	9,4273 ¹	9,3165 ¹	9,2845 ¹
Classe AEH	20,6050 ¹	19,9122 ¹	20,1489 ¹
Classe AFH	9,9885 ²	9,7085 ²	9,8231 ²
Classe AG	29,3049	27,8526	27,9800
Classe AGP	20,7157	20,3018	21,0118
Classe DEH	9,6352 ¹	9,3874 ¹	9,5731 ¹
Classe DG	10,1533	9,7276	9,8507
Classe IE	10,1864 ¹	9,9716 ¹	9,8435 ¹
Classe IEH	31,4994 ¹	30,1611 ¹	30,2322 ¹
Classe IG	43,2514	40,7193	40,5187
Classe IGP	30,8986	29,9926	30,7471
Classe NEH	12,9677 ¹	12,3773 ¹	12,3770 ¹
Classe NFH	12,8955 ²	12,3772 ²	12,3746 ²
Classe NG	13,3079	12,5034	12,4164
Classe NGP	12,4219	12,0225	12,2963
Classe NUH	13,6193 ³	12,6056 ³	12,4477 ³
Classe TEH	12,9563 ¹	12,3724 ¹	12,3766 ¹
Classe TFH	12,8835 ²	12,3703 ²	12,3738 ²
Classe TG	13,3116	12,5042	12,4163
Classe TGP	12,4067	12,0170	12,2962
Classe TUH	13,6152 ³	12,6005 ³	12,4472 ³
Classe ZE	9,6466 ¹	9,4643 ¹	9,3628 ¹
Classe ZEH	12,8699 ¹	12,3480 ¹	12,4008 ¹
Classe ZFH	12,4052 ²	11,9648 ²	12,0143 ²
Classe ZG	28,6161	26,9947	26,9156
Classe ZGP	11,0805	10,7776	11,0735
Classe ZUH	11,8096 ³	10,9752 ³	10,8824 ³
Classe 3EH	1,8386 ¹	1,7608 ¹	1,7651 ¹
Classe 3FH	1,9650 ²	1,8918 ²	1,8962 ²
Classe 3UH	2,3556 ³	2,1863 ³	2,1639 ³
Classe 9EH	11,0302 ¹	10,5479 ¹	10,5716 ¹
Classe 9EP	9,8665 ¹	9,9562 ¹	10,1260 ¹
Classe 9FH	10,9400 ²	10,5292 ²	10,5498 ²
Classe 9G	10,7349	10,1044	10,0527
Classe 9UH	12,1115 ³	11,2422 ³	11,1280 ³

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est la GBP.

²La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est la GBP.

³La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est la GBP.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 GBP
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	239.899.491
Avoirs en banque et liquidités	2	1.042.358
À recevoir sur souscriptions		189.641
Intérêts et dividendes nets à recevoir		927.338
Total de l'actif		242.058.828
Passifs		
À payer sur achats de titres		(209.723)
À payer sur rachats		(737.507)
(Moins-value) nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	(127.950)
Commissions de gestion à payer	5	(141.357)
Autres passifs		(43.098)
Total du passif		(1.259.635)
Total de l'actif net		240.799.193

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	1.692.515,605
Classe AEC	45.167,097
Classe AEH	118.996,596
Classe AG	507.167,095
Classe ASC	133,600
Classe AUC	129.896,783
Classe DE	2.654,203
Classe DEC	12.739,967
Classe DEH	4.780,573
Classe DG	23.717,766
Classe DGP	808,187
Classe IE	1.985.401,134
Classe IEH	20.378,034
Classe IG	200.830,035
Classe IGP	1.607.327,543
Classe IU	645.313,204
Classe IUH	80,000
Classe LG	503.455,553
Classe LGP	12.015.847,668
Classe ZE	16.844,763
Classe ZEH	31.152,710
Classe ZFH	10.046,000
Classe ZG	157.217,621
Classe ZGP	97.189,252
Classe ZUH	66.622,758
Classe 1EH	161.165,641
Classe 1FH	6.518,663
Classe 1UH	80.815,007
Classe 3EH	125.905,573
Classe 3FH	50.377,689
Classe 3UH	210.691,347
Classe 9EH	73,000
Classe 9FH	81,000
Classe 9G	1.162.234,374
Classe 9UH	2.174,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 GBP
Actif net au début de l'exercice		232.631.300
Revenus		
Dividendes, nets	2	9.071.984
Intérêts bancaires	2	17.828
Total des revenus		9.089.812
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.732.551)
Intérêts bancaires	2	(2.409)
Charges d'exploitation	3, 5	(508.689)
Total des charges		(2.243.649)
Revenu net sur investissements		6.846.163
Plus-value nette réalisée sur ventes d'investissements		5.749.225
Plus-value nette réalisée sur contrats de change à terme		1.098.425
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		92.075
Plus-value nette réalisée		6.939.725
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(1.354.375)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(36.239)
Variation nette de la (moins-value) latente		(1.390.614)
Augmentation nette de l'actif net résultant des opérations		12.395.274
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		98.670.788
Rachats d'actions		(97.388.592)
Dividendes	7	(5.509.577)
Total de l'évolution du capital		(4.227.381)
Actif net à la fin de l'exercice		240.799.193

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
GBP	240.799.193	232.631.300	203.529.182

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	12,6013 ¹	12,6812 ¹	11,6608 ¹
Classe AEC	9,4634 ¹	9,6686 ¹	9,3261 ¹
Classe AEH	11,7767 ¹	11,5877 ¹	10,8296 ¹
Classe AG	12,5901	12,1852	11,2947
Classe ASC	10,1010 ²	10,1013 ²	9,6533 ²
Classe AUC	10,7034 ³	10,6068 ³	10,1151 ³
Classe DE	12,0054 ¹	12,1725 ¹	11,2772 ¹
Classe DEC	8,9702 ¹	9,2267 ¹	8,9790 ¹
Classe DEH	11,2144 ¹	11,1182 ¹	10,4678 ¹
Classe DG	11,9968	11,6992	10,9259
Classe DGP	9,9693	10,0965	9,7473
Classe IE	13,3960 ¹	13,3535 ¹	12,1630 ¹
Classe IEH	12,5067 ¹	12,1998 ¹	11,2958 ¹
Classe IG	13,4114	12,8573	11,8052
Classe IGP	10,7517	10,7015	10,1383
Classe IU	12,9928 ³	13,2640 ³	12,7617 ³
Classe IUH	13,7584 ³	13,0077 ³	11,8874 ³
Classe LG	13,5361	12,9575	11,8792
Classe LGP	10,8271	10,7649	10,1870
Classe ZE	13,2311 ¹	13,2156 ¹	12,0615 ¹
Classe ZEH	12,3577 ¹	12,0729 ¹	11,2040 ¹
Classe ZFH	12,1009 ⁴	11,8925 ⁴	11,0386 ⁴
Classe ZG	13,2275	12,7064	11,6899
Classe ZGP	11,1391	11,1107	10,5523
Classe ZUH	14,0566 ³	13,3271 ³	12,2225 ³
Classe 1EH	11,6827 ¹	11,4780 ¹	10,7111 ¹
Classe 1FH	11,5429 ⁴	11,4101 ⁴	10,6537 ⁴
Classe 1UH	12,8308 ³	12,2298 ³	11,2829 ³
Classe 3EH	12,0836 ¹	11,7863 ¹	10,9193 ¹
Classe 3FH	11,9357 ⁴	11,7136 ⁴	10,8540 ⁴
Classe 3UH	13,2761 ³	12,5625 ³	11,5019 ³
Classe 9EH	12,1085 ¹	11,7980 ¹	10,9227 ¹
Classe 9FH	11,9323 ⁴	11,7077 ⁴	10,8516 ⁴
Classe 9G	11,9888	11,4924	10,5508
Classe 9UH	13,2859 ³	12,5653 ³	11,4992 ³

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est la GBP.

²La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est la GBP.

³La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est la GBP.

⁴La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est la GBP.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	23 janvier 2023*	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe IU	3,6523	3,8464	3,8047
Classe ZU	3,6528	3,8469	3,8053

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour la période comptable allant du 1^{er} avril 2022 au 23 janvier 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		1.580.155
Revenus		
Intérêts bancaires	2	12.680
Total des revenus		12.680
Charges		
Charges d'exploitation	3, 5	(4.398)
Total des charges		(4.398)
Revenu net sur investissements		8.282
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(2.396)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(465)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(85.174)
(Moins-value) nette réalisée		(88.035)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(79.753)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		–
Rachats d'actions		(1.500.402)
Total de l'évolution du capital		(1.500.402)
Actif net à la fin de l'exercice		–

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	23 janvier 2023*	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	–	1.580.155	6.857.182

*Voir annexe 1.

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	18.848.174
Avoirs en banque et liquidités	2	2.441.307
À recevoir sur ventes de titres		473.673
À recevoir sur souscriptions		270
Intérêts à recevoir sur swaps	2	12.095
Intérêts et dividendes nets à recevoir		15.834
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	187.055
Autres actifs		6.087
Total de l'actif		21.984.495
Passifs		
À payer sur rachats		(1.393.646)
Intérêts payables sur swaps	2	(28.030)
Dividendes payables sur swaps	2	(31.031)
(Moins-value) nette latente sur swaps	2, 10	(263.301)
(Moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	(613.670)
Commissions de gestion à payer	5	(13.589)
Autres passifs		(3.824)
Total du passif		(2.347.091)
Total de l'actif net		19.637.404

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEH	28.063,946
Classe AFH	764,000
Classe AGH	599,522
Classe AU	134.199,089
Classe DEH	7.908,621
Classe DU	337.015,020
Classe IEH	108.431,798
Classe IGH	26.698,188
Classe IU	67.144,306
Classe XGH	548.081,680
Classe ZE	80,000
Classe ZEH	83,000
Classe ZGH	1.774,835
Classe ZU	100,000

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEH	14,8309 ¹	15,5801 ¹	15,3714 ¹
Classe AFH	13,3909 ²	14,1612 ²	13,9949 ²
Classe AGH	16,1906 ³	16,7573 ³	16,4018 ³
Classe AU	17,2876	17,6966	17,2872
Classe DEH	11,3655 ¹	12,0140 ¹	11,9135 ¹
Classe DU	13,1644	13,5433	13,2965
Classe IEH	21,8492 ¹	22,7694 ¹	22,2720 ¹
Classe IGH	23,6037 ³	24,2352 ³	23,5814 ³
Classe IU	25,1613	25,5384	24,8005
Classe XGH	10,6525 ³	10,8426 ³	10,4372 ³
Classe ZE	11,1038 ¹	11,0174 ¹	10,1161 ¹
Classe ZEH	9,4994 ¹	9,9289 ¹	9,7263 ¹
Classe ZGH	16,1995 ³	16,6367 ³	16,1525 ³
Classe ZU	10,4522	10,6198	10,3329

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		24.741.485
Revenus		
Dividendes, nets	2	211.641
Intérêts bancaires	2	38.266
Produits d'intérêt sur swaps		220.970
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		12.507
Total des revenus		483.384
Charges		
Commissions de gestion	5	(146.935)
Intérêts bancaires	2	(3.916)
Charges de dividendes sur swaps		(139.152)
Charges d'intérêt sur swaps		(144.900)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(54)
Charges d'exploitation	3, 5	(49.932)
Total des charges		(484.889)
(Moins-value) nette sur investissements		(1.505)
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(2.052.470)
Plus-value nette réalisée sur swaps		1.400.931
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(1.659.989)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		1.027.747
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(100.569)
(Moins-value) nette réalisée		(1.384.350)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(799.637)
Variation de la (moins-value) nette latente sur swaps		(122.677)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(31.567)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats à terme standardisés		280.990
Variation nette de la (moins-value) latente		(672.891)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(2.058.746)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		28.670.689
Rachats d'actions		(31.716.024)
Total de l'évolution du capital		(3.045.335)
Actif net à la fin de l'exercice		19.637.404

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	19.637.404	24.741.485	103.961.830

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	405.167.576
Avoirs en banque et liquidités	2	33.693.370
À recevoir sur ventes de titres		1.810.282
À recevoir sur souscriptions		1.157.718
Intérêts à recevoir sur swaps	2	270.548
Intérêts et dividendes nets à recevoir		5.247.913
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	507.363
Total de l'actif		447.854.770
Passifs		
À payer sur achats de titres		(1.117.098)
À payer sur rachats		(4.113.526)
Intérêts payables sur swaps	2	(589.206)
Versement initial reçu sur swaps	2	(51.210)
(Moins-value) nette latente sur swaps	2, 10	(4.837.958)
(Moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	(5.585.899)
Commissions de gestion à payer	5	(233.866)
Autres passifs		(38.490)
Total du passif		(16.567.253)
Total de l'actif net		431.287.517

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	1.141,754
Classe IE	85,000
Classe ZE	88.337,141
Classe 1E	9.677.406,820
Classe 1EP	53.679,268
Classe 1GH	150.695,633
Classe 1UH	184.976,506
Classe 2E	19.766.231,059
Classe 2EP	15.324,613
Classe 2GC	76,000
Classe 2GH	7.383,713
Classe 4GH	165.803,293
Classe 8E	13.992.640,928
Classe 8EP	124.630,995
Classe 8GC	1.303,020
Classe 8GH	433.241,882

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		980.879.073
Revenus		
Dividendes, nets	2	62.755
Intérêts sur obligations, nets	2	24.441.473
Intérêts bancaires	2	30.214
Produits d'intérêt sur swaps		5.069.943
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		390.856
Autres revenus		335
Total des revenus		29.995.576
Charges		
Commissions de gestion	5	(3.853.369)
Intérêts bancaires	2	(242.494)
Charges d'intérêt sur swaps		(17.791.392)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(233.172)
Charges d'exploitation	3, 5	(606.322)
Frais divers	4	(32)
Total des charges		(22.726.781)
Revenu net sur investissements		7.268.795
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(54.999.381)
Plus-value nette réalisée sur swaps		240.798
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(3.739.435)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		59.247.729
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(825.968)
(Moins-value) nette réalisée		(76.257)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(25.387.502)
Variation de la plus-value nette latente sur swaps		15.010.568
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(4.000.444)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(22.180.450)
Variation nette de la (moins-value) latente		(36.557.828)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(29.365.290)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		115.900.966
Rachats d'actions		(635.953.718)
Dividendes	7	(173.514)
Total de l'évolution du capital		(520.226.266)
Actif net à la fin de l'exercice		431.287.517

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	431.287.517	980.879.073	1.105.181.704

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	9,2862	9,7720	–
Classe IE	9,3680	9,8024	–
Classe ZE	9,5447	9,9967	10,2122
Classe 1E	9,3721	9,8622	10,1181
Classe 1EP	7,9045	8,7147	9,2533
Classe 1GH	9,7939 ¹	10,1307 ¹	10,3276 ¹
Classe 1UH	10,1457 ²	10,4460 ²	10,6393 ²
Classe 2E	9,6387	10,0810	10,2797
Classe 2EP	8,1165	8,8919	9,3705
Classe 2GC	8,4780 ¹	9,1211 ¹	9,5453 ¹
Classe 2GH	10,0735 ¹	10,3563 ¹	10,4925 ¹
Classe 4GH	10,3070 ¹	10,5443 ¹	10,6305 ¹
Classe 8E	9,6172	10,0626	10,2650
Classe 8EP	8,1203	8,8993	9,3952
Classe 8GC	8,4801 ¹	9,1415 ¹	9,5801 ¹
Classe 8GH	10,0599 ¹	10,3438 ¹	10,4843 ¹

¹La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	16.460.178
Avoirs en banque et liquidités	2	1.521.050
Intérêts à recevoir sur swaps	2	7.923
Intérêts et dividendes nets à recevoir		165.418
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	79.781
Autres actifs		5.767
Total de l'actif		18.240.117
Passifs		
Intérêts payables sur swaps	2	(17.097)
Versement initial reçu sur swaps	2	(1.722)
(Moins-value) nette latente sur swaps	2, 10	(51.507)
(Moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés	2, 11	(284.885)
Commissions de gestion à payer	5	(1.517)
Autres passifs		(1.739)
Total du passif		(358.467)
Total de l'actif net		17.881.650

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	20.319,717
Classe AFH	92,200
Classe AKH	84,000
Classe ANH	830,000
Classe AUH	572,957
Classe DE	17.592,059
Classe IE	373.561,836
Classe IEP	89,999
Classe IGH	67,800
Classe INH	826,000
Classe IU	92,000
Classe IUH	90,000
Classe JE	80,997
Classe JGH	67,800
Classe JUH	91,000
Classe LE	9.581,001
Classe LEP	89,000
Classe LGH	67,800
Classe XE	3.298,170
Classe XGH	1.211.045,797
Classe XUH	92,000
Classe YE	82,001
Classe YGH	68,800
Classe YUH	91,000
Classe ZE	81,997
Classe ZFH	90,200
Classe ZGH	67,800
Classe ZUH	91,000

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		44.628.404
Revenus		
Intérêts sur obligations, nets	2	876.866
Intérêts bancaires	2	9.466
Produits d'intérêt sur swaps		238.028
Produits d'intérêt sur contrats à terme standardisés		34.904
Autres revenus		2
Total des revenus		1.159.266
Charges		
Commissions de gestion	5	(13.515)
Intérêts bancaires	2	(13.140)
Charges d'intérêt sur swaps		(670.289)
Charges d'intérêt sur contrats à terme standardisés		(24.740)
Charges d'exploitation	3, 5	(37.233)
Frais divers	4	(15)
Total des charges		(758.932)
Revenu net sur investissements		400.334
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(4.007.497)
Plus-value nette réalisée sur swaps		219.915
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(1.605.494)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		3.542.882
Plus-value nette réalisée sur opérations de change		294.877
(Moins-value) nette réalisée		(1.555.317)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(75.423)
Variation de la plus-value nette latente sur swaps		342.495
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		102.049
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats à terme standardisés		(1.315.904)
Variation nette de la (moins-value) latente		(946.783)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(2.101.766)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		4.326.430
Rachats d'actions		(28.971.361)
Dividendes	7	(57)
Total de l'évolution du capital		(24.644.988)
Actif net à la fin de l'exercice		17.881.650

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	17.881.650	44.628.404	53.361.804

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	9,3843	9,9429	10,2349
Classe AFH	9,1791 ¹	9,8101 ¹	10,1268 ¹
Classe AKH	94,5085 ²	99,6323 ²	102,3358 ²
Classe ANH	9,7009 ³	10,1446 ³	10,3661 ³
Classe AUH	10,2804 ⁴	10,6635 ⁴	10,8977 ⁴
Classe DE	9,1244	9,7208	10,0608
Classe IE	9,6940	10,2044	10,4353
Classe IEP	8,2812	9,0524	9,4983
Classe IGH	10,1721 ⁵	10,5320 ⁵	10,6920 ⁵
Classe INH	9,8776 ³	10,2572 ³	10,4013 ³
Classe IU	9,3333 ⁴	10,0660 ⁴	10,8726 ⁴
Classe IUH	10,5992 ⁴	10,9297 ⁴	11,0910 ⁴
Classe JE	9,6769	10,1884	10,4159
Classe JGH	10,1878 ⁵	10,5456 ⁵	10,6939 ⁵
Classe JUH	10,5575 ⁴	10,8783 ⁴	11,0321 ⁴
Classe LE	9,7648	10,2635	10,4800
Classe LEP	8,4066	9,1580	9,5877
Classe LGH	10,2762 ⁵	10,6048 ⁵	10,7382 ⁵
Classe XE	10,0968	10,5895	10,7859
Classe XGH	9,9837 ⁵	10,2913 ⁵	10,4148 ⁵
Classe XUH	10,4837 ⁴	10,7628 ⁴	10,8737 ⁴
Classe YE	9,6238	10,1443	10,3910
Classe YGH	10,1032 ⁵	10,4650 ⁵	10,6432 ⁵
Classe YUH	10,4761 ⁴	10,8066 ⁴	10,9872 ⁴
Classe ZE	9,5978	10,1272	10,3835
Classe ZFH	9,3880 ¹	9,9880 ¹	10,2620 ¹
Classe ZGH	10,1022 ⁵	10,4758 ⁵	10,6642 ⁵
Classe ZUH	10,5291 ⁴	10,8614 ⁴	11,0490 ⁴

¹La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en SEK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en NOK. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

⁴La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

⁵La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	75.567.235
Avoirs en banque et liquidités	2	4.164.050
À recevoir sur ventes de titres		584.521
À recevoir sur souscriptions		197
Intérêts à recevoir sur swaps	2	2.308.535
Intérêts et dividendes nets à recevoir		52.014
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	47.139
Autres actifs		230.192
Total de l'actif		82.953.883
Passifs		
À payer sur rachats		(1.581.523)
Intérêts payables sur swaps	2	(1.183.975)
Dividendes payables sur swaps	2	(255.219)
(Moins-value) nette latente sur swaps	2, 10	(1.748.411)
Commissions de gestion à payer	5	(79.651)
Autres passifs		(19.189)
Total du passif		(4.867.968)
Total de l'actif net		78.085.915

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AE	1.591.069,034
Classe AEP	28.481,437
Classe AUH	77,000
Classe DE	2.051.414,732
Classe IE	892.897,803
Classe IGH	13.209,827
Classe LE	1.044.554,591
Classe XGH	377.248,938
Classe ZE	144.712,555
Classe ZF	76,000
Classe ZFH	77,000
Classe ZGH	57,000

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AE	12,3069	12,1389	11,9823
Classe AEP	12,3610	12,3867	12,3580
Classe AUH	13,7357 ¹	13,1642 ¹	12,8933 ¹
Classe DE	11,8833	11,7798	11,7839
Classe IE	12,9068	12,6164	12,5007
Classe IGH	13,4607 ²	12,9699 ²	12,7513 ²
Classe LE	13,1617	12,8174	12,6752
Classe XGH	14,9610 ²	14,3002 ²	13,8662 ²
Classe ZE	12,9456	12,6671	12,5092
Classe ZF	11,4147 ³	11,5379 ³	12,2367 ³
Classe ZFH	12,0814 ³	11,9019 ³	11,8267 ³
Classe ZGH	13,5842 ²	13,1142 ²	12,7204 ²

¹La Classe est libellée en USD. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

²La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

³La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'EUR.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 EUR
Actif net au début de l'exercice		123.839.076
Revenus		
Dividendes, nets	2	2.511.785
Intérêts bancaires	2	10.530
Produits d'intérêt sur swaps		447.056
Autres revenus		166
Total des revenus		2.969.537
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.069.086)
Intérêts bancaires	2	(11.172)
Charges de dividendes sur swaps		(1.598.311)
Charges d'intérêt sur swaps		(405.869)
Charges d'exploitation	3, 5	(264.971)
Total des charges		(3.349.409)
(Moins-value) nette sur investissements		(379.872)
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(1.742.027)
Plus-value nette réalisée sur swaps		729.073
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(336.440)
Plus-value nette réalisée sur contrats à terme standardisés		39.653
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(36.291)
Plus-value nette réalisée sur restitution d'impôt		20
(Moins-value) nette réalisée		(1.346.012)
Variation de la plus-value nette latente sur investissements		3.181.145
Variation de la (moins-value) nette latente sur swaps		(1.701.408)
Variation de la plus-value nette latente sur contrats de change à terme		46.192
Variation nette de la plus-value latente		1.525.929
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(199.955)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		8.746.159
Rachats d'actions		(54.293.849)
Dividendes	7	(5.516)
Total de l'évolution du capital		(45.553.206)
Actif net à la fin de l'exercice		78.085.915

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
EUR	78.085.915	123.839.076	235.387.755

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	87.795.769
Avoirs en banque et liquidités	2	1.783.847
À recevoir sur souscriptions		18.109
Intérêts à recevoir sur swaps	2	14.721
Intérêts et dividendes nets à recevoir		76.770
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	21.617
Total de l'actif		89.710.833
Passifs		
À payer sur rachats		(52.820)
Intérêts payables sur swaps	2	(43.535)
Dividendes payables sur swaps	2	(83.311)
(Moins-value) nette latente sur swaps	2, 10	(570.509)
Commissions de gestion à payer	5	(77.684)
Autres passifs		(12.005)
Total du passif		(839.864)
Total de l'actif net		88.870.969

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEH	977,889
Classe AU	1.892,784
Classe DEH	343,599
Classe DU	21.360,497
Classe IU	221.932,376
Classe ZU	57,000
Classe 1E	3.140.918,553
Classe 1EH	368.566,336
Classe 1U	1.122.973,971
Classe 2E	2.804,467
Classe 2U	186,000
Classe 3U	45.196,000
Classe 8E	295.471,699
Classe 8U	1.324.966,558
Classe 9U	2.334.763,880

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEH	13,5117 ¹	16,4272 ¹	14,7944 ¹
Classe AU	14,8565	17,4066	15,4832
Classe DEH	13,2239 ¹	16,1610 ¹	14,6365 ¹
Classe DU	14,5400	17,1211	15,3058
Classe IU	15,4273	17,9132	15,7911
Classe ZU	15,3226	17,8411	15,7432
Classe 1E	7,1058 ¹	8,1204 ¹	6,8306 ¹
Classe 1EH	4,9237 ¹	5,9805 ¹	5,3803 ¹
Classe 1U	7,7187	9,0336	8,0266
Classe 2E	16,2312 ¹	18,3931 ¹	15,3339 ¹
Classe 2U	15,4950	17,9863	15,8326
Classe 3U	4,3987	5,1096	4,5061
Classe 8E	7,9140 ¹	8,9701 ¹	7,4837 ¹
Classe 8U	8,5451	9,9191	8,7414
Classe 9U	15,4564	17,9452	15,8025

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		125.198.445
Revenus		
Dividendes, nets	2	867.205
Intérêts bancaires	2	56.579
Produits d'intérêt sur swaps		617.072
Total des revenus		1.540.856
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.186.291)
Intérêts bancaires	2	(2.845)
Charges de dividendes sur swaps		(189.375)
Charges d'intérêt sur swaps		(818.868)
Charges d'exploitation	3, 5	(163.437)
Total des charges		(2.360.816)
(Moins-value) nette sur investissements		(819.960)
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(7.865.121)
Plus-value nette réalisée sur swaps		1.255.583
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(133.731)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(22)
(Moins-value) nette réalisée		(6.743.291)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(10.789.450)
Variation de la (moins-value) nette latente sur swaps		(40.473)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(3.840)
Variation nette de la (moins-value) latente		(10.833.763)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(18.397.014)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		44.296.113
Rachats d'actions		(62.226.575)
Total de l'évolution du capital		(17.930.462)
Actif net à la fin de l'exercice		88.870.969

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	88.870.969	125.198.445	112.622.890

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	73.822.965
Avoirs en banque et liquidités	2	2.184.180
Dépôts à terme	2, 19	4.915.320
À recevoir sur souscriptions		910
Intérêts à recevoir sur swaps	2	236.043
Dividendes à recevoir sur swaps		206.059
Intérêts et dividendes nets à recevoir		118.389
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	1.694
Plus-value nette latente sur swaps	2, 10	853.780
Autres actifs	20	60.049
Total de l'actif		82.399.389
Passifs		
À payer sur achats de titres		(872.576)
À payer sur rachats		(294)
Intérêts payables sur swaps	2	(436.682)
Commissions de gestion à payer	5	(97.327)
Autres passifs		(12.478)
Total du passif		(1.419.357)
Total de l'actif net		80.980.032

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEH	52,000
Classe AU	19.215,185
Classe DEH	12.023,296
Classe DU	618,597
Classe IU	94.720,000
Classe ZU	58,000
Classe 1E	14.092.034,832
Classe 1U	852.580,848
Classe 2E	52,000
Classe 2U	517,284
Classe 8E	313.153,819
Classe 8U	177.502,303

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEH	12,3134 ¹	14,5886 ¹	15,0223 ¹
Classe AU	13,5426	15,4367	15,6740
Classe DEH	12,1476 ¹	14,4782 ¹	14,9762 ¹
Classe DU	13,3338	15,2753	15,5884
Classe IU	14,2037	16,0451	16,1456
Classe ZU	14,0143	15,8776	15,9900
Classe 1E	4,7036 ¹	5,2295 ¹	5,0213 ¹
Classe 1U	5,1181	5,8275	5,9106
Classe 2E	14,7996 ¹	16,3297 ¹	15,5305 ¹
Classe 2U	14,1217	15,9419	16,0307
Classe 8E	5,2661 ¹	5,8070 ¹	5,5302 ¹
Classe 8U	5,7939	6,5431	6,5821

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		99.127.304
Revenus		
Dividendes, nets	2	912.758
Intérêts bancaires	2	215.605
Produits de dividendes sur swaps		700
Produits d'intérêt sur swaps		401.410
Total des revenus		1.530.473
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.197.855)
Intérêts bancaires	2	(6.624)
Charges d'intérêt sur swaps		(940.114)
Charges d'exploitation	3, 5	(154.011)
Total des charges		(2.298.604)
(Moins-value) nette sur investissements		(768.131)
(Moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements		(3.376.590)
Plus-value nette réalisée sur swaps		455.385
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(46.571)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(70.125)
(Moins-value) nette réalisée		(3.037.901)
Variation de la (moins-value) nette latente sur investissements		(7.302.213)
Variation de la (moins-value) nette latente sur swaps		(1.011.932)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(12.645)
Variation nette de la (moins-value) latente		(8.326.790)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(12.132.822)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		5.708.287
Rachats d'actions		(11.722.737)
Total de l'évolution du capital		(6.014.450)
Actif net à la fin de l'exercice		80.980.032

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	80.980.032	99.127.304	209.555.266

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

ÉTAT DE L'ACTIF NET

au 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actifs		
Portefeuille-titres à la valeur de marché	2	187.368.122
Avoirs en banque et liquidités	2	4.981.820
Intérêts à recevoir sur swaps	2	4.030.635
À recevoir sur souscriptions		7.821
Intérêts et dividendes nets à recevoir		27.935
Plus-value nette latente sur contrats de change à terme	2, 9	1.107.623
Plus-value nette latente sur swaps	2, 10	2.142.039
Total de l'actif		199.665.995
Passifs		
À payer sur rachats		(115.274)
Intérêts payables sur swaps	2	(2.953)
Commissions de gestion à payer	5	(72.655)
Autres passifs		(19.579)
Total du passif		(210.461)
Total de l'actif net		199.455.534

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Classe AEH	277.991,211
Classe AFH	225.781,729
Classe AGH	72.671,597
Classe ASH	725.225,281
Classe AU	753.136,039
Classe DEH	205.173,512
Classe DU	397.240,047
Classe IEH	364.809,006
Classe IG	64,000
Classe IGH	2.688.419,609
Classe IU	347.435,513
Classe NG	22.574,043
Classe XU	4.793.550,062
Classe ZEH	24.307,319
Classe ZFH	160,000
Classe ZGH	237.629,581
Classe ZU	106.450,500

ÉTAT DES OPÉRATIONS ET DE LA VARIATION DE L'ACTIF NET

pour l'exercice clos le 31 mars 2023

	Annexes	2023 USD
Actif net au début de l'exercice		547.084.733
Revenus		
Intérêts sur obligations, nets	2	6.279.369
Intérêts bancaires	2	457.874
Produits d'intérêt sur swaps		61.628
Total des revenus		6.798.871
Charges		
Commissions de gestion	5	(1.178.446)
Intérêts bancaires	2	(17.307)
Charges d'intérêt sur swaps		(747.896)
Charges d'exploitation	3, 5	(512.069)
Frais divers	4	(1.194)
Total des charges		(2.456.912)
Revenu net sur investissements		4.341.959
Plus-value nette réalisée sur ventes d'investissements		496.955
(Moins-value) nette réalisée sur swaps		(24.565.363)
(Moins-value) nette réalisée sur contrats de change à terme		(7.805.231)
(Moins-value) nette réalisée sur les opérations de change		(587.061)
(Moins-value) nette réalisée		(32.460.700)
Variation de la plus-value nette latente sur investissements		346.974
Variation de la (moins-value) nette latente sur swaps		(15.715.092)
Variation de la (moins-value) nette latente sur contrats de change à terme		(99.296)
Variation nette de la (moins-value) latente		(15.467.414)
(Diminution) nette de l'actif net résultant des opérations		(43.586.155)
Évolution du capital		
Souscriptions d'actions		104.380.461
Rachats d'actions		(408.423.505)
Total de l'évolution du capital		(304.043.044)
Actif net à la fin de l'exercice		199.455.534

VALEUR NETTE D'INVENTAIRE TOTALE

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
USD	199.455.534	547.084.733	528.893.598

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

ÉTAT DE LA VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

	31 mars 2023	31 mars 2022	31 mars 2021
Classe AEH	10,6456 ¹	12,2529 ¹	8,4906 ¹
Classe AFH	7,7799 ²	9,0157 ²	6,2739 ²
Classe AGH	11,5943 ³	13,1736 ³	9,0951 ³
Classe ASH	6,1489 ⁴	6,9266 ⁴	4,7702 ⁴
Classe AU	13,0569	14,5604	10,0129
Classe DEH	8,0276 ¹	9,2625 ¹	6,4457 ¹
Classe DU	9,8496	11,0114	7,6039
Classe IEH	15,8324 ¹	18,1687 ¹	12,4903 ¹
Classe IG	14,7608 ³	15,4257 ³	10,0476 ³
Classe IGH	17,2065 ³	19,4921 ³	13,3493 ³
Classe IU	19,3974	21,5661	14,7124
Classe NG	14,3316 ³	14,9110 ³	9,6735 ³
Classe XU	20,8308	22,9751	15,5436
Classe ZEH	6,6838 ¹	7,6710 ¹	5,2751 ¹
Classe ZFH	6,3961 ²	7,3902 ²	5,1075 ²
Classe ZGH	9,8431 ³	11,1531 ³	7,6437 ³
Classe ZU	7,9952	8,8906	6,0682

¹La Classe est libellée en EUR. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

²La Classe est libellée en CHF. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

³La Classe est libellée en GBP. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

⁴La Classe est libellée en SGD. La devise de référence du Portefeuille est l'USD.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations				Obligations (suite)					
Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
AUSTRALIE				ÎLES CAÏMANS (suite)					
EUR	3.708.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	2.970.329	0,35	USD	1.200.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	1.002.923	0,12
EUR	2.019.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	1.673.550	0,20	Total Îles Caïmans			9.955.465	1,19
EUR	1.030.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	1.061.276	0,13	DANEMARK				
USD	1.916.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	1.825.133	0,22	EUR	576.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	551.820	0,07
USD	3.331.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 25/11/2035	2.579.561	0,31	USD	7.770.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	6.804.499	0,81
EUR	1.539.000	Goodman Australia Finance Pty Limited 1.38% 27/09/2025	1.534.423	0,18	Total Danemark			7.356.319	0,88
EUR	5.868.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	6.522.790	0,79	FINLANDE				
USD	2.597.000	SGSP Australia Assets Pty 3.50% 07/07/2027	2.431.441	0,29	EUR	5.711.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	5.261.236	0,63
USD	7.087.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	6.842.357	0,83	Total Finlande			5.261.236	0,63
Total Australie			27.440.860	3,30	FRANCE				
BERMUDES				FRANCE (suite)					
USD	3.035.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	2.845.396	0,34	USD	2.674.000	BNP Paribas SA FRN 15/09/2029	2.233.041	0,27
Total Bermudes			2.845.396	0,34	USD	1.500.000	BNP Paribas SA FRN 20/01/2033	1.259.368	0,15
CANADA				FRANCE (suite)					
USD	2.137.000	Enbridge Inc. 5.70% 08/03/2033	2.225.878	0,27	USD	4.346.000	BNP Paribas SA FRN 13/01/2029	4.349.000	0,52
Total Canada			2.225.878	0,27	EUR	3.200.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	2.503.650	0,30
ÎLES CAÏMANS				FRANCE (suite)					
USD	732.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	623.927	0,07	USD	2.317.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	2.032.777	0,24
GBP	2.333.000	Southern Water Services Finance Limited 1.63% 30/03/2027	2.496.647	0,30	USD	567.000	BPCE SA FRN 19/07/2033	556.767	0,07
GBP	2.472.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	2.647.544	0,32	GBP	5.500.000	Credit Agricole SA 4.88% 23/10/2029	6.714.970	0,81
GBP	1.840.000	Southern Water Services Finance Limited 3.00% 28/05/2037	1.675.156	0,20	EUR	3.800.000	Electricite de France SA 4.25% 25/01/2032	4.099.845	0,49
USD	566.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	373.842	0,04	EUR	400.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	426.233	0,05
USD	1.208.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	1.135.426	0,14	EUR	2.451.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	2.171.395	0,26
Total Îles Caïmans			11.113.150	1,33	EUR	2.600.000	SANEF SA 1.88% 16/03/2026	2.687.507	0,33
				Total France				29.034.553	3,49
				ALLEMAGNE					
				EUR	1.700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	1.526.753	0,18	
				EUR	6.800.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	5.460.603	0,64	
				EUR	2.500.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	2.768.797	0,33	
				EUR	3.700.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	3.310.974	0,40	
				EUR	1.500.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	1.533.680	0,18	
				EUR	884.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	901.333	0,11	

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ALLEMAGNE (suite)				ITALIE					
EUR	1.700.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	1.457.962	0,17	EUR	1.066.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	975.992	0,11
USD	3.657.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	2.828.803	0,34	EUR	901.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	849.008	0,10
EUR	1.300.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	1.350.626	0,16	EUR	1.889.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	1.664.353	0,20
EUR	200.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	207.789	0,02	EUR	232.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	249.141	0,03
USD	469.000	Deutsche Bank AG FRN 10/02/2034	436.877	0,05	EUR	773.000	ENI SpA - Perp FRN	701.694	0,08
EUR	1.800.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.498.810	0,18	USD	300.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	262.262	0,03
EUR	200.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	172.183	0,02			Total Italie	4.702.450	0,55
EUR	100.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	73.786	0,01			JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES		
EUR	1.300.000	Vier Gas Transport GmbH 1.50% 25/09/2028	1.254.932	0,15	USD	1.647.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	1.357.308	0,16
EUR	2.000.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	2.184.341	0,26	USD	2.563.645	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	2.086.783	0,25
EUR	2.900.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	3.254.879	0,39	GBP	1.130.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	1.488.963	0,17
EUR	1.691.000	Volkswagen Leasing GmbH 0.63% 19/07/2029	1.477.507	0,18			Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	4.933.054	0,58
EUR	2.800.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	2.594.834	0,31			LUXEMBOURG		
EUR	1.300.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	1.324.647	0,16	EUR	2.000.000	Aroundtown SA 0.00% 16/07/2026	1.546.363	0,19
		Total Allemagne	35.620.116	4,24	EUR	3.400.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.479.657	0,30
		INDE			EUR	1.500.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	1.014.596	0,12
USD	2.164.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.655.588	0,20	GBP	1.234.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	964.527	0,12
USD	1.580.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	1.387.652	0,17	USD	2.054.000	Aroundtown SA 5.38% 21/03/2029	1.524.915	0,18
		Total Inde	3.043.240	0,37	EUR	2.804.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.33% 13/08/2028	2.564.325	0,31
		IRLANDE			EUR	2.014.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	2.031.051	0,24
EUR	2.019.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.989.501	0,24	EUR	7.100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	5.453.963	0,65
EUR	1.954.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	1.982.423	0,24	USD	2.388.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	2.461.247	0,30
EUR	2.111.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	1.971.910	0,24	EUR	3.288.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	2.686.629	0,32
EUR	3.365.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	3.101.230	0,37	EUR	1.858.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	1.518.174	0,18
EUR	2.243.000	Glencore Capital Finance DAC 0.75% 01/03/2029	1.973.789	0,24	EUR	1.851.000	Prologis International Funding II SA 0.75% 23/03/2033	1.335.601	0,16
		Total Irlande	11.018.853	1,33					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
LUXEMBOURG (suite)				PAYS-BAS (suite)					
EUR	3.746.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	3.740.699	0,45	EUR	2.200.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	1.795.210	0,22
		Total Luxembourg	29.321.747	3,52	GBP	1.300.000	Volkswagen Financial Services NV 1.38% 14/09/2028	1.310.205	0,16
PAYS-BAS				Total Pays-Bas					
EUR	1.101.000	ABB Finance BV 3.25% 16/01/2027	1.192.730	0,14	GBP	1.200.000	Volkswagen Financial Services NV 2.13% 18/01/2028	1.283.937	0,15
EUR	302.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	258.636	0,03	EUR	1.000.000	Vonovia Finance BV 1.00% 28/01/2041	527.554	0,06
EUR	765.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	862.923	0,10	EUR	1.987.000	Wolters Kluwer NV 3.75% 03/04/2031	2.171.716	0,26
USD	1.977.000	Braskem Netherlands Finance BV 7.25% 13/02/2033	1.910.185	0,23			Total Pays-Bas	44.789.446	5,39
EUR	4.593.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	3.896.608	0,47	NORVÈGE				
EUR	1.193.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	913.612	0,11	EUR	1.795.000	DNB Bank ASA FRN 18/01/2028	1.732.797	0,21
EUR	1.379.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	1.056.053	0,13	USD	2.599.000	DNB Bank ASA 1.13% 16/09/2026	2.333.680	0,28
GBP	3.381.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	4.408.849	0,53	EUR	1.967.000	DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	2.102.443	0,25
USD	279.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	305.628	0,04			Total Norvège	6.168.920	0,74
USD	1.067.000	EDP Finance BV 6.30% 11/10/2027	1.114.197	0,13	ESPAGNE				
USD	1.355.000	Enel Finance International NV 6.80% 14/10/2025	1.404.353	0,17	EUR	700.000	Banco de Sabadell SA FRN 10/11/2028	764.205	0,09
USD	2.159.000	ING Groep NV FRN 28/03/2033	1.973.162	0,24	GBP	1.500.000	Banco Santander SA FRN 30/08/2028	1.800.275	0,22
EUR	1.387.000	Nederlandse Gasunie NV 3.38% 11/07/2034	1.467.426	0,18	GBP	3.000.000	Banco Santander SA 5.13% 25/01/2030	3.645.583	0,44
EUR	617.000	Nederlandse Gasunie NV 3.38% 11/07/2034	652.777	0,08	EUR	309.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	313.631	0,04
EUR	1.870.000	Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	1.490.259	0,18	USD	1.503.000	Telefonica Emisiones SA 5.21% 08/03/2047	1.316.538	0,16
EUR	1.379.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	1.241.734	0,15			Total Espagne	7.840.232	0,95
EUR	618.000	Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	625.679	0,08	SUÈDE				
EUR	1.391.000	Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	1.408.283	0,17	EUR	3.521.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	3.109.547	0,37
EUR	4.823.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	4.411.810	0,53	EUR	136.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	143.941	0,02
EUR	1.000.000	Telefonica Europe BV FRN 12/05/2169	854.138	0,10			Total Suède	3.253.488	0,39
EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 12/05/2170	85.414	0,01	SUISSE				
EUR	1.000.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	1.108.425	0,13	EUR	1.346.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	1.153.954	0,14
EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	637.756	0,08	USD	4.470.000	Credit Suisse AG 5.00% 09/07/2027	4.307.963	0,52
EUR	4.355.000	Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	4.420.187	0,53	USD	5.276.000	Credit Suisse Group AG FRN 14/05/2032	4.251.058	0,51
					USD	1.650.000	Credit Suisse Group AG FRN 01/04/2031	1.466.933	0,18

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
SUISSE (suite)				ROYAUME-UNI (suite)					
USD	1.630.000	UBS Group AG Perp FRN	1.548.839	0,19	GBP	520.000	London Power Networks plc 6.13% 07/06/2027	667.166	0,08
		Total Suisse	12.728.747	1,54	GBP	637.000	National Gas Transmission plc 5.75% 05/04/2035	795.855	0,10
ROYAUME-UNI									
GBP	2.456.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	2.452.147	0,29	EUR	2.038.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	2.171.674	0,26
EUR	1.459.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	1.598.336	0,19	EUR	5.508.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	4.588.410	0,55
USD	691.000	Anglo American Capital plc 4.75% 16/03/2052	585.022	0,07	EUR	780.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	649.775	0,08
USD	9.062.000	Bae Systems plc 3.40% 15/04/2030	8.330.032	1,00	GBP	1.077.000	National Grid Electricity Transmission plc 1.13% 07/07/2028	1.096.602	0,13
USD	2.756.000	Barclays plc FRN 24/11/2032	2.197.182	0,26	GBP	1.000.000	National Grid Gas plc 1.13% 14/01/2033	830.835	0,10
USD	2.314.000	Barclays plc FRN 09/08/2033	2.288.507	0,27	EUR	3.177.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	2.794.188	0,33
GBP	509.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	517.814	0,06	USD	3.661.000	Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	3.223.298	0,39
USD	2.278.000	BP Capital Markets plc FRN 22/09/2168	2.185.025	0,26	GBP	1.654.000	NatWest Markets plc 6.38% 08/11/2027	2.127.392	0,26
EUR	2.269.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	2.285.597	0,27	EUR	2.980.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	2.727.026	0,33
EUR	1.636.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	1.450.886	0,18	GBP	2.490.000	Northumbrian Water Finance plc 2.38% 05/10/2027	2.745.475	0,33
GBP	840.000	Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	1.008.486	0,12	GBP	1.126.000	Northumbrian Water Finance plc 6.38% 28/10/2034	1.500.175	0,18
GBP	530.000	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	611.270	0,07	GBP	783.000	Phoenix Group Holdings plc 5.63% 28/04/2031	877.565	0,11
EUR	1.237.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	1.084.241	0,13	GBP	420.000	Santander UK plc Perp 10.06%	753.216	0,09
EUR	951.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	833.559	0,10	GBP	587.000	Severn Trent Utilities Finance plc 5.25% 04/04/2036	720.417	0,09
GBP	1.820.000	Cadent Finance plc 2.25% 10/10/2035	1.585.285	0,19	GBP	1.121.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.241.193	0,15
USD	5.993.000	Diageo Capital plc 5.50% 24/01/2033	6.503.538	0,79	GBP	136.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	150.582	0,02
GBP	2.826.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	3.012.149	0,36	GBP	457.237	Tesco Property Finance 1 plc 7.62% 13/07/2039	639.651	0,08
EUR	3.633.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	3.550.061	0,43	GBP	826.985	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	1.013.427	0,12
EUR	479.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	507.302	0,06	GBP	1.256.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	1.375.183	0,16
EUR	28.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	29.654	0,00	EUR	3.407.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	3.200.477	0,38
USD	7.628.000	HSBC Holdings plc FRN 22/11/2032	6.221.725	0,75	GBP	1.133.000	Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	1.168.874	0,14
USD	2.899.000	HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	2.873.270	0,34					
USD	1.591.000	HSBC Holdings plc FRN 09/03/2044	1.687.139	0,20					
GBP	2.158.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	2.806.267	0,34					
GBP	378.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	407.091	0,05					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ROYAUME-UNI (suite)					ÉTATS-UNIS (suite)				
GBP	700.000	Virgin Money UK plc FRN 22/06/2025	823.660	0,10	USD	7.825.000	Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	6.537.599	0,78
EUR	2.112.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	2.188.920	0,26	USD	4.487.000	Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	3.802.536	0,46
GBP	1.282.000	Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	1.565.513	0,19	USD	1.669.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	1.488.010	0,18
GBP	1.070.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	1.249.594	0,15	USD	2.355.000	Bayer US Finance II LLC 4.63% 25/06/2038	2.159.457	0,26
		Total Royaume-Uni	99.497.728	11,94	GBP	2.479.000	Becton Dickinson & Company 3.02% 24/05/2025	2.938.938	0,35
ÉTATS-UNIS					USD	6.186.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/03/2052	5.212.577	0,62
USD	3.098.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	2.737.985	0,33	USD	2.011.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	1.487.504	0,18
USD	916.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	884.754	0,11	USD	950.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	950.106	0,11
USD	981.000	AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	717.754	0,09	USD	2.331.000	Broadcom Inc. 2.45% 15/02/2031	1.909.479	0,22
USD	6.055.000	Amazon.com Inc. 4.70% 01/12/2032	6.218.844	0,75	USD	1.150.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	1.067.686	0,13
USD	986.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	833.492	0,10	USD	1.691.000	Brown-Forman Corp. 4.75% 15/04/2033	1.707.386	0,20
USD	1.515.000	Amgen Inc. 2.20% 21/02/2027	1.395.868	0,17	USD	1.271.000	Charter Communications Operating LLC 3.90% 01/06/2052	841.363	0,10
USD	1.755.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	1.614.211	0,19	USD	2.314.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	1.471.388	0,18
USD	2.025.000	Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	1.592.830	0,19	USD	385.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	323.188	0,04
USD	932.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	791.820	0,09	USD	879.000	Commonwealth Edison Company 5.30% 01/02/2053	921.533	0,11
USD	673.000	Amgen Inc. 4.88% 01/03/2053	631.653	0,08	USD	833.000	Connecticut Light and Power Company 5.25% 15/01/2053	862.620	0,10
USD	2.578.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	2.637.269	0,32	USD	340.000	Consolidated Edison Company of New York Inc. 3.95% 01/04/2050	282.815	0,03
USD	4.434.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	4.557.911	0,55	USD	168.000	CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	138.089	0,02
USD	1.326.000	Amgen Inc. 5.65% 02/03/2053	1.380.566	0,17	USD	814.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	664.339	0,08
USD	4.837.000	Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	5.036.152	0,59	USD	1.695.000	CSX Corp. 4.50% 15/11/2052	1.554.225	0,18
USD	2.296.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	2.287.920	0,27	USD	1.625.000	Daimler Truck Finance North America LLC 5.13% 19/01/2028	1.628.681	0,20
USD	2.887.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	3.033.824	0,37	USD	652.000	Duke Energy Ohio Inc. 5.65% 01/04/2053	687.476	0,08
EUR	958.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	861.926	0,10	USD	1.077.000	Emera US Finance LP 4.75% 15/06/2046	879.613	0,11
USD	7.882.000	Astrazeneca Finance LLC 4.88% 03/03/2028	8.114.742	0,97	USD	2.133.000	Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	1.906.708	0,23
USD	6.872.000	AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	4.997.465	0,60	USD	8.317.000	Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	7.102.785	0,84
CAD	1.500.000	AT&T Inc. 4.00% 25/11/2025	1.090.861	0,13					
GBP	400.000	AT&T Inc. 4.38% 14/09/2029	470.400	0,06					
USD	2.240.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	2.151.261	0,26					
USD	1.514.000	Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	1.222.360	0,15					
USD	1.814.000	Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	1.537.631	0,18					
USD	2.219.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	1.877.645	0,23					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ÉTATS-UNIS (suite)					ÉTATS-UNIS (suite)				
USD	2.196.000	Eversource Energy 4.20% 27/06/2024	2.175.210	0,26	USD	3.086.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	3.119.044	0,37
USD	2.567.000	Eversource Energy 5.45% 01/03/2028	2.660.933	0,32	USD	1.577.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	1.515.567	0,18
USD	2.527.000	Five Corners Funding Trust III 5.79% 15/02/2033	2.594.894	0,31	USD	4.583.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	3.671.701	0,44
USD	2.224.000	Ford Motor Credit Company LLC 7.35% 04/11/2027	2.301.173	0,28	EUR	4.160.000	Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	4.464.288	0,54
USD	1.000.000	GE HealthCare Technologies Inc. 6.38% 22/11/2052	1.121.065	0,13	GBP	2.156.000	Morgan Stanley FRN 18/11/2033	2.719.207	0,33
USD	551.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	428.583	0,05	USD	7.545.000	Nestle Holdings Inc. 5.00% 14/03/2028	7.843.045	0,95
USD	1.043.000	Georgia Power Company 5.13% 15/05/2052	1.022.849	0,12	EUR	8.033.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	8.425.049	1,01
USD	879.000	Goodman USA Finance Five LLC 4.63% 04/05/2032	825.103	0,10	EUR	2.740.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	2.929.252	0,35
USD	398.000	Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	367.814	0,04	USD	2.594.000	New York Life Global Funding 4.55% 28/01/2033	2.569.278	0,31
USD	637.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	563.870	0,07	USD	2.241.000	New York Life Global Funding 4.85% 09/01/2028	2.276.101	0,27
USD	3.640.000	HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	3.720.800	0,45	USD	553.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	490.646	0,06
EUR	2.121.000	Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	2.339.171	0,28	USD	2.243.000	NiSource Inc. 1.70% 15/02/2031	1.774.748	0,21
USD	1.098.000	Indiana Michigan Power Company 5.63% 01/04/2053	1.142.825	0,14	USD	1.598.000	NiSource Inc. 4.38% 15/05/2047	1.388.936	0,17
USD	256.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	235.075	0,03	USD	6.959.000	NiSource Inc. 4.80% 15/02/2044	6.421.718	0,77
USD	855.000	Intel Corp. 4.90% 05/08/2052	797.068	0,10	USD	800.000	NiSource Inc. 5.00% 15/06/2052	762.658	0,09
USD	2.271.000	Intel Corp. 5.13% 10/02/2030	2.312.342	0,27	USD	1.189.000	NiSource Inc. 5.25% 30/03/2028	1.213.051	0,15
GBP	2.151.000	International Business Machines Corp. 4.88% 06/02/2038	2.570.173	0,31	USD	3.960.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	2.919.421	0,35
USD	2.369.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	1.984.932	0,24	USD	682.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	508.170	0,06
USD	1.918.000	JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	1.543.025	0,18	USD	890.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.85% 30/09/2047	715.420	0,09
USD	3.911.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	3.250.134	0,39	USD	2.459.000	Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	2.110.231	0,26
USD	9.930.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	8.350.308	0,99	USD	1.319.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	1.024.017	0,12
USD	4.888.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	4.190.081	0,50	USD	1.346.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	1.042.551	0,12
USD	1.785.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	1.572.790	0,19	USD	5.314.000	Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	4.389.225	0,53
USD	1.220.000	Kinder Morgan Inc. 5.20% 01/06/2033	1.211.522	0,15	USD	1.174.000	Pacific Gas and Electric Company 6.75% 15/01/2053	1.213.714	0,15
GBP	4.150.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	4.962.149	0,59	USD	718.000	Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	506.801	0,06
USD	785.000	Lowe's Companies Inc. 5.75% 01/07/2053	800.564	0,10	USD	588.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	523.027	0,06
					USD	2.680.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	2.109.267	0,25
					USD	814.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	727.930	0,09
					USD	4.991.000	PPL Electric Utilities Corp. 5.00% 15/05/2033	5.098.683	0,61

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ÉTATS-UNIS (suite)					ÉTATS-UNIS (suite)				
USD	625.000	Public Service Company of Colorado 5.25% 01/04/2053	637.114	0,08	USD	1.297.000	UnitedHealth Group Inc. 6.05% 15/02/2063	1.477.629	0,18
USD	3.964.000	Public Service Electric and Gas Company 4.65% 15/03/2033	3.985.666	0,48	USD	4.039.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	3.842.697	0,46
USD	1.503.000	RELX Capital Inc. 4.75% 20/05/2032	1.494.230	0,18	USD	8.651.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	7.024.227	0,84
USD	2.470.000	Republic Services Inc. 4.88% 01/04/2029	2.499.865	0,30	USD	5.147.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.39% 15/03/2062	4.167.918	0,50
USD	2.829.000	Roche Holdings Inc. 1.93% 13/12/2028	2.490.477	0,30	USD	4.644.000	Williams Cos IncThe 2.60% 15/03/2031	3.908.103	0,46
USD	516.000	Southern California Edison Company 3.65% 01/02/2050	398.248	0,05	USD	1.274.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	1.131.849	0,14
USD	734.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	610.003	0,07	Total États-Unis		299.994.260	35,94	
USD	744.000	Southern California Gas Company 3.95% 15/02/2050	601.754	0,07	Total Obligations		647.031.988	77,58	
EUR	1.105.000	Southern Company FRN 15/09/2081	951.844	0,11	Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				
EUR	134.000	Southern Company FRN 15/09/2081	115.427	0,01	CANADA				
USD	956.000	Southern Company 5.70% 15/10/2032	1.008.037	0,12	CAD	6.845.000	Canada (Govt of) 1.00% 01/09/2026	4.700.079	0,56
USD	2.299.000	Stellantis Finance USA Inc. 6.38% 12/09/2032	2.413.061	0,28	CAD	4.186.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	2.918.415	0,35
USD	1.894.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.90% 15/09/2044	1.755.164	0,21	Total Canada		7.618.494	0,91	
GBP	1.514.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	1.807.349	0,22	ALLEMAGNE				
USD	1.048.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	924.343	0,11	EUR	3.557.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2052	1.989.871	0,24
USD	1.974.000	T-Mobile USA Inc. 2.88% 15/02/2031	1.704.125	0,20	EUR	3.118.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/09/2028	2.904.403	0,35
USD	1.615.000	T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	1.164.894	0,14	GBP	4.900.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3.88% 02/09/2025	5.997.035	0,72
USD	3.732.000	T-Mobile USA Inc. 4.95% 15/03/2028	3.767.995	0,45	Total Allemagne		10.891.309	1,31	
USD	1.901.000	T-Mobile USA Inc. 5.05% 15/07/2033	1.911.294	0,23	JAPON				
USD	441.000	T-Mobile USA Inc. 5.80% 15/09/2062	457.214	0,05	JPY	549.600.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	3.360.161	0,40
USD	566.000	TSMC Arizona Corp. 2.50% 25/10/2031	485.558	0,06	Total Japon		3.360.161	0,40	
USD	2.866.000	UnitedHealth Group Inc. 4.50% 15/04/2033	2.851.246	0,34	SUPRANATIONALES				
USD	1.815.000	UnitedHealth Group Inc. 4.95% 15/05/2062	1.768.277	0,21	EUR	2.300.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.00% 15/01/2027	2.231.739	0,27
USD	5.608.000	UnitedHealth Group Inc. 5.30% 15/02/2030	5.918.208	0,71					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises (suite)					
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)				Obligations (suite)					
SUPRANATIONALES (suite)				NORVÈGE					
USD	5.465.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	5.124.615	0,61	USD	200.000	DNB Bank ASA FRN 09/10/2026	201.942	0,02
USD	4.000.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 24/11/2027	3.494.557	0,42	Total Norvège				
Total Supranationales		10.850.911	1,30	ÉTATS-UNIS					
ROYAUME-UNI				ÉTATS-UNIS					
GBP	996.000	United Kingdom Gilt 3.75% 22/07/2052	1.212.170	0,15	USD	1.936.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	1.636.540	0,20
Total Royaume-Uni		1.212.170	0,15	USD	1.352.000	Broadcom Inc. 4.93% 15/05/2037	1.231.822	0,15	
ÉTATS-UNIS				ÉTATS-UNIS					
USD	11.280.000	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	7.468.594	0,90	USD	5.623.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	4.930.407	0,59
USD	32.215.700	United States Treasury N/B 2.00% 15/11/2041	24.355.571	2,91	USD	3.920.000	GE HealthCare Technologies Inc. 5.86% 15/03/2030	4.105.880	0,50
USD	13.499.700	United States Treasury N/B 2.75% 30/04/2027	13.014.555	1,56	USD	3.141.000	HCA Inc. 3.63% 15/03/2032	2.770.772	0,33
Total États-Unis		44.838.720	5,37	USD	1.200.000	HCA Inc. 4.63% 15/03/2052	1.000.803	0,12	
Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance		78.771.765	9,44	USD	1.548.000	Verizon Communications Inc. 2.36% 15/03/2032	1.272.502	0,15	
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs		725.803.753	87,02	Total États-Unis		16.948.726	2,04	Total Obligations	
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises				Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises		18.249.693	2,19	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	
Obligations				Obligations					
AUSTRALIE				AUSTRALIE					
USD	817.000	NBN Company Limited 2.63% 05/05/2031	692.833	0,08	USD	2.913.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	2.820.688	0,34
Total Australie		692.833	0,08	Total Australie		2.820.688	0,34	Obligations	
BERMUDES				BERMUDES					
USD	700.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	695.746	0,08	Total Bermudes				
Total Bermudes		695.746	0,08	CANADA					
PAYS-BAS				PAYS-BAS					
USD	409.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	406.192	0,05	CAD	1.980.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	1.410.868	0,17
Total Pays-Bas		406.192	0,05	Total Canada		1.410.868	0,17		

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire (suite)			
Obligations (suite)			
PORTUGAL			
EUR	200.000 Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	23.902	0,00
	Total Portugal	23.902	0,00
ÉTATS-UNIS			
USD	883.000 Metropolitan Edison Company 5.20% 01/04/2028	892.601	0,11
USD	2.830.000 Metropolitan Life Global Funding I 5.15% 28/03/2033	2.860.309	0,34
USD	4.100.000 Pacific Life Global Funding II 4.90% 04/04/2028	4.105.179	0,49
USD	495.000 Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	480.897	0,06
USD	2.991.000 Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	2.526.194	0,30
	Total États-Unis	10.865.180	1,30
	Total Obligations	15.816.384	1,89
	Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	15.816.384	1,89
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières			
Fonds			
IRLANDE			
	35.269.617 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	35.269.617	4,23
	Total Irlande	35.269.617	4,23
	Total Fonds	35.269.617	4,23
	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	35.269.617	4,23
	Valeur totale des investissements	795.139.447	95,33
(Coût total : 848.154.775 USD)			

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

**Titre à la juste valeur.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations				Obligations (suite)					
AUSTRALIE				FINLANDE					
EUR	483.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	356.124	0,44	EUR	788.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	668.178	0,83
EUR	239.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	182.344	0,23	Total Finlande			668.178	0,83
EUR	94.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	71.717	0,09	FRANCE				
EUR	876.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	830.779	1,04	EUR	399.000	AXA SA 3.75% 12/10/2030	401.950	0,50
EUR	594.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	472.458	0,59	EUR	235.000	AXA SA FRN 10/03/2043	214.427	0,27
EUR	723.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 05/05/2031	630.207	0,79	USD	930.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.60% 04/10/2026	751.701	0,94
EUR	494.000	Goodman Australia Finance Pty Limited 1.38% 27/09/2025	453.340	0,57	EUR	200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.63% 14/09/2032	197.210	0,25
EUR	431.000	National Australia Bank Limited 2.13% 24/05/2028	403.832	0,50	EUR	600.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	432.081	0,54
EUR	645.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	659.922	0,82	USD	1.241.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.002.134	1,25
EUR	700.000	Westpac Banking Corp. 3.80% 17/01/2030	695.895	0,87	EUR	200.000	BPCE SA 4.00% 29/11/2032	200.497	0,25
Total Australie			4.756.618	5,94	EUR	200.000	Credit Agricole SA 1.13% 24/02/2029	173.331	0,22
BELGIQUE				EUR 400.000 Credit Agricole SA 2.50% 29/08/2029				375.213	0,47
EUR	325.000	Anheuser-Busch InBev SA/ NV 3.70% 02/04/2040	307.325	0,38	EUR	400.000	Credit Agricole SA 4.00% 18/01/2033	408.616	0,51
EUR	52.000	Anheuser-Busch InBev SA/ NV 3.70% 02/04/2040	49.172	0,06	GBP	400.000	Credit Agricole SA 4.88% 23/10/2029	449.502	0,56
EUR	500.000	Argenta Spaarbank NV FRN 08/02/2029	407.042	0,51	EUR	600.000	Danone SA 2.60% 28/06/2023	599.479	0,75
EUR	400.000	Belfius Bank SA - Perp FRN	286.771	0,36	EUR	100.000	Electricite de France SA 2.00% 09/12/2049	60.873	0,08
EUR	1.200.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	1.007.184	1,27	EUR	100.000	Electricite de France SA 4.25% 25/01/2032	99.306	0,12
Total Belgique			2.057.494	2,58	EUR	500.000	Electricite de France SA 4.38% 12/10/2029	507.480	0,63
BERMUDES				EUR 200.000 Electricite de France SA FRN 06/12/2171				196.158	0,24
USD	500.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	431.463	0,54	EUR	200.000	ELO SACA 4.88% 08/12/2028	191.114	0,24
Total Bermudes			431.463	0,54	EUR	428.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	349.004	0,44
DANEMARK				EUR 200.000 La Banque Postale SA FRN 26/01/2031				176.705	0,22
USD	775.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	624.694	0,78	EUR	300.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.63% 08/07/2032	232.802	0,29
Total Danemark			624.694	0,78	EUR	400.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	303.041	0,38
				EUR 200.000 RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.50% 27/09/2030				173.404	0,22
				EUR 700.000 SANEF SA 1.88% 16/03/2026				665.985	0,84
				EUR 700.000 Schneider Electric SE 0.25% 09/09/2024				673.035	0,84
				EUR 600.000 Suez SACA 1.88% 24/05/2027				560.053	0,70

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*				
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)							
Obligations (suite)				Obligations (suite)							
FRANCE (suite)				ITALIE							
EUR	400.000	Suez SACA 4.63% 03/11/2028	411.602	0,51	EUR	214.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	172.341	0,22		
EUR	500.000	TotalEnergies SE - Perp FRN	415.229	0,52	EUR	283.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	278.925	0,35		
	Total France		10.221.932	12,78	EUR	149.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	129.230	0,16		
ALLEMAGNE				EUR				358.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	290.327	0,36
EUR	900.000	Allianz SE FRN 08/07/2050	734.376	0,91	EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	98.843	0,12		
EUR	200.000	Allianz SE FRN 05/07/2052	184.174	0,23	EUR	195.000	ENI SpA - Perp FRN	162.927	0,20		
EUR	600.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	495.977	0,62	USD	500.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	402.323	0,50		
EUR	1.000.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	739.132	0,92	EUR	309.000	Snam SpA 0.00% 15/08/2025	284.553	0,36		
EUR	100.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	101.939	0,13	EUR	250.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale FRN 09/02/2171	209.544	0,26		
EUR	700.000	BASF SE 4.00% 08/03/2029	718.685	0,90		Total Italie	2.029.013	2,53			
EUR	400.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	329.461	0,41	JAPON						
EUR	200.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	188.219	0,23	EUR	512.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0.01% 10/09/2025	468.429	0,58		
EUR	400.000	Commerzbank AG FRN 21/03/2028	392.415	0,49		Total Japon	468.429	0,58			
EUR	700.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	552.567	0,70	JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES						
EUR	200.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	191.255	0,24	EUR	357.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	281.648	0,35		
EUR	400.000	Hannover Rueck SE FRN 26/08/2043	408.844	0,51	GBP	234.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	283.800	0,35		
EUR	400.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	306.566	0,38		Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	565.448	0,70			
EUR	400.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	316.964	0,40	LUXEMBOURG						
EUR	900.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	929.758	1,16	EUR	600.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	402.767	0,50		
EUR	300.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	158.138	0,20	EUR	600.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	373.546	0,47		
EUR	600.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	511.792	0,64	EUR	300.000	Aroundtown SA 1.63% 31/01/2028	198.009	0,25		
EUR	300.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	281.364	0,35	EUR	347.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	217.163	0,27		
	Total Allemagne		7.541.626	9,42	EUR	1.200.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	848.447	1,05		
IRLANDE				EUR				433.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	298.213	0,38
EUR	370.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	335.583	0,42	EUR	521.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	391.836	0,49		
EUR	500.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	466.909	0,58	EUR	300.000	Prologis International Funding II SA 4.63% 21/02/2035	280.612	0,35		
EUR	420.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	361.109	0,45							
EUR	355.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	301.139	0,38							
	Total Irlande		1.464.740	1,83							

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
LUXEMBOURG (suite)				PAYS-BAS (suite)					
EUR	825.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	758.278	0,95	EUR	717.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	603.683	0,75
					EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	102.023	0,13
		Total Luxembourg	3.768.871	4,71	EUR	300.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	249.999	0,31
					EUR	400.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	391.339	0,49
					EUR	437.000	Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	408.248	0,51
PAYS-BAS					EUR	485.000	TenneT Holding BV 1.63% 17/11/2026	463.637	0,58
EUR	100.000	ABB Finance BV 3.25% 16/01/2027	99.711	0,12	EUR	463.000	TenneT Holding BV 2.13% 17/11/2029	434.301	0,54
EUR	176.000	Achmea BV 3.63% 29/11/2025	175.668	0,22	EUR	380.000	TenneT Holding BV 4.50% 28/10/2034	409.205	0,51
EUR	300.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	236.479	0,30	EUR	400.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	300.430	0,37
EUR	265.000	Alliander NV 2.63% 09/09/2027	258.086	0,32	GBP	1.600.000	Volkswagen Financial Services NV 1.38% 14/09/2028	1.484.246	1,85
EUR	300.000	Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	269.309	0,34	EUR	300.000	Vonovia Finance BV 1.00% 28/01/2041	145.673	0,18
EUR	194.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	201.420	0,25	EUR	249.000	Wolters Kluwer NV 3.00% 23/09/2026	246.148	0,31
EUR	302.000	Diageo Capital BV 1.88% 08/06/2034	255.294	0,32	EUR	234.000	Wolters Kluwer NV 3.75% 03/04/2031	235.403	0,29
EUR	538.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	420.110	0,52			Total Pays-Bas	13.067.634	16,29
EUR	345.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	243.182	0,30			NORVÈGE		
EUR	160.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	112.780	0,14	USD	1.319.000	DNB Bank ASA FRN 30/09/2025	1.135.086	1,41
USD	251.000	Enel Finance International NV 6.80% 14/10/2025	239.442	0,30	EUR	679.000	DNB Bank ASA FRN 14/03/2029	689.890	0,86
EUR	482.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	377.078	0,47			Total Norvège	1.824.976	2,27
EUR	56.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	43.810	0,05			PORTUGAL		
EUR	327.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	267.184	0,33	EUR	100.000	Caixa Geral de Depositos SA FRN 31/10/2028	103.298	0,13
EUR	300.000	ING Groep NV FRN 01/02/2030	236.030	0,29			Total Portugal	103.298	0,13
EUR	300.000	ING Groep NV FRN 29/11/2030	239.670	0,30			ESPAGNE		
EUR	500.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	420.851	0,53	EUR	600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 4.38% 14/10/2029**	615.915	0,77
EUR	937.000	RELX Finance BV 1.00% 22/03/2024	911.959	1,14	EUR	100.000	Banco de Sabadell SA FRN 10/11/2028	100.485	0,13
EUR	345.000	Royal Schiphol Group NV 0.75% 22/04/2033	262.443	0,33	GBP	200.000	Banco Santander SA FRN 30/08/2028	220.937	0,28
EUR	345.000	Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	253.064	0,32			Total Espagne	937.337	1,18
EUR	345.000	Shell International Finance BV 1.88% 07/04/2032	298.112	0,37					
EUR	700.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.38% 24/08/2031	702.328	0,88					
EUR	909.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	753.387	0,94					
EUR	339.000	Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	315.902	0,39					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
SUÈDE				ROYAUME-UNI (suite)					
EUR	606.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	492.599	0,61	EUR	401.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	307.470	0,38
		Total Suède	492.599	0,61	EUR	368.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	282.167	0,35
SUISSE				EUR 417.000 Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028				337.571	0,42
EUR	874.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	689.676	0,86	USD	898.000	Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	727.725	0,91
EUR	519.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	340.784	0,43	USD	576.000	NatWest Markets plc 1.60% 29/09/2026	462.957	0,58
EUR	5.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	3.283	0,00	GBP	290.000	NatWest Markets plc 6.38% 08/11/2027	343.321	0,43
EUR	200.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2032	167.599	0,21	EUR	601.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	506.218	0,63
EUR	200.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	155.124	0,19	EUR	480.000	Thames Water Kemble Finance plc 0.19% 23/10/2023	471.161	0,59
		Total Suisse	1.356.466	1,69	EUR	295.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	255.067	0,32
ROYAUME-UNI				GBP 820.000 Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026				865.602	1,08
EUR	213.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	214.775	0,27	EUR	167.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	159.310	0,20
EUR	336.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	250.268	0,31			Total Royaume-Uni	10.311.574	12,86
EUR	173.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	128.858	0,16	ÉTATS-UNIS				
EUR	534.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	495.104	0,62	EUR	441.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	444.090	0,55
EUR	415.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	338.757	0,42	USD	313.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	294.718	0,37
EUR	51.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	41.145	0,05	USD	324.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	306.553	0,38
EUR	345.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	278.333	0,35	EUR	217.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	179.703	0,22
GBP	491.524	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	556.385	0,69	EUR	200.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	140.395	0,18
EUR	420.000	Diageo Finance plc 0.50% 19/06/2024	406.006	0,51	EUR	81.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	56.860	0,07
EUR	330.000	Diageo Finance plc 1.00% 22/04/2025	315.075	0,39	EUR	227.000	AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	201.466	0,25
EUR	332.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	298.606	0,38	EUR	242.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	192.089	0,24
EUR	415.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	404.547	0,50	EUR	345.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	273.846	0,34
USD	784.000	HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	715.212	0,89	EUR	277.000	Bank of America Corp. FRN 27/04/2033	247.315	0,31
EUR	475.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	465.508	0,58	EUR	319.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 1.50% 18/03/2030	280.797	0,35
EUR	328.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	276.413	0,34	EUR	185.000	Exxon Mobil Corp. 0.52% 26/06/2028	159.279	0,20
EUR	416.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	408.013	0,51					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*			
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)						
Obligations (suite)				Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)						
ÉTATS-UNIS (suite)				SUPRANATIONALES						
EUR	485.000	General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	419.474	0,52	EUR	754.000	European Bank for Reconstruction & Development 0.00% 10/01/2024	735.576	0,92	
EUR	200.000	General Motors Financial Company Inc. 4.30% 15/02/2029	197.236	0,25	EUR	742.000	European Investment Bank 0.00% 15/11/2027	650.589	0,81	
EUR	470.000	Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	477.100	0,60	EUR	1.044.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.00% 15/01/2027	932.409	1,17	
EUR	368.000	International Business Machines Corp. 3.63% 06/02/2031	368.033	0,46	Total Supranationales			2.318.574	2,90	
EUR	486.000	JPMorgan Chase & Company FRN 17/02/2033	362.926	0,45	Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance			4.710.976	5,88	
EUR	323.000	JPMorgan Chase & Company FRN 23/03/2030	285.715	0,36	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				77.490.393	96,71
EUR	505.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	470.984	0,59	Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises					
EUR	688.000	Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	679.575	0,85	Obligations					
EUR	1.242.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.198.966	1,50	PAYS-BAS					
EUR	488.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	480.193	0,60	USD	1.150.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	1.051.225	1,30	
EUR	859.000	New York Life Global Funding 3.63% 09/01/2030	839.891	1,04	Total Pays-Bas			1.051.225	1,30	
EUR	547.000	Northwestern Mutual Global Funding 4.11% 15/03/2030	554.299	0,69	Total Obligations				1.051.225	1,30
EUR	181.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	116.015	0,14	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises				1.051.225	1,30
EUR	440.000	Verizon Communications Inc. 0.75% 22/03/2032	337.565	0,42	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire					
EUR	505.000	Verizon Communications Inc. 4.25% 31/10/2030	521.944	0,65	Obligations					
Total États-Unis			10.087.027	12,58	PORTUGAL					
Total Obligations			72.779.417	90,83	EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	66.000	0,08	
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire						
ALLEMAGNE				Obligations						
EUR	211.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	193.945	0,24	Total Portugal				66.000	0,08
EUR	565.000	Germany (Govt of) 0.00% 16/04/2027	513.851	0,64	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire					
EUR	132.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/05/2036	96.609	0,12	Obligations					
EUR	780.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 18/02/2025	738.158	0,92	PORTUGAL					
EUR	879.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.05% 30/05/2024	849.839	1,06	EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	66.000	0,08	
Total Allemagne			2.392.402	2,98	Total Portugal			66.000	0,08	

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire (suite)		
Obligations (suite)		
ROYAUME-UNI		
EUR 350.000 Lehman Brothers UK Capital Funding III LP Perp 3.88%**	0	0,00
Total Royaume-Uni	0	0,00
Total Obligations	66.000	0,08
Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	66.000	0,08
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Fonds		
IRLANDE		
52 BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	5.189	0,01
Total Irlande	5.189	0,01
Total Fonds	5.189	0,01
Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	5.189	0,01
Valeur totale des investissements	78.612.807	98,10
(Coût total : 86.746.277 EUR)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

**Titre à la juste valeur.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations				Obligations (suite)					
BELGIQUE				FRANCE (suite)					
EUR	1.050.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	1.065.749	0,26	EUR	2.500.000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 07/02/2025	768.856	0,19
EUR	3.100.000	Belfius Bank SA Perp FRN	3.007.000	0,75	EUR	885.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	271.916	0,07
EUR	900.000	Solvay SA FRN 02/03/2169	807.293	0,20	EUR	433.000	Chrome Bidco SASU 3.50% 31/05/2028	361.129	0,09
EUR	300.000	Solvay SA Perp FRN	298.463	0,07	EUR	334.000	Chrome Holdco SASU 5.00% 31/05/2029	248.361	0,06
		Total Belgique	5.178.505	1,28	EUR	2.946.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	2.396.999	0,60
CANADA					EUR	1.126.000	Crown European Holdings SA 2.63% 30/09/2024	1.103.939	0,27
EUR	1.193.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	1.040.864	0,26	EUR	587.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	563.870	0,14
		Total Canada	1.040.864	0,26	EUR	650.000	Crown European Holdings SA 3.38% 15/05/2025	640.792	0,16
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE					EUR	3.000.000	Electricite de France SA FRN 01/06/2170	2.388.137	0,59
EUR	937.000	Allwyn International AS 4.13% 20/11/2024	923.607	0,23	EUR	1.800.000	Electricite de France SA FRN 15/03/2169	1.513.552	0,38
		Total République tchèque	923.607	0,23	EUR	3.600.000	Electricite de France SA FRN 22/01/2049	3.332.965	0,82
FINLANDE					EUR	2.400.000	Electricite de France SA FRN 29/12/2049	2.300.725	0,57
EUR	683.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.13% 09/03/2026	622.055	0,15	GBP	1.300.000	Electricite de France SA FRN 31/12/2049	1.231.201	0,31
EUR	594.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	509.193	0,13	EUR	600.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	588.475	0,15
EUR	339.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.13% 04/02/2025	327.048	0,08	EUR	400.000	Electricite de France SA - Perp FRN	299.942	0,07
EUR	1.936.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.63% 31/03/2027	1.816.836	0,45	EUR	1.231.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	1.081.035	0,27
		Total Finlande	3.275.132	0,81	EUR	600.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	567.430	0,14
FRANCE					EUR	1.054.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	1.002.899	0,25
EUR	400.000	Accor SA - Perp FRN	389.423	0,10	EUR	5.152.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	4.507.112	1,12
EUR	400.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	373.670	0,09	EUR	100.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	81.543	0,02
EUR	1.287.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	1.009.921	0,25	EUR	2.261.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	2.015.909	0,50
EUR	542.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	407.985	0,10	EUR	100.000	Faurecia SE 3.13% 15/06/2026	94.041	0,02
EUR	561.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	434.016	0,11	EUR	1.163.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	1.044.700	0,26
EUR	104.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	78.417	0,02	EUR	633.000	Faurecia SE 7.25% 15/06/2026	654.231	0,16
EUR	1.264.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	953.065	0,24	EUR	576.000	Foncia Management SA 3.38% 31/03/2028	457.261	0,11
EUR	2.385.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	2.113.706	0,52	EUR	685.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	666.041	0,17
EUR	1.421.000	CAB Selas 3.38% 01/02/2028	1.170.206	0,29	EUR	1.864.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	1.812.410	0,45
					EUR	4.077.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	3.936.678	0,98
					EUR	1.185.000	Iliad Holding SASU 5.63% 15/10/2028	1.105.970	0,27
					EUR	500.000	iliad SA 1.88% 11/02/2028	420.966	0,10
					EUR	1.300.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	1.292.081	0,32

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
FRANCE (suite)				ALLEMAGNE (suite)					
EUR	700.000	iliad SA 5.63% 15/02/2030	680.479	0,17	EUR	500.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	461.153	0,11
EUR	500.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	486.368	0,12	EUR	2.124.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	1.965.742	0,49
EUR	400.000	Iliad SA 2.38% 17/06/2026	367.737	0,09	EUR	265.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	247.407	0,06
EUR	578.000	Laboratoire Eimer Selas 5.00% 01/02/2029	435.465	0,11	EUR	598.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	558.300	0,14
EUR	1.484.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	1.446.523	0,36	EUR	400.000	Deutsche Bank AG FRN 30/04/2171	373.167	0,09
EUR	429.000	Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	399.525	0,10	EUR	500.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	482.440	0,12
EUR	305.000	Loxam SAS 5.75% 15/07/2027	264.293	0,07	EUR	3.500.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	3.164.217	0,79
EUR	200.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	194.553	0,05	EUR	2.800.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	2.615.133	0,65
EUR	1.389.000	Paprec Holding SA 3.50% 01/07/2028	1.217.286	0,30	EUR	1.400.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	1.279.914	0,32
EUR	1.511.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	1.496.723	0,36	EUR	1.649.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	1.560.942	0,39
EUR	1.242.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	1.253.048	0,31	EUR	804.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	733.092	0,18
EUR	429.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	383.661	0,10	EUR	1.285.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	1.171.670	0,29
EUR	500.000	Renault SA 1.25% 24/06/2025	463.078	0,11	EUR	599.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	594.545	0,15
EUR	400.000	Renault SA 2.00% 28/09/2026	357.316	0,09	EUR	550.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.88% 15/05/2027	484.881	0,12
EUR	1.000.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	916.864	0,23	EUR	2.115.876	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	2.169.770	0,54
EUR	400.000	Renault SA 2.50% 02/06/2027	353.334	0,09	EUR	100.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	87.013	0,02
EUR	1.455.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	1.283.706	0,32	EUR	500.000	Infineon Technologies AG FRN 01/04/2168	475.250	0,12
EUR	961.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	838.597	0,21	EUR	500.000	Infineon Technologies AG FRN 01/04/2168	455.363	0,11
EUR	103.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	89.881	0,02	EUR	3.400.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	2.605.813	0,65
EUR	2.132.000	Solvay Finance SACA Perp FRN	2.128.361	0,54	EUR	2.626.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	2.292.104	0,57
EUR	1.200.000	SPIE SA 2.63% 18/06/2026	1.132.020	0,28	EUR	1.548.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	1.345.258	0,33
EUR	716.000	Tereos Finance Groupe I SA 7.25% 15/04/2028	703.974	0,17	EUR	1.318.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	1.073.460	0,26
EUR	300.000	Valeo 1.00% 03/08/2028	239.963	0,06	EUR	434.000	ProGroup AG 3.00% 31/03/2026	405.921	0,10
EUR	500.000	Valeo 1.50% 18/06/2025	472.360	0,12	EUR	1.300.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	1.263.540	0,31
EUR	600.000	Valeo 1.63% 18/03/2026	552.820	0,14	EUR	900.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	874.759	0,22
EUR	1.300.000	Valeo 5.38% 28/05/2027	1.296.151	0,32	EUR	1.200.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	1.101.502	0,27
EUR	600.000	Veolia Environnement SA FRN 15/02/2171	499.166	0,12	EUR	700.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	642.543	0,16
EUR	1.100.000	Veolia Environnement SA FRN 20/04/2169	989.192	0,25	EUR	1.629.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	1.521.573	0,38
EUR	300.000	Veolia Environnement SA FRN 20/04/2170	269.779	0,07					
EUR	400.000	Veolia Environnement SA FRN 20/04/2171	328.766	0,08					
EUR	1.400.000	Verallia SA 1.63% 14/05/2028	1.228.616	0,31					
		Total France	68.451.180	17,00					
ALLEMAGNE									
EUR	500.000	Bayer AG FRN 12/11/2079	465.598	0,12					
EUR	1.100.000	Bayer AG FRN 12/11/2079	955.655	0,24					
EUR	2.500.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	2.324.281	0,57					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ALLEMAGNE (suite)				ITALIE (suite)					
EUR	1.251.099	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	1.192.363	0,30	EUR	1.327.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.63% 28/04/2025	1.211.351	0,30
EUR	200.000	ZF Finance GmbH 2.00% 06/05/2027	173.159	0,04	EUR	928.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.63% 24/09/2024	884.578	0,22
EUR	100.000	ZF Finance GmbH 2.75% 25/05/2027	89.453	0,02	EUR	310.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA FRN 02/03/2026	304.055	0,08
EUR	1.200.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	1.143.666	0,28	EUR	1.687.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	1.506.913	0,37
EUR	700.000	ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	626.594	0,16	EUR	1.288.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	1.135.587	0,28
	Total Allemagne		38.977.241	9,67	EUR	471.000	International Design Group SpA 6.50% 15/11/2025	454.774	0,11
GIBRALTAR				ITALIE (suite)					
EUR	1.066.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	907.516	0,23	EUR	832.000	Lottomatica SpA 5.13% 15/07/2025	822.285	0,20
	Total Gibraltar		907.516	0,23	EUR	522.000	Lottomatica SpA 6.25% 15/07/2025	521.681	0,13
GRÈCE				ITALIE (suite)					
EUR	450.000	Eurobank SA FRN 05/05/2027	377.392	0,09	EUR	805.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	855.591	0,21
EUR	1.846.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029	1.799.580	0,45	EUR	303.000	Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	256.583	0,06
EUR	1.050.000	National Bank of Greece SA FRN 22/11/2027	1.060.140	0,26	EUR	935.000	Mundys SpA 1.63% 03/02/2025	886.233	0,22
	Total Grèce		3.237.112	0,80	EUR	625.000	Mundys SpA 1.88% 12/02/2028	526.460	0,13
IRLANDE				ITALIE (suite)					
EUR	4.471.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	4.247.768	1,05	EUR	3.174.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	2.888.961	0,72
GBP	1.258.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.88% 15/07/2028	1.223.116	0,30	EUR	1.042.000	Nexi SpA 2.13% 30/04/2029	857.904	0,21
	Total Irlande		5.470.884	1,35	EUR	1.520.000	Telecom Italia SpA 2.38% 12/10/2027	1.315.713	0,33
ÎLE DE MAN				ITALIE (suite)					
EUR	440.755	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	439.519	0,11	EUR	2.412.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	2.306.839	0,57
EUR	119.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	114.722	0,03	EUR	375.000	Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	351.042	0,09
	Total Île de Man		554.241	0,14	EUR	920.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	883.536	0,22
ITALIE				ITALIE (suite)					
EUR	1.035.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 26/06/2026	957.509	0,24	EUR	1.175.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.167.131	0,29
EUR	1.468.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	1.337.308	0,33	EUR	600.000	Telecom Italia SpA 5.25% 17/03/2055	491.040	0,12
EUR	633.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	549.011	0,14	GBP	1.000.000	Telecom Italia SpA 5.88% 19/05/2023	1.137.645	0,28
EUR	609.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	522.668	0,13	EUR	1.332.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	1.362.920	0,34
	Total Italie					Total Italie		25.495.318	6,32
ITALIE (suite)				JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES					
EUR	175.757	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024			EUR	3.023.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	2.954.118	0,72
EUR	849.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027			EUR	849.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	786.740	0,20

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES (suite)					LUXEMBOURG (suite)				
GBP	1.418.000	Kane Bidco Limited 6.50% 15/02/2027	1.449.170	0,36	EUR	684.000	Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	633.214	0,16
		Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	5.365.397	1,32	EUR	960.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	893.007	0,22
					EUR	1.110.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	1.191.004	0,30
					EUR	2.700.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	2.474.058	0,62
							Total Luxembourg	27.023.429	6,73
LUXEMBOURG					PAYS-BAS				
EUR	912.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	860.338	0,21	EUR	1.400.000	Abertis Infraestructuras Finance BV - Perp FRN	1.140.837	0,28
EUR	1.598.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	1.277.902	0,32	EUR	2.493.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	2.151.475	0,54
EUR	117.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	94.477	0,02	EUR	848.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	839.454	0,21
EUR	2.200.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	1.659.963	0,42	EUR	100.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	97.670	0,02
EUR	3.962.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	2.974.451	0,74	EUR	2.436.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	2.370.606	0,59
GBP	564.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	604.444	0,15	EUR	1.762.000	Dufry One BV 2.00% 15/02/2027	1.525.960	0,38
EUR	1.395.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	1.140.591	0,28	EUR	200.000	Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	196.949	0,05
EUR	257.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	249.103	0,06	EUR	472.000	Dufry One BV 3.38% 15/04/2028	416.211	0,10
EUR	370.437	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	370.402	0,09	EUR	128.000	Goodyear Europe BV 2.75% 15/08/2028	104.614	0,03
EUR	989.000	Cirsa Finance International Sarl 10.38% 30/11/2027	1.052.052	0,26	EUR	1.107.000	LKQ European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	1.073.315	0,27
EUR	443.000	CPI Property Group SA Perp FRN	189.538	0,05	EUR	400.000	Naturgy Finance BV FRN 29/12/2049	387.896	0,10
EUR	430.000	Eurofins Scientific SE FRN 13/11/2166	397.290	0,10	EUR	1.000.000	Naturgy Finance BV - Perp FRN	872.209	0,22
EUR	871.000	Eurofins Scientific SE FRN 24/07/2171	866.973	0,22	EUR	1.426.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	1.010.924	0,25
EUR	1.073.953	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	1.043.610	0,26	EUR	1.720.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	1.676.810	0,42
EUR	539.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 6.75% 01/11/2025	415.192	0,10	EUR	200.000	Phoenix Pib Dutch Finance BV 2.38% 05/08/2025	190.565	0,05
GBP	960.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	832.224	0,21	EUR	624.000	Ppf Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	590.536	0,15
EUR	4.924.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	4.200.766	1,04	EUR	500.000	PPF Telecom Group BV 3.13% 27/03/2026	469.673	0,12
EUR	770.431	LHMC Finco 2 Sarl 7.25% 02/10/2025	713.441	0,18	EUR	459.000	PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	422.224	0,10
EUR	102.423	LHMC Finco 2 Sarl 7.25% 02/10/2025	94.847	0,02	EUR	612.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	603.770	0,15
EUR	1.176.395	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	1.170.830	0,29	EUR	622.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	574.534	0,14
EUR	1.233.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	1.150.870	0,29	EUR	2.174.000	Repsol International Finance BV FRN 22/03/2170	1.896.563	0,48
EUR	490.000	Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	472.842	0,12					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)					Obligations (suite)					
PAYS-BAS (suite)					PAYS-BAS (suite)					
EUR	907.000	Repsol International Finance BV FRN 11/06/2169	856.479	0,21	EUR	641.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	624.423	0,16	
EUR	462.000	Repsol International Finance BV FRN 11/06/2169	436.266	0,11	EUR	214.000	United Group BV 5.25% 01/02/2030	152.649	0,04	
EUR	843.000	Repsol International Finance BV FRN 31/12/2049	758.992	0,19	EUR	974.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	923.427	0,23	
EUR	1.061.305	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	832.735	0,21	EUR	1.379.000	VZ Secured Financing BV 3.50% 15/01/2032	1.103.733	0,27	
EUR	999.395	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	784.158	0,19	EUR	1.119.000	VZ Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	896.793	0,22	
EUR	1.000.000	Telefonica Europe BV FRN 24/09/2170	851.453	0,21	EUR	1.300.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	1.186.868	0,29	
EUR	1.600.000	Telefonica Europe BV FRN 24/05/2170	1.333.326	0,33	Total Pays-Bas				49.038.170	12,19
EUR	300.000	Telefonica Europe BV FRN 03/05/2171	290.322	0,07	PORTUGAL					
EUR	400.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	408.091	0,10	EUR	700.000	Edp - Energias de Portugal SA FRN 20/07/2080	634.661	0,16	
EUR	3.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	3.427.880	0,85	EUR	1.400.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	1.178.196	0,29	
EUR	2.900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	2.837.211	0,70	EUR	2.300.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 23/04/2083	2.260.007	0,56	
EUR	2.198.000	Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	2.053.385	0,51	Total Portugal				4.072.864	1,01
EUR	495.000	TenneT Holding BV Perp FRN	487.052	0,12	ROUMANIE					
EUR	589.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.63% 15/10/2028	458.056	0,11	EUR	1.600.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	1.513.283	0,38	
EUR	525.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.88% 31/03/2027	445.260	0,11	EUR	400.000	RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028	338.060	0,08	
EUR	2.270.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	2.058.456	0,51	Total Roumanie				1.851.343	0,46
EUR	1.413.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	1.199.633	0,30	ESPAGNE					
EUR	1.499.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	1.482.219	0,37	EUR	1.100.000	Banco de SAbadell SA FRN 07/02/2029	1.043.820	0,26	
EUR	1.058.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.38% 15/09/2029	1.074.274	0,27	EUR	1.800.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	1.539.436	0,38	
EUR	231.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.88% 15/09/2031	238.879	0,06	EUR	2.500.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	2.046.363	0,51	
EUR	1.214.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	1.123.763	0,28	EUR	1.800.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	1.536.376	0,38	
EUR	2.228.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	1.842.953	0,46	EUR	1.200.000	Cellnex Finance Company SA 2.00% 15/02/2033	921.342	0,23	
EUR	346.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	256.639	0,06	EUR	900.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	846.804	0,21	
					EUR	1.100.000	Cellnex Telecom SA 1.00% 20/04/2027	964.671	0,24	
					EUR	2.000.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	1.667.193	0,42	

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ESPAGNE (suite)				ROYAUME-UNI (suite)					
EUR	600.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	588.087	0,15	GBP	523.000	Barclays plc FRN 15/06/2171	540.050	0,13
EUR	2.558.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	2.002.104	0,50	EUR	1.565.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	1.333.598	0,33
EUR	1.085.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	1.023.996	0,25	GBP	410.000	Bellis Acquisition Company plc 4.50% 16/02/2026	395.724	0,10
EUR	2.011.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	1.712.352	0,43	GBP	1.676.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	1.246.388	0,31
EUR	1.586.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.447.118	0,36	EUR	1.101.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	1.020.805	0,25
EUR	400.000	International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	382.490	0,09	EUR	686.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	599.220	0,15
EUR	967.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	851.352	0,21	GBP	510.000	Centrica plc FRN 10/04/2075	548.682	0,14
EUR	4.228.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	3.892.824	0,97	GBP	1.029.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	1.099.324	0,27
		Total Espagne	22.466.328	5,59	GBP	100.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	112.998	0,03
					GBP	937.000	Co-Operative Group Limited FRN 08/07/2026	992.879	0,25
SUÈDE					GBP	1.623.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	1.542.653	0,39
EUR	1.540.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2169	792.425	0,20	EUR	1.371.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	1.267.215	0,31
EUR	932.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	479.571	0,12	EUR	454.000	INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025	426.862	0,11
EUR	530.000	Heimstaden Bostad AB FRN 19/02/2168	328.209	0,08	EUR	2.200.000	INEOS Finance plc 2.88% 01/05/2026	2.051.726	0,51
EUR	1.420.000	Heimstaden Bostad AB FRN 15/04/2169	756.025	0,19	EUR	577.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	541.363	0,13
EUR	866.608	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	834.168	0,21	EUR	396.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	371.542	0,09
EUR	1.720.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	1.435.500	0,36	EUR	1.003.000	INEOS Finance plc 6.63% 15/05/2028	1.012.941	0,25
EUR	2.044.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	1.894.138	0,46	EUR	904.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	813.666	0,20
EUR	1.190.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB - Perp FRN	441.134	0,11	EUR	2.074.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	1.866.750	0,46
EUR	1.775.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.578.593	0,39	GBP	981.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	1.062.669	0,26
EUR	798.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	709.700	0,18	EUR	1.592.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	1.407.450	0,35
EUR	486.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	452.263	0,11	EUR	120.666	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	120.088	0,03
EUR	305.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	305.938	0,08	EUR	2.677.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	2.589.990	0,64
EUR	583.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	627.063	0,16	GBP	1.538.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	1.662.826	0,41
EUR	1.932.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	1.609.799	0,40	EUR	320.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	313.257	0,08
EUR	628.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	523.268	0,13	EUR	102.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	83.910	0,02
		Total Suède	12.767.794	3,18					
ROYAUME-UNI									
GBP	340.000	Barclays plc FRN 14/11/2032	400.224	0,10					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ROYAUME-UNI (suite)					ROYAUME-UNI (suite)				
EUR	1.068.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	1.051.286	0,26	EUR	2.316.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	2.284.969	0,57
EUR	2.587.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	2.477.512	0,61	EUR	2.629.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	2.405.822	0,60
GBP	578.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	569.930	0,14	GBP	335.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	363.446	0,09
GBP	1.481.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	1.422.118	0,35	USD	1.727.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.556.168	0,39
GBP	1.617.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	1.831.335	0,45	GBP	3.131.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	2.695.844	0,67
GBP	1.245.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	1.283.429	0,32			Total Royaume-Uni	66.518.018	16,50
GBP	490.000	Marks & Spencer plc 6.00% 12/06/2025	551.475	0,14	ÉTATS-UNIS				
GBP	435.000	NatWest Markets plc 6.38% 08/11/2027	514.981	0,13	EUR	1.576.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	1.305.121	0,32
EUR	1.280.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	1.187.145	0,29	EUR	333.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	248.595	0,06
GBP	1.333.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	1.404.817	0,35	EUR	2.488.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	2.400.546	0,60
GBP	850.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	878.871	0,22	EUR	150.000	Avantor Funding Inc. 3.88% 15/07/2028	140.313	0,03
GBP	333.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	331.633	0,08	EUR	2.106.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	1.899.805	0,47
EUR	895.000	Rolls-Royce plc 1.63% 09/05/2028	744.498	0,18	EUR	535.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.74% 19/07/2024	513.963	0,13
GBP	730.000	Rolls-Royce plc 3.38% 18/06/2026	756.394	0,19	EUR	2.138.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	1.994.881	0,50
GBP	2.263.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	2.465.299	0,61	EUR	271.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	252.852	0,06
GBP	1.377.000	Santander UK plc Perp 10.06%	2.272.974	0,56	EUR	291.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	271.513	0,07
EUR	1.616.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	1.393.845	0,35	GBP	1.543.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	1.673.956	0,42
EUR	2.098.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	1.930.868	0,48	EUR	440.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	433.096	0,11
EUR	931.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	755.061	0,19	EUR	1.697.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	1.630.228	0,40
EUR	886.000	Victoria plc 3.75% 15/03/2028	698.585	0,17	EUR	715.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	686.867	0,17
GBP	988.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.13% 15/08/2030	916.616	0,23	GBP	1.055.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	1.154.331	0,29
GBP	603.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	559.901	0,14	EUR	2.646.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	2.568.339	0,63
GBP	969.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	1.036.341	0,26	GBP	1.405.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	1.597.410	0,40
GBP	1.062.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	1.056.036	0,26	EUR	3.334.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	2.966.015	0,74
EUR	1.964.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	1.607.554	0,40	EUR	599.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	511.731	0,13
GBP	1.324.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.50% 15/07/2031	1.205.587	0,30					
EUR	979.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	882.878	0,22					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ÉTATS-UNIS (suite)				ÉTATS-UNIS (suite)					
EUR	552.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	471.578	0,12	USD	602.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	622.086	0,15
EUR	1.340.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	1.207.000	0,29					
GBP	730.000	MPT Operating Partnership LP 2.50% 24/03/2026	621.792	0,15			Total États-Unis	833.766	0,20
GBP	720.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	779.870	0,20	Total Obligations			833.766	0,20
GBP	648.000	MPT Operating Partnership LP 3.69% 05/06/2028	487.489	0,12	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises			833.766	0,20
EUR	488.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	484.557	0,12	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				
EUR	666.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	680.838	0,17	Obligations				
USD	525.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	489.545	0,12	PORTUGAL				
USD	452.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	433.015	0,11	EUR	6.900.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	759.000	0,19
USD	912.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	887.149	0,22	EUR	1.000.000	Banco Espirito Santo SA 2.63% 31/12/2049**	110.000	0,03
USD	391.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	395.202	0,10	EUR	1.400.000	Banco Espirito Santo SA 4.75% 15/01/2024**	154.000	0,04
USD	1.070.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	1.146.745	0,28	Total Portugal			1.023.000	0,26
EUR	1.070.000	Olympus Water USA Holding Corp. 3.88% 01/10/2028	873.888	0,22	ROYAUME-UNI				
EUR	516.000	Olympus Water USA Holding Corp. 5.38% 01/10/2029	379.589	0,09	EUR	644.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	516.088	0,13
EUR	832.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	786.815	0,20	GBP	3.334.000	Bellis Acquisition Company plc 3.25% 16/02/2026	3.120.607	0,76
EUR	600.000	ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	599.549	0,15	GBP	4.139.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	4.420.034	1,11
Total États-Unis			32.974.183	8,19	GBP	297.000	Pinewood Finance Company Limited 3.63% 15/11/2027	301.394	0,07
Total Obligations			375.589.126	93,26	GBP	1.093.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	1.041.868	0,26
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			375.589.126	93,26	Total Royaume-Uni			9.399.991	2,33
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises				Total Obligations				10.422.991	2,59
Obligations				Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				10.422.991	2,59
ÉTATS-UNIS									
USD	227.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	211.680	0,05					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Fonds		
IRLANDE		
76.636 BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	7.575.412	1,88
3.803 BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	4.329	0,00
4.597 Insight Liquidity Funds plc	5.232	0,00
Total Irlande	7.584.973	1,88
Total Fonds	7.584.973	1,88
Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	7.584.973	1,88
Valeur totale des investissements	394.430.856	97,93
(Coût total : 431.319.513 EUR)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

**Titre à la juste valeur.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations				Obligations (suite)					
BELGIQUE				ALLEMAGNE					
EUR	200.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	203.000	0,29	EUR	453.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	419.247	0,60
Total Belgique		203.000	0,29	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.00% 14/07/2024	194.119	0,28	
FINLANDE				EUR	400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	385.952	0,55	
EUR	400.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.13% 09/03/2026	364.307	0,52	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	271.219	0,39
EUR	540.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.13% 04/02/2025	520.962	0,74	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	280.193	0,40
Total Finlande		885.269	1,26	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	186.795	0,27	
FRANCE				EUR	1.026.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	971.209	1,39	
EUR	316.000	Altice France SA 2.13% 15/02/2025	292.741	0,42	EUR	499.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	495.289	0,71
EUR	1.256.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.173.323	1,68	EUR	684.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.63% 15/05/2025	682.256	0,97
EUR	391.000	Banjay Entertainment SASU 3.50% 01/03/2025	381.210	0,54	EUR	200.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.88% 15/05/2027	176.320	0,25
EUR	300.000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 07/02/2025	92.263	0,13	EUR	180.000	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	184.585	0,26
EUR	200.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	192.119	0,27	EUR	529.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	459.717	0,66
EUR	100.000	Crown European Holdings SA 3.38% 15/05/2025	98.583	0,14	EUR	600.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	583.172	0,83
EUR	300.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	263.453	0,38	EUR	146.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	145.615	0,21
EUR	100.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	94.572	0,14	EUR	530.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	495.048	0,71
EUR	500.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	484.572	0,69	EUR	500.000	TUI Cruises GmbH 6.50% 15/05/2026	450.217	0,64
EUR	260.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	247.395	0,35	EUR	100.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	95.306	0,14
EUR	102.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	97.948	0,14	Total Allemagne		6.476.259	9,26	
EUR	1.091.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	1.047.663	1,50	GIBRALTAR				
EUR	250.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	222.900	0,32	EUR	340.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	289.452	0,41
EUR	1.028.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	999.548	1,43	Total Gibraltar		289.452	0,41	
EUR	1.356.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	1.309.330	1,87	IRLANDE				
EUR	100.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	99.391	0,14	EUR	416.000	Eircom Finance Dac 1.75% 01/11/2024	410.106	0,59
EUR	100.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	97.274	0,14	EUR	744.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	706.853	1,01
EUR	381.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	371.378	0,53	Total Irlande		1.116.959	1,60	
EUR	177.178	Loxam SAS 6.00% 15/04/2025	171.243	0,24					
EUR	820.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	812.251	1,16					
EUR	713.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	719.342	1,03					
EUR	174.000	Tereos Finance Groupe I SA 7.25% 15/04/2028	171.078	0,24					
EUR	300.000	Valeo 3.25% 22/01/2024	298.254	0,43					
EUR	400.000	Valeo 5.38% 28/05/2027	398.816	0,57					
Total France		10.136.647	14,48						

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ÎLE DE MAN				LUXEMBOURG					
EUR	368.302	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	367.269	0,53	EUR	750.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	707.515	1,01
EUR	110.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	106.046	0,15	GBP	837.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	897.021	1,29
	Total Île de Man		473.315	0,68	EUR	800.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	654.102	0,93
ITALIE				EUR					
EUR	325.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.38% 16/09/2025	326.810	0,47	EUR	100.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	96.927	0,14
EUR	419.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	374.272	0,53	EUR	150.588	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	150.574	0,22
EUR	300.000	International Design Group SpA 6.50% 15/11/2025	289.665	0,41	EUR	214.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	207.954	0,30
EUR	686.000	Lottomatica SpA 5.13% 15/07/2025	677.990	0,97	EUR	200.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 6.75% 01/11/2025	154.060	0,22
EUR	578.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	526.092	0,75	GBP	143.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	123.967	0,18
EUR	681.000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	684.455	0,98	EUR	493.000	HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	249.483	0,36
EUR	277.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	275.576	0,39	EUR	611.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	521.257	0,74
EUR	100.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	95.640	0,14	EUR	171.671	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	170.859	0,24
EUR	185.000	Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	173.181	0,25	EUR	800.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	793.165	1,13
EUR	300.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	297.991	0,43	EUR	280.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	259.978	0,37
EUR	115.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	117.669	0,17	EUR	375.000	PLT VII Finance Sarl 4.63% 05/01/2026	352.415	0,50
	Total Italie		3.839.341	5,49	EUR	100.000	PLT VII Finance Sarl 4.63% 05/01/2026	93.977	0,13
JAPON				Total Luxembourg					
EUR	130.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	129.977	0,19				5.639.762	8,05
EUR	300.000	SoftBank Group Corp. 2.13% 06/07/2024	284.918	0,41	MEXIQUE				
	Total Japon		414.895	0,60	EUR	247.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 21/02/2024	243.357	0,35
JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES				PAYS-BAS					
EUR	111.642	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	111.395	0,16	EUR	350.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	346.473	0,49
EUR	344.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	342.925	0,49	EUR	610.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	595.785	0,85
EUR	370.000	Avis Budget Finance plc 4.50% 15/05/2025	364.937	0,52	EUR	775.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	754.196	1,07
EUR	233.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	215.913	0,31	EUR	327.273	Kongsberg Actuation Systems BV 5.00% 15/07/2025	312.083	0,45
GBP	162.000	Kane Bidco Limited 6.50% 15/02/2027	165.561	0,24	EUR	353.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	344.136	0,49
	Total Jersey - Îles Anglo-Normandes		1.200.731	1,72	EUR	485.000	OI European Group BV 3.13% 15/11/2024	475.597	0,68

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			
Obligations (suite)				Obligations (suite)			
PAYS-BAS (suite)				ESPAGNE (suite)			
EUR	475.000 PPF Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	449.527	0,64	EUR	300.000 International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	286.868	0,41
EUR	468.000 PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	461.706	0,66	EUR	600.000 Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	552.435	0,79
EUR	246.000 Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	227.227	0,32		Total Espagne	4.668.171	6,66
EUR	141.000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	139.422	0,20		SUÈDE		
EUR	340.000 Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	314.728	0,45	EUR	65.660 Intrum AB 3.13% 15/07/2024	63.202	0,09
EUR	650.000 United Group BV 3.13% 15/02/2026	537.665	0,76	EUR	777.000 Intrum AB 4.88% 15/08/2025	720.031	1,03
EUR	440.000 United Group BV 4.88% 01/07/2024	428.621	0,61	EUR	473.000 Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	440.166	0,63
EUR	300.000 ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	273.893	0,39	EUR	100.000 Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	100.308	0,14
	Total Pays-Bas	5.661.059	8,06	EUR	280.000 Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	301.163	0,43
					Total Suède	1.624.870	2,32
PANAMA				ROYAUME-UNI			
EUR	100.000 Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	89.590	0,13	GBP	306.000 Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	227.562	0,33
EUR	212.000 Carnival Corp. 10.13% 01/02/2026	223.524	0,32	GBP	145.000 Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	154.910	0,22
	Total Panama	313.114	0,45	GBP	145.000 Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	163.847	0,23
ROUMANIE				GBP	124.000 Co-Operative Group Limited FRN 08/07/2026	131.395	0,19
EUR	600.000 RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	567.481	0,81	EUR	489.000 EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	451.983	0,65
	Total Roumanie	567.481	0,81	EUR	365.000 EG Global Finance plc 3.63% 07/02/2024	358.417	0,51
ESPAGNE				EUR	100.000 INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025	94.022	0,13
EUR	400.000 Banco de SAbadell SA FRN 24/03/2026	376.053	0,54	EUR	1.153.000 INEOS Finance plc 2.88% 01/05/2026	1.075.291	1,54
EUR	600.000 Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	564.536	0,81	EUR	300.000 INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	281.471	0,40
EUR	300.000 Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	294.044	0,42	EUR	482.000 INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	433.835	0,62
EUR	545.000 Gestamp Automocion SA 3.25% 30/04/2026	520.645	0,74	EUR	394.000 INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	354.629	0,51
EUR	100.000 Grifols SA 1.63% 15/02/2025	94.378	0,13	GBP	247.000 Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	267.563	0,38
EUR	1.383.000 Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.261.894	1,80	EUR	77.092 International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	76.723	0,11
EUR	500.000 Grupo Antolin-Irausa SA 3.38% 30/04/2026	420.094	0,60	EUR	1.090.000 International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	1.054.572	1,51
EUR	300.000 International Consolidated Airlines Group SA 0.50% 04/07/2023	297.224	0,42				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ROYAUME-UNI (suite)					ÉTATS-UNIS (suite)				
GBP	900.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	973.045	1,39	EUR	418.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	405.733	0,58
EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	97.893	0,14	EUR	464.000	IQVIA Inc. 1.75% 15/03/2026	433.383	0,62
EUR	240.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	236.244	0,34	EUR	750.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/09/2025	737.981	1,05
EUR	413.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	395.521	0,56	GBP	657.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	711.631	1,02
GBP	543.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	535.418	0,76	EUR	175.000	Netflix Inc. 3.00% 15/06/2025	172.319	0,25
GBP	835.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	945.680	1,35	USD	260.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	242.441	0,35
GBP	200.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	206.173	0,29	EUR	1.380.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	1.347.822	1,94
EUR	404.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	374.692	0,54	EUR	400.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	378.276	0,54
GBP	300.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	316.163	0,45	EUR	1.000.000	ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	999.248	1,43
GBP	400.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	413.587	0,59	Total États-Unis		7.487.574	10,72	
EUR	238.000	Rolls-Royce plc 0.88% 09/05/2024	229.303	0,33	Total Obligations		64.052.546	91,51	
EUR	350.000	Rolls-Royce plc 4.63% 16/02/2026	347.244	0,49	Obligations - convertibles				
EUR	482.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	415.739	0,59	FRANCE				
EUR	400.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	368.135	0,53	EUR	10.988	Elis SA 0.00% 06/10/2023	343.029	0,49
EUR	975.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	790.746	1,13	Total France		343.029	0,49	
GBP	600.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	641.697	0,92	Total Obligations - convertibles		343.029	0,49	
GBP	462.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	397.790	0,57	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				
Total Royaume-Uni			12.811.290	18,30	64.395.575 92,00				
ÉTATS-UNIS					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises				
EUR	857.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	826.876	1,18	Obligations				
EUR	290.000	Ball Corp. 0.88% 15/03/2024	282.721	0,40	ÉTATS-UNIS				
EUR	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	186.612	0,27	USD	122.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	113.766	0,16
GBP	191.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	207.210	0,30	Total États-Unis		113.766	0,16	
EUR	144.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	141.740	0,20	Total Obligations		113.766	0,16	
EUR	123.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	118.160	0,17	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises				
GBP	270.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	295.421	0,42	113.766 0,16				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
Obligations			
ROYAUME-UNI			
GBP	520.000 Bellis Acquisition Company plc 3.25% 16/02/2026	486.717	0,70
GBP	1.405.000 Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	1.500.398	2,14
GBP	178.000 Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	169.673	0,24
GBP	267.000 Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	254.077	0,36
	Total Royaume-Uni	2.410.865	3,44
	Total Obligations	2.410.865	3,44
	Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	2.410.865	3,44
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières			
Fonds			
IRLANDE			
	162 BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	16.045	0,02
	Total Irlande	16.045	0,02
	Total Fonds	16.045	0,02
	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	16.045	0,02
	Valeur totale des investissements	66.936.251	95,62

(Coût total : 70.953.282 EUR)

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			
	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Obligations				Obligations (suite)			
AUTRICHE				FRANCE (suite)			
EUR	400.000 Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	326.458	0,09	EUR	1.600.000 CNP Assurances FRN 18/07/2053	1.548.980	0,44
EUR	100.000 Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	81.614	0,02	EUR	9.500.000 Credit Agricole SA 0.13% 09/12/2027	8.033.738	2,27
EUR	2.800.000 Erste Group Bank AG FRN 16/01/2031	2.758.920	0,78	EUR	2.000.000 Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	1.647.088	0,46
EUR	2.200.000 Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 07/12/2026	2.047.713	0,58	EUR	2.600.000 Credit Mutuel Arkea SA 0.38% 03/10/2028	2.136.301	0,60
	Total Autriche	5.214.705	1,47	EUR	700.000 Credit Mutuel Arkea SA FRN 11/06/2029	601.956	0,17
BELGIQUE				EUR	4.300.000 Danone SA 1.00% 26/03/2025	4.139.960	1,17
EUR	700.000 Bpost SA 1.25% 11/07/2026	650.294	0,18	EUR	700.000 Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	502.625	0,14
EUR	1.000.000 KBC Group NV FRN 16/06/2027	892.947	0,25	EUR	300.000 Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	215.411	0,06
EUR	900.000 VGP NV 1.63% 17/01/2027	700.477	0,20	EUR	1.200.000 Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	978.514	0,28
	Total Belgique	2.243.718	0,63	EUR	675.000 Getlink SE 3.50% 30/10/2025	656.318	0,19
DANEMARK				EUR	800.000 Ile-de-France Mobilites 0.40% 28/05/2031	649.289	0,18
EUR	5.471.000 Danske Bank AS FRN 10/01/2031	5.498.088	1,55	EUR	3.400.000 La Banque Postale SA 0.75% 23/06/2031	2.588.961	0,73
EUR	550.000 Nykredit Realkredit AS 0.38% 17/01/2028	458.186	0,13	EUR	800.000 La Poste SA 1.38% 21/04/2032	658.463	0,19
EUR	700.000 Orsted A/S FRN 24/11/3017	665.068	0,19	EUR	3.700.000 Orange SA 0.13% 16/09/2029	2.988.055	0,84
	Total Danemark	6.621.342	1,87	EUR	300.000 Orange SA 0.13% 16/09/2029	242.275	0,07
FINLANDE				EUR	900.000 Orange SA 2.38% 18/05/2032	816.060	0,23
EUR	1.500.000 Elenia Verkko Oyj 0.38% 06/02/2027	1.310.847	0,37	EUR	400.000 Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	396.220	0,11
EUR	900.000 OP Corporate Bank plc 0.38% 26/02/2024	873.863	0,25	EUR	800.000 Regie Autonome des Transports Parisiens 0.88% 25/05/2027	732.458	0,21
	Total Finlande	2.184.710	0,62	EUR	1.100.000 RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	833.363	0,23
FRANCE				EUR	700.000 RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.88% 23/10/2037	557.645	0,16
EUR	1.400.000 AXA SA FRN 07/10/2041	1.054.066	0,30	EUR	2.800.000 Sanofi 1.50% 01/04/2030	2.510.660	0,71
EUR	2.700.000 Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.00% 21/11/2029	2.756.018	0,78	EUR	1.600.000 Schneider Electric SE 1.84% 13/10/2025	1.533.985	0,43
EUR	2.000.000 BNP Paribas SA FRN 14/10/2027	1.752.547	0,49	EUR	200.000 SNCF Reseau 2.25% 20/12/2047	154.173	0,04
EUR	2.200.000 BNP Paribas SA 1.00% 17/04/2024	2.139.842	0,60	EUR	1.100.000 Societe du Grand Paris EPIC 1.63% 08/04/2042	794.591	0,22
EUR	2.400.000 BPCE SA 0.63% 26/09/2023	2.368.979	0,67	EUR	2.500.000 Societe Generale SA FRN 02/12/2027	2.165.831	0,61
EUR	2.400.000 BPCE SA FRN 02/02/2034	1.972.241	0,56	EUR	900.000 Societe Generale SA FRN 02/12/2027	779.699	0,22
EUR	2.400.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2026	2.158.399	0,61	EUR	1.800.000 Suez SACA 4.63% 03/11/2028	1.852.208	0,52
EUR	1.500.000 Caisse des Depots et Consignations 0.01% 15/09/2025	1.392.566	0,39	EUR	1.500.000 Unedic Asseo 0.25% 25/11/2029	1.259.671	0,36
EUR	1.500.000 Caisse des Depots et Consignations 0.01% 01/06/2026	1.366.485	0,39		Total France	58.935.641	16,63

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ALLEMAGNE					ALLEMAGNE (suite)				
EUR	3.300.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	3.363.995	0,95	EUR	300.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	298.761	0,08
EUR	900.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.25% 21/03/2036	630.725	0,18	EUR	900.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	896.263	0,26
EUR	1.100.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.63% 22/11/2027	989.255	0,28	EUR	100.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	99.585	0,03
EUR	2.900.000	Commerzbank AG FRN 24/03/2026	2.669.007	0,75	EUR	2.600.000	Vonovia SE 1.38% 28/01/2026	2.355.823	0,65
EUR	1.500.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.35% 29/09/2031	1.187.205	0,33	EUR	3.900.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	2.055.797	0,58
EUR	600.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.63% 08/12/2050	305.912	0,09	EUR	2.600.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	2.217.763	0,63
EUR	2.700.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	2.533.886	0,71	EUR	1.100.000	Vonovia SE 4.75% 23/05/2027	1.076.499	0,30
EUR	2.000.000	Deutsche Bank AG FRN 23/02/2028	1.736.251	0,49	Total Allemagne			42.130.675	11,85
EUR	500.000	Deutsche Bank AG FRN 24/05/2028	453.981	0,13	IRLANDE				
EUR	425.000	Deutsche Kreditbank AG 0.01% 07/11/2029	349.101	0,10	EUR	2.620.000	AIB Group plc FRN 04/04/2028	2.377.042	0,67
EUR	600.000	Deutsche Kreditbank AG 0.88% 02/10/2028	534.266	0,15	EUR	5.214.000	AIB Group plc FRN 23/07/2029	5.108.561	1,44
EUR	1.985.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	1.506.724	0,42	EUR	1.000.000	Bank of Ireland Group plc FRN 10/05/2027	881.710	0,25
EUR	1.700.000	E.ON SE 0.35% 28/02/2030	1.356.247	0,38	EUR	3.183.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	2.736.691	0,77
EUR	915.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	694.535	0,20	EUR	750.000	Bank of Ireland Group plc FRN 16/07/2028	752.229	0,21
EUR	2.000.000	E.ON SE 1.63% 29/03/2031	1.730.507	0,49	EUR	600.000	ESB Finance DAC 1.00% 19/07/2034	458.337	0,13
EUR	4.500.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	3.669.940	1,02	EUR	1.250.000	Kerry Group Financial Services Unltd Company 0.88% 01/12/2031	992.994	0,28
EUR	600.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	473.654	0,13	EUR	800.000	Lunar Funding V for Swisscom AG 1.13% 12/10/2026	734.793	0,21
EUR	300.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	236.827	0,07	Total Irlande			14.042.357	3,96
EUR	750.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	625.080	0,17	ITALIE				
EUR	250.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	208.360	0,06	EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	563.733	0,16
EUR	2.800.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 26/05/2041	2.103.444	0,59	EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	563.733	0,16
EUR	1.000.000	NRW Bank 0.10% 09/07/2035	693.123	0,20	EUR	1.100.000	Assicurazioni Generali SpA 1.71% 30/06/2032	822.938	0,23
EUR	2.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	2.767.219	0,78	EUR	400.000	Banco BPM SpA 0.88% 15/07/2026	355.518	0,10
EUR	1.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	1.813.005	0,51	EUR	1.200.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.13% 09/07/2026	1.113.749	0,31
EUR	500.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	497.935	0,14	EUR	1.300.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.50% 27/06/2025	1.244.598	0,35
					EUR	2.450.000	Intesa Sanpaolo SpA 5.25% 13/01/2030	2.544.074	0,72
					EUR	1.800.000	Snam SpA 0.00% 07/12/2028	1.454.244	0,41
					EUR	1.800.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.38% 23/06/2029	1.478.826	0,42

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ITALIE (suite)				PAYS-BAS (suite)					
EUR	400.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale FRN 09/02/2171	335.270	0,09	EUR	300.000	EnBW International Finance BV 1.88% 31/10/2033	250.903	0,07
EUR	200.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale FRN 09/02/2171	167.635	0,05	EUR	2.200.000	Enel Finance International NV 1.50% 21/07/2025	2.111.378	0,60
	Total Italie		10.644.318	3,00	EUR	1.775.000	Enexis Holding NV 0.38% 14/04/2033	1.322.493	0,37
					EUR	221.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	172.893	0,05
LUXEMBOURG				PAYS-BAS (suite)					
EUR	2.850.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	2.645.430	0,75	EUR	1.029.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	805.007	0,23
EUR	400.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	284.546	0,08	EUR	1.597.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 1.75% 29/03/2030	1.401.216	0,40
EUR	2.150.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	1.345.535	0,38	GBP	3.300.000	ING Groep NV FRN 07/12/2028	3.079.660	0,87
EUR	600.000	CPI Property Group SA 1.75% 14/01/2030	345.058	0,10	EUR	1.900.000	ING Groep NV 2.50% 15/11/2030	1.729.942	0,49
EUR	900.000	CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	715.886	0,20	EUR	600.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	528.578	0,15
EUR	1.259.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	946.873	0,27	EUR	100.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	88.096	0,02
EUR	241.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	181.252	0,05	EUR	250.000	Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV 0.13% 03/04/2027	223.116	0,06
EUR	4.600.000	Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	3.433.248	0,97	EUR	1.200.000	Rentokil Initial Finance BV 3.88% 27/06/2027	1.198.534	0,34
EUR	2.100.000	Prologis International Funding II SA 3.13% 01/06/2031	1.810.449	0,51	EUR	900.000	Royal Schiphol Group NV 1.50% 05/11/2030	776.321	0,22
EUR	1.600.000	Segro Capital Sarl 0.50% 22/09/2031	1.089.248	0,31	EUR	300.000	Royal Schiphol Group NV 2.00% 06/04/2029	275.725	0,08
EUR	2.150.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	1.976.122	0,56	EUR	1.000.000	Stedin Holding NV 0.00% 16/11/2026	890.395	0,25
	Total Luxembourg		14.773.647	4,18	EUR	3.400.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	2.817.951	0,79
PAYS-BAS				PAYS-BAS (suite)					
EUR	1.029.000	Achmea BV 3.63% 29/11/2025	1.027.058	0,29	EUR	364.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	306.472	0,09
EUR	1.100.000	Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	987.468	0,28	EUR	2.200.000	Swisscom Finance BV 0.38% 14/11/2028	1.861.382	0,52
EUR	2.600.000	Allianz Finance II BV 1.50% 15/01/2030	2.344.322	0,67	EUR	500.000	Tennet Holding BV 0.50% 30/11/2040	326.138	0,09
EUR	800.000	Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 30/10/2026	718.120	0,20	EUR	1.393.000	TenneT Holding BV 0.88% 16/06/2035	1.080.104	0,30
USD	550.000	Cooperatieve Rabobank UA 1.00% 24/09/2026	454.950	0,13	EUR	1.160.000	TenneT Holding BV 3.88% 28/10/2028	1.188.823	0,34
GBP	1.000.000	Cooperatieve Rabobank UA 4.63% 23/05/2029	1.041.304	0,29	EUR	1.100.000	TenneT Holding BV Perp FRN	1.082.337	0,30
EUR	1.450.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	1.132.266	0,32	EUR	4.000.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.004.297	0,85
EUR	3.290.000	Digital Intrepid Holding BV 0.63% 15/07/2031	2.273.497	0,64		Total Pays-Bas		36.741.993	10,37
USD	251.000	EDP Finance BV 6.30% 11/10/2027	241.247	0,07	NORVÈGE				
					EUR	200.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	163.063	0,05
					EUR	1.050.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	856.079	0,24

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)			Obligations (suite)				
NORVÈGE (suite)			ROYAUME-UNI (suite)				
EUR 1.850.000	Avinor AS 1.00% 29/04/2025	1.753.478	0,49	GBP 740.000	Cadent Finance plc 5.75% 14/03/2034	858.285	0,24
EUR 200.000	Avinor AS 1.25% 09/02/2027	183.081	0,05	GBP 200.000	Cardiff University 3.00% 07/12/2055	166.372	0,05
EUR 2.326.000	DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	2.288.336	0,65	GBP 810.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	865.357	0,24
	Total Norvège	5.244.037	1,48	GBP 630.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	618.066	0,17
PORTUGAL			GBP 400.000	DWR Cymru Financing UK plc 2.38% 31/03/2034	339.250	0,10	
EUR 700.000	Caixa Geral de Depositos SA FRN 31/10/2028	723.086	0,20	GBP 300.000	Legal & General Group plc FRN 27/10/2045	333.382	0,09
	Total Portugal	723.086	0,20	EUR 950.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	800.587	0,23
ESPAGNE			EUR 3.800.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	3.202.350	0,90	
EUR 800.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 04/06/2025	752.640	0,21	EUR 3.000.000	Motability Operations Group plc 3.50% 17/07/2031	2.962.823	0,83
EUR 1.000.000	Banco de Sabadell SA FRN 11/03/2027	903.286	0,25	EUR 308.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	302.087	0,09
EUR 1.100.000	Banco Santander SA 1.13% 23/06/2027	984.331	0,28	EUR 1.167.000	National Grid plc 3.88% 16/01/2029	1.161.072	0,33
EUR 4.200.000	CaixaBank SA FRN 21/01/2028	3.730.767	1,05	EUR 300.000	Nationwide Building Society 2.00% 28/04/2027	278.463	0,08
EUR 1.000.000	CaixaBank SA FRN 26/05/2028	860.920	0,24	EUR 8.050.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	6.469.674	1,83
EUR 1.700.000	Iberdrola Finanzas SA 1.38% 11/03/2032	1.461.968	0,41	EUR 1.944.000	NatWest Group plc FRN 14/03/2028	1.967.532	0,55
EUR 1.600.000	Telefonica Emisiones SA 2.59% 25/05/2031	1.476.275	0,42	GBP 900.000	Pearson Funding plc 3.75% 04/06/2030	921.034	0,26
	Total Espagne	10.170.187	2,86	GBP 270.000	Platform HG Financing plc 1.93% 15/09/2041	201.320	0,06
SUÈDE			GBP 400.000	RCB Bonds plc 3.50% 08/12/2031	387.270	0,11	
EUR 1.500.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	1.464.887	0,41	GBP 500.000	RL Finance Bonds No. 2 plc FRN 30/11/2043	563.379	0,16
EUR 100.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	89.915	0,03	GBP 500.000	Severn Trent Utilities Finance plc 2.00% 02/06/2040	358.072	0,10
EUR 500.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	449.575	0,13	GBP 200.000	Stonewater Funding plc 1.63% 10/09/2036	155.592	0,04
	Total Suède	2.004.377	0,57	EUR 5.130.000	Thames Water Utilities Finance plc 4.38% 18/01/2031	5.136.431	1,45
SUISSE			GBP 200.000	University College London 1.63% 04/06/2061	117.569	0,03	
EUR 1.000.000	Credit Suisse AG 0.45% 19/05/2025	908.495	0,26	GBP 300.000	University of Southampton 2.25% 11/04/2057	203.073	0,06
	Total Suisse	908.495	0,26	USD 1.000.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	901.082	0,25
ROYAUME-UNI							
GBP 250.000	Aster Treasury plc 1.41% 27/01/2036	196.297	0,06				
EUR 2.100.000	AstraZeneca plc 0.38% 03/06/2029	1.753.489	0,49				
GBP 800.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	875.126	0,25				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)					
ROYAUME-UNI (suite)				FRANCE (suite)					
EUR	8.450.000	WellCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	7.787.801	2,19	EUR	400.000	Agence France Locale 0.20% 20/03/2029	337.161	0,10
GBP	1.600.000	Yorkshire Building Society FRN 11/10/2030	1.586.602	0,44	EUR	1.000.000	Caisse d'Amortissement de la Dettes Sociale 0.00% 25/02/2028	865.980	0,24
		Total Royaume-Uni	41.469.437	11,68	EUR	1.200.000	Caisse d'Amortissement de la Dettes Sociale 0.00% 25/11/2030	957.563	0,27
ÉTATS-UNIS					GBP	1.200.000	Caisse D'amortissement de la Dettes Sociale 0.13% 15/12/2025	1.218.099	0,34
EUR	292.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	294.046	0,08	EUR	300.000	Caisse Francaise de Financement Local 0.01% 07/05/2025	279.883	0,08
USD	2.600.000	Roche Holdings Inc. 2.38% 28/01/2027	2.239.780	0,63	EUR	1.100.000	Caisse Francaise de Financement Local 0.50% 19/02/2027	991.020	0,28
		Total États-Unis	2.533.826	0,71	EUR	2.100.000	City of Paris 1.38% 20/11/2034	1.705.894	0,48
Total Obligations		256.586.551	72,34		EUR	400.000	France (Govt of) 1.75% 25/06/2039	333.088	0,09
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance					EUR	1.200.000	Region of Ile de France 0.00% 20/04/2028	1.031.406	0,29
AUTRICHE					EUR	700.000	Region of Ile de France 0.50% 14/06/2025	661.393	0,19
EUR	700.000	Oesterreichische Kontrollbank AG 0.00% 08/10/2026	629.493	0,18	EUR	400.000	Region of Ile de France 0.61% 02/07/2040	251.192	0,07
		Total Autriche	629.493	0,18	EUR	700.000	SNCF SA 1.00% 19/01/2061	296.525	0,08
BELGIQUE					EUR	600.000	Societe du Grand Paris EPIC 0.00% 25/11/2030	473.813	0,13
EUR	250.000	Belgium (Govt of) 1.25% 22/04/2033	214.516	0,06	EUR	100.000	Societe du Grand Paris EPIC 1.70% 25/05/2050	67.073	0,02
EUR	2.400.000	Communaute Francaise de Belgique 0.63% 11/06/2035	1.726.956	0,49	EUR	3.000.000	Unedic Asseo 0.00% 25/11/2028	2.542.674	0,72
EUR	1.400.000	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 0.38% 15/04/2030	1.164.173	0,33	EUR	1.700.000	Unedic Asseo 0.00% 19/11/2030	1.365.440	0,38
EUR	1.800.000	Region Wallonne 1.05% 22/06/2040	1.201.126	0,34	EUR	1.200.000	Unedic Asseo 0.10% 25/11/2026	1.081.014	0,30
		Total Belgique	4.306.771	1,22	EUR	600.000	Unedic Asseo 1.75% 25/11/2032	536.618	0,15
FINLANDE					Total France		18.647.059	5,24	
EUR	1.700.000	Kuntarahoitus Oyj 0.05% 10/09/2035	1.171.158	0,33	ALLEMAGNE				
		Total Finlande	1.171.158	0,33	EUR	8.140.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2030	6.928.606	1,95
FRANCE					EUR	441.000	Germany (Govt of) 1.30% 15/10/2027	422.394	0,12
EUR	2.500.000	Action Logement Services 3.13% 28/09/2037	2.362.471	0,67	EUR	400.000	Hesse (Govt of) 0.01% 18/06/2031	315.901	0,09
USD	1.400.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 4.00% 21/09/2027	1.288.752	0,36	EUR	2.000.000	Investitionsbank Berlin 2.75% 04/10/2027	1.986.679	0,56
					EUR	2.453.000	Land Berlin 2.75% 14/02/2033	2.417.644	0,68
					EUR	3.500.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.00% 22/09/2027	3.069.142	0,86

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	
ALLEMAGNE (suite)				PAYS-BAS (suite)				
EUR	1.475.000 State of North Rhine-Westphalia 0.60% 04/06/2041	944.427	0,27	EUR	500.000 Netherlands (Govt of) 0.50% 15/01/2040	351.200	0,10	
EUR	600.000 State of North Rhine-Westphalia Germany 0.95% 13/03/2028	545.457	0,15	Total Pays-Bas				
Total Allemagne			4,68	5.043.796			1,44	
HONGRIE				RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)				
EUR	1.777.000 Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	1.791.397	0,51	USD	571.000 Export-Import Bank of Korea 5.13% 11/01/2033	548.426	0,15	
EUR	250.000 MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 1.38% 24/06/2025	230.254	0,06	Total République de Corée (du Sud)				
Total Hongrie			0,57	548.426			0,15	
IRLANDE				ESPAGNE				
EUR	25.000 Ireland (Govt of) 1.35% 18/03/2031	22.672	0,01	EUR	1.400.000 Autonomous Community of Andalusia 0.50% 30/04/2031	1.110.130	0,31	
Total Irlande			0,01	EUR	1.000.000 Autonomous Community of Andalusia 2.40% 30/04/2032	913.014	0,26	
ITALIE				EUR	1.700.000 Autonomous Community of Madrid 0.42% 30/04/2030	1.393.384	0,39	
EUR	800.000 Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.00% 11/02/2030	653.277	0,18	EUR	700.000 Autonomous Community of Madrid 1.57% 30/04/2029	635.070	0,18	
EUR	700.000 Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.00% 20/04/2027	654.689	0,18	EUR	3.200.000 Autonomous Community of Madrid 1.72% 30/04/2032	2.766.825	0,78	
EUR	800.000 Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.13% 21/03/2026	765.117	0,22	EUR	300.000 Basque (Govt of) 1.88% 30/07/2033	258.479	0,07	
EUR	250.000 Italy (Govt of) 1.50% 30/04/2045	151.373	0,04	EUR	1.500.000 Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	1.409.226	0,41	
Total Italie			0,62	EUR	200.000 Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	187.897	0,05	
LUXEMBOURG				EUR	700.000 Instituto de Credito Oficial 0.25% 30/04/2024	679.020	0,19	
EUR	775.000 Luxembourg (Govt of) 0.00% 14/09/2032	590.271	0,17	EUR	1.810.000 Instituto de Credito Oficial 0.75% 31/10/2023	1.782.823	0,51	
Total Luxembourg			0,17	EUR	25.000 Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	15.837	0,00	
PAYS-BAS				EUR	400.000 Xunta de Galicia 0.08% 30/07/2027	351.421	0,10	
EUR	1.800.000 BNG Bank NV 3.00% 11/01/2033	1.784.622	0,50	Total Espagne			11.503.126	3,25
EUR	600.000 Nederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 03/09/2035	413.809	0,12	SUPRANATIONALES				
EUR	800.000 Nederlandse Waterschapsbank NV 1.50% 15/06/2039	627.208	0,18	CAD	300.000 Asian Development Bank 1.50% 04/05/2028	186.602	0,05	
EUR	1.900.000 Nederlandse Waterschapsbank NV 2.75% 17/12/2029	1.866.957	0,54	CAD	800.000 Asian Development Bank 1.63% 28/01/2025	520.850	0,15	
				GBP	1.500.000 Asian Development Bank FRN 23/05/2029	1.774.905	0,50	

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)					Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)				
SUPRANATIONALES (suite)					SUÈDE				
USD	200.000	Central American Bank for Economic Integration 5.00% 09/02/2026	186.040	0,05	SEK	3.000.000	Sweden (Govt of) 0.13% 09/09/2030	228.207	0,06
EUR	1.000.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 10/04/2026	912.814	0,26	Total Suède				
EUR	1.450.000	Council of Europe Development Bank 0.38% 27/03/2025	1.371.154	0,39	ROYAUME-UNI				
EUR	5.000.000	Council of Europe Development Bank 1.00% 13/04/2029	4.460.697	1,26	GBP	1.118.000	International Finance Facility for Immunisation Company 2.75% 07/06/2025	1.232.254	0,35
EUR	4.000.000	Council Of Europe Development Bank 0.00% 09/04/2027	3.547.004	0,99	GBP	5.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	4.387	0,00
EUR	2.000.000	European Investment Bank 0.00% 15/05/2028	1.724.362	0,49	Total Royaume-Uni				
GBP	975.000	European Investment Bank 0.88% 15/05/2026	1.006.748	0,28	Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				
EUR	100.000	European Union 0.00% 04/07/2035	68.428	0,02	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				
EUR	700.000	European Union 0.00% 04/07/2035	478.995	0,14	348.262.497 98,18				
EUR	1.700.000	European Union 0.10% 04/10/2040	988.051	0,28	Organismes de placement collectif en valeurs mobilières				
EUR	5.240.000	European Union 0.30% 04/11/2050	2.486.704	0,69	Fonds				
EUR	1.500.000	European Union 0.75% 04/01/2047	889.415	0,25	IRLANDE				
EUR	500.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.01% 24/04/2028	430.756	0,12	260	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	25.702	0,01	
EUR	399.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.20% 21/01/2061	145.182	0,04	Total Irlande				
EUR	300.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	180.188	0,05	Total Fonds				
EUR	100.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	60.063	0,02	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières				
USD	2.790.000	International Finance Facility for Immunisation Company 0.38% 06/11/2023	2.502.767	0,71	Valeur totale des investissements				
USD	1.950.000	International Finance Facility for Immunisation Company 1.00% 21/04/2026	1.632.950	0,46	348.288.199 98,19				
SEK	3.000.000	Nordic Investment Bank 0.10% 13/10/2025	244.988	0,07	(Coût total : 397.241.488 EUR)				
EUR	1.100.000	Nordic Investment Bank 2.50% 30/01/2030	1.072.306	0,30	<i>*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.</i>				
Total Supranationales			26.871.969	7,57					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations				Obligations (suite)					
AUSTRALIE				DANEMARK					
EUR	823.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	606.813	0,45	USD	1.819.000	Danske Bank AS 1.55% 15/09/2027	1.466.217	1,07
EUR	935.000	APA Infrastructure Limited 2.00% 15/07/2030	794.491	0,58	Total Danemark				
EUR	418.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	318.911	0,23	FRANCE				
EUR	250.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	190.736	0,14	EUR	152.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	119.276	0,09
EUR	600.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 05/05/2031	522.993	0,38	EUR	363.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	273.704	0,20
EUR	1.135.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	1.161.260	0,86	EUR	1.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.13% 13/03/2029	1.019.315	0,75
GBP	840.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	947.711	0,70	EUR	1.000.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	720.135	0,53
EUR	1.200.000	Westpac Banking Corp. 3.80% 17/01/2030	1.192.964	0,87	USD	850.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	686.393	0,50
USD	1.270.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.128.593	0,83	EUR	377.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	115.833	0,09
Total Australie			6.864.472	5,04	EUR	480.000	Chrome Holdco SASU 5.00% 31/05/2029	356.926	0,26
BELGIQUE				FRANCE (suite)					
EUR	364.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	369.460	0,27	EUR	515.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	419.027	0,31
EUR	400.000	Kbc Group NV Perp FRN	338.138	0,25	EUR	200.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	196.158	0,14
Total Belgique			707.598	0,52	EUR	431.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	378.494	0,28
BERMUDES				FRANCE (suite)					
USD	833.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	754.369	0,56	EUR	357.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	312.313	0,23
Total Bermudes			754.369	0,56	EUR	239.000	Faurecia SE 7.25% 15/06/2026	247.016	0,18
CANADA				FRANCE (suite)					
EUR	299.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	260.870	0,19	EUR	367.000	Foncia Management SA 3.38% 31/03/2028	291.345	0,21
Total Canada			260.870	0,19	EUR	677.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	658.262	0,48
ÎLES CAÏMANS				FRANCE (suite)					
USD	889.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	697.453	0,52	EUR	554.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	534.933	0,39
GBP	2.605.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	2.567.986	1,88	EUR	200.000	iliad SA 1.50% 14/10/2024	191.917	0,14
USD	534.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	324.641	0,24	EUR	200.000	iliad SA 1.88% 11/02/2028	168.386	0,12
Total Îles Caïmans			3.590.080	2,64	EUR	400.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	397.563	0,29
				Total France					
				7.354.445					
				5,39					
				ALLEMAGNE					
				EUR 700.000 Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025				578.640	0,43
				EUR 1.000.000 Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033				739.132	0,54
				EUR 600.000 Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032				611.635	0,45
				EUR 477.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027				441.460	0,33
				EUR 131.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028				122.303	0,09
				EUR 400.000 Commerzbank AG FRN 29/12/2031				329.461	0,24
				EUR 200.000 Commerzbank AG FRN 05/12/2030				188.219	0,14

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ALLEMAGNE (suite)					GUATEMALA				
EUR	200.000	Commerzbank AG FRN 06/12/2032	198.150	0,15	USD	800.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	679.215	0,50
EUR	500.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	394.691	0,29	Total Guatemala				
EUR	300.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	286.882	0,21				679.215	0,50
USD	200.000	Deutsche Bank AG FRN 10/02/2034	171.477	0,13	INDE				
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	192.976	0,14	USD	1.328.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	935.154	0,68
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	186.795	0,14	USD	535.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	432.482	0,32
EUR	400.000	Hannover Rueck SE FRN 26/08/2043	408.844	0,30	Total Inde				
EUR	338.960	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	347.594	0,26				1.367.636	1,00
EUR	7.500.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 05/05/2027	6.671.201	4,90	IRLANDE				
EUR	600.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	459.850	0,34	EUR	450.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	408.141	0,30
EUR	513.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	447.773	0,32	EUR	461.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	430.490	0,32
EUR	492.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	427.563	0,32	EUR	720.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	619.044	0,46
EUR	705.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	574.195	0,42	EUR	969.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	920.619	0,68
EUR	316.511	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	301.652	0,22	GBP	135.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.88% 15/07/2028	131.257	0,10
EUR	200.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	158.482	0,12	Total Irlande				
EUR	500.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	502.633	0,37				2.509.551	1,86
EUR	1.400.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	1.446.289	1,06	ITALIE				
EUR	1.200.000	Volkswagen Financial Services AG 0.38% 12/02/2030	929.637	0,68	EUR	880.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	741.587	0,55
EUR	300.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	281.364	0,21	EUR	565.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	458.197	0,34
Total Allemagne			17.398.898	12,80	EUR	216.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	213.502	0,16
GIBRALTAR					EUR	371.000	ENI SpA - Perp FRN	309.979	0,23
EUR	160.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	136.213	0,10	EUR	387.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	345.688	0,25
Total Gibraltar			136.213	0,10	EUR	586.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	516.657	0,38
GRÈCE					EUR	287.000	International Design Group SpA 6.50% 15/11/2025	277.113	0,20
EUR	774.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029	754.537	0,55	USD	400.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	321.858	0,24
Total Grèce			754.537	0,55	EUR	150.000	Lottomatica SpA 6.25% 15/07/2025	149.908	0,11
					EUR	178.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	189.187	0,14

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ITALIE (suite)				LUXEMBOURG (suite)					
EUR	241.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	246.594	0,18	EUR	1.542.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	1.417.292	1,04
Total Italie		3.770.270	2,78	Total Luxembourg		10.627.287	7,81		
JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES				MEXIQUE					
GBP	196.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	237.712	0,17	EUR	486.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	435.236	0,32
EUR	245.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	227.033	0,17	EUR	214.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	169.584	0,12
Total Jersey - Îles Anglo-Normandes		464.745	0,34	Total Mexique		604.820	0,44		
LUXEMBOURG				PAYS-BAS					
EUR	428.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	342.267	0,25	EUR	362.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	375.845	0,28
EUR	843.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	632.878	0,46	USD	505.000	Braskem Netherlands Finance BV 7.25% 13/02/2033	449.108	0,33
EUR	2.200.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	1.476.812	1,09	EUR	160.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	156.272	0,11
GBP	300.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	215.830	0,16	EUR	525.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	510.907	0,38
GBP	383.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	410.464	0,30	EUR	350.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	246.706	0,18
EUR	662.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	541.270	0,40	EUR	545.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	384.157	0,28
EUR	128.869	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	128.856	0,09	GBP	1.508.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	1.809.972	1,34
EUR	311.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	302.213	0,22	EUR	700.000	ING Groep NV FRN 29/09/2028	585.947	0,43
GBP	266.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	230.595	0,17	EUR	800.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	673.362	0,50
EUR	1.200.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	848.448	0,62	EUR	450.000	LKQ European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	436.307	0,32
USD	200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	189.732	0,14	USD	667.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	526.134	0,39
EUR	1.430.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	1.219.963	0,90	EUR	416.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	294.912	0,22
EUR	301.169	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	299.744	0,22	EUR	519.000	Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	380.696	0,28
EUR	280.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	261.350	0,20	EUR	1.258.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	1.059.182	0,78
EUR	160.000	Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	154.397	0,11	EUR	610.000	Stichting AK Rabobank Certificaten 6.50% 29/03/2070	590.608	0,43
USD	812.700	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	691.238	0,51	EUR	496.921	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	389.901	0,29
EUR	1.406.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	1.057.430	0,78	EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	102.023	0,07
EUR	222.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	206.508	0,15	EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	83.333	0,06
					EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	587.009	0,43
					EUR	1.147.000	Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	1.071.534	0,79

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*			
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)						
Obligations (suite)				Obligations (suite)						
PAYS-BAS (suite)				SUISSE (suite)						
EUR	1.000.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	751.074	0,55	EUR	1.255.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	824.054	0,61	
EUR	280.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	259.187	0,19	EUR	300.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2032	251.399	0,18	
EUR	261.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	215.893	0,16	Total Suisse					
EUR	109.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	80.849	0,06	1.751.714 1,29					
EUR	284.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	269.254	0,20	ROYAUME-UNI					
Total Pays-Bas				12.290.172	9,05	GBP	500.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	459.493	0,34
ESPAGNE						EUR	318.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	320.649	0,24
GBP	700.000	Banco Santander SA 5.13% 25/01/2030	782.950	0,58	EUR	220.000	Anglo American Capital plc 5.00% 15/03/2031	225.995	0,17	
EUR	300.000	Cellnex Finance Company SA 0.75% 15/11/2026	265.046	0,20	EUR	300.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	255.642	0,19	
EUR	200.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	166.719	0,12	GBP	710.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	528.004	0,38	
EUR	823.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	750.932	0,55	EUR	1.113.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	1.031.931	0,76	
EUR	155.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	136.463	0,10	EUR	936.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	764.040	0,56	
EUR	553.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	509.161	0,37	EUR	825.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	665.580	0,49	
EUR	298.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	278.398	0,20	GBP	350.000	Cadent Finance plc 2.25% 10/10/2035	280.604	0,21	
Total Espagne				2.889.669	2,12	GBP	548.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	585.451	0,43
SUÈDE						GBP	509.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	483.802	0,35
EUR	345.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	177.524	0,13	EUR	632.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	584.157	0,42	
EUR	660.000	Heimstaden Bostad AB FRN 15/04/2169	351.392	0,26	EUR	1.074.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	1.046.949	0,77	
EUR	91.194	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	87.781	0,06	USD	728.000	HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	664.125	0,49	
EUR	164.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	151.976	0,11	USD	304.000	HSBC Holdings plc FRN 09/03/2044	296.718	0,22	
EUR	1.371.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.114.444	0,82	GBP	576.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	689.430	0,51	
EUR	194.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	172.533	0,13	EUR	158.000	INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025	148.555	0,11	
EUR	115.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	115.354	0,08	EUR	331.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	310.556	0,23	
EUR	555.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	462.442	0,34	EUR	61.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	57.232	0,04	
Total Suède				2.633.446	1,93	EUR	303.000	INEOS Finance plc 6.63% 15/05/2028	306.003	0,22
SUISSE						EUR	192.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	172.814	0,13
EUR	857.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	676.261	0,50						

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ROYAUME-UNI (suite)					ÉTATS-UNIS				
EUR	130.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	117.009	0,09	EUR	1.034.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	1.041.245	0,77
GBP	304.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	329.308	0,24	USD	209.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	163.436	0,12
GBP	315.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	340.566	0,25	USD	560.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	527.290	0,39
GBP	175.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	180.402	0,13	USD	901.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	852.482	0,62
GBP	380.733	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	404.394	0,30	EUR	295.000	Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	282.706	0,21
EUR	483.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	473.727	0,35	EUR	660.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	546.561	0,40
EUR	600.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	485.713	0,36	EUR	190.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	141.841	0,10
EUR	602.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	493.418	0,36	EUR	540.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	428.629	0,32
EUR	1.587.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	1.336.719	0,98	EUR	713.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	565.949	0,42
EUR	244.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	226.300	0,17	EUR	521.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	409.990	0,30
GBP	297.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	313.001	0,23	EUR	889.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 1.50% 18/03/2030	782.533	0,58
GBP	165.000	Santander UK plc Perp 10.06% 15/11/2026	272.361	0,20	USD	243.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	223.689	0,16
EUR	481.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	414.876	0,31	EUR	485.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	437.514	0,32
EUR	340.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	312.915	0,23	GBP	319.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	346.074	0,25
GBP	620.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	624.817	0,46	EUR	113.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	108.554	0,08
EUR	800.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	691.708	0,51	GBP	145.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	158.652	0,12
EUR	489.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	396.589	0,29	EUR	938.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	910.470	0,67
GBP	221.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	205.204	0,15	GBP	491.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	558.241	0,41
GBP	400.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	422.245	0,31	USD	118.000	Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	100.373	0,07
EUR	317.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	302.403	0,22	EUR	428.000	Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	434.466	0,32
GBP	429.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.00% 31/01/2029	404.884	0,30	GBP	342.000	International Business Machines Corp. 4.88% 06/02/2038	376.130	0,28
EUR	432.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	395.327	0,29	USD	560.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	428.343	0,31
USD	650.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	585.703	0,43	USD	1.627.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	1.259.305	0,92
GBP	227.000	Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	255.144	0,19	EUR	576.000	Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	568.947	0,42
GBP	752.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	647.485	0,48	GBP	492.000	Morgan Stanley FRN 18/11/2033	571.148	0,42
		Total Royaume-Uni	20.509.948	15,09	GBP	200.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	216.631	0,16

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)					
ÉTATS-UNIS (suite)				CÔTE D'IVOIRE (suite)					
EUR	1.728.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.668.125	1,23	EUR	290.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	238.859	0,18
EUR	2.160.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	2.125.447	1,56	Total Côte d'Ivoire				
EUR	1.212.000	New York Life Global Funding 3.63% 09/01/2030	1.185.038	0,86	444.939 0,33				
EUR	638.000	Northwestern Mutual Global Funding 4.11% 15/03/2030	646.514	0,48	SÉNÉGAL				
USD	220.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	214.005	0,16	EUR	390.000	Senegal (Govt of) 4.75% 13/03/2028	328.643	0,24
USD	265.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	284.007	0,21	Total Sénégal				
EUR	513.000	Olympus Water USA Holding Corp. 3.88% 01/10/2028	418.976	0,31	328.643 0,24				
EUR	280.000	Southern Company FRN 15/09/2081	221.999	0,16	Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				
USD	1.070.000	Stellantis Finance USA Inc. 6.38% 12/09/2032	1.033.720	0,76	4.298.403 3,16				
GBP	350.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	384.569	0,28	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				
USD	1.738.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	1.298.889	0,95	125.607.063 92,33				
Total États-Unis			21.922.488	16,10	Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises				
Total Obligations			121.308.660	89,17	Obligations				
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				PAYS-BAS					
ÉGYPTE				USD 467.000 Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023				426.889	0,31
EUR	450.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	270.450	0,20	Total Pays-Bas				
Total Égypte			270.450	0,20	426.889 0,31				
ALLEMAGNE				ÉTATS-UNIS					
EUR	2.300.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 31/03/2025	2.168.516	1,59	USD	52.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	53.735	0,04
GBP	800.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.13% 04/07/2025	852.983	0,63	Total États-Unis				
Total Allemagne			3.021.499	2,22	53.735 0,04				
HONGRIE				Total Obligations					
EUR	231.000	Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	232.872	0,17	480.624 0,35				
Total Hongrie			232.872	0,17	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises				
CÔTE D'IVOIRE				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire					
EUR	250.000	Ivory Coast (Govt of) 5.25% 22/03/2030	206.080	0,15	Obligations				
PORTUGAL				EUR 100.000 Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**				11.000	0,01
Total Portugal			11.000	0,01	Total Portugal				
					11.000 0,01				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire (suite)			
Obligations (suite)			
ROYAUME-UNI			
EUR	451.000 BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	361.422	0,27
GBP	812.000 Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	867.134	0,64
GBP	375.000 Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	357.457	0,26
	Total Royaume-Uni	1.586.013	1,17
	Total Obligations	1.597.013	1,18
	Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	1.597.013	1,18
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières			
Fonds			
IRLANDE			
	10.150 BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	1.003.346	0,74
	Total Irlande	1.003.346	0,74
	Total Fonds	1.003.346	0,74
	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	1.003.346	0,74
	Valeur totale des investissements	128.688.046	94,60
(Coût total : 144.483.819 EUR)			

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

**Titre à la juste valeur.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations				Obligations (suite)					
Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*			
BERMUDES				COLOMBIE					
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	173.952	0,45	USD	500.000	Ecopetrol SA 4.63% 02/11/2031	389.133	1,01
					USD	500.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	460.957	1,20
		Total Bermudes	173.952	0,45			Total Colombie	850.090	2,21
BRÉSIL				GHANA					
USD	500.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	147.813	0,38	USD	200.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	119.750	0,31
		Total Brésil	147.813	0,38			Total Ghana	119.750	0,31
CANADA				GUATEMALA					
USD	300.000	MEGlobal Canada ULC 5.00% 18/05/2025	298.266	0,77	USD	460.000	CT Trust 5.13% 03/02/2032	384.813	1,00
		Total Canada	298.266	0,77	USD	600.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	553.450	1,43
							Total Guatemala	938.263	2,43
ÎLES CAÏMANS				HONG KONG					
USD	200.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	186.380	0,48	USD	800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	807.390	2,09
USD	200.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	42.769	0,11	USD	214.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	216.863	0,56
USD	200.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	189.145	0,49	USD	330.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	250.763	0,65
USD	440.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	258.299	0,67			Total Hong Kong	1.275.016	3,30
USD	212.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	177.723	0,46	INDE				
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	342.638	0,89	USD	250.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	179.688	0,47
USD	400.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	320.404	0,83	USD	220.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	190.575	0,49
USD	400.000	Melco Resorts Finance Limited 5.75% 21/07/2028	342.500	0,89	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	317.351	0,82
USD	200.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	178.187	0,46	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.20% 04/08/2027	159.023	0,41
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	186.108	0,48	USD	200.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	196.977	0,51
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	186.108	0,48	USD	400.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	351.304	0,91
USD	400.000	Saudi Electricity Global Sukuk Company 5 2.41% 17/09/2030	346.568	0,90	USD	200.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 3.57% 21/01/2032	174.447	0,45
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	172.474	0,45	USD	200.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	197.944	0,52
USD	367.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	336.791	0,87	USD	250.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	235.268	0,61
USD	200.000	Vale Overseas Limited 3.75% 08/07/2030	178.840	0,46			Total Îles Caïmans	3.444.934	8,92

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*			
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)			Obligations (suite)					
INDE (suite)			LUXEMBOURG					
USD 475.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	397.577	1,03	USD 500.000	Altice Financing SA 5.00% 15/01/2028	406.875	1,05	
	Total Inde	2.400.154	6,22	USD 400.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	412.269	1,07	
INDONÉSIE			USD 550.000 Hidrovias International Finance SARL 4.95% 08/02/2031			392.831	1,02	
USD 295.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT 4.75% 13/05/2025	291.739	0,76	USD 250.000	MHP Lux SA 6.95% 03/04/2026	127.883	0,33	
USD 250.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	246.997	0,64	USD 500.000	MHP SE 7.75% 10/05/2024	277.489	0,72	
USD 600.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	22.500	0,06	USD 544.500	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	503.159	1,30	
	Total Indonésie	561.236	1,46	Total Luxembourg			2.120.506	5,49
IRLANDE			ÎLE MAURICE					
USD 400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	253.020	0,66	USD 200.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	192.794	0,50	
USD 200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3.05% 23/01/2025	150.284	0,39	USD 400.000	HTA Group Limited 7.00% 18/12/2025	380.750	0,99	
	Total Irlande	403.304	1,05	USD 300.000	Network I2i Limited Perp FRN	283.986	0,74	
ÎLE DE MAN			Total Île Maurice			857.530	2,23	
USD 200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	175.051	0,45	MEXIQUE				
USD 400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	368.502	0,95	USD 500.000	BBVA Bancomer SA FRN 13/09/2034	436.875	1,13	
	Total Île de Man	543.553	1,40	USD 400.000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/02/2032	302.750	0,78	
JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES			USD 400.000 Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027			413.220	1,07	
USD 200.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	164.822	0,43	USD 200.000	Cemex SAB de CV FRN 14/06/2171	201.443	0,52	
USD 440.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 3.25% 30/09/2040	348.725	0,90	USD 237.000	Gruma SAB de CV 4.88% 01/12/2024	235.815	0,61	
	Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	513.547	1,33	USD 400.000	Petroleos Mexicanos 6.70% 16/02/2032	319.347	0,83	
KAZAKHSTAN			USD 118.000 Petroleos Mexicanos 10.00% 07/02/2033			112.690	0,29	
USD 400.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025	389.906	1,01	USD 400.000	Sitios Latinoamerica SAB de CV 5.38% 04/04/2032	360.467	0,93	
USD 400.000	KazMunayGas National Company JSC 6.38% 24/10/2048	333.750	0,86	Total Mexique			2.382.607	6,16
	Total Kazakhstan	723.656	1,87	MAROC				
			USD 240.000 OCP SA 3.75% 23/06/2031			198.382	0,51	
			USD 557.000 OCP SA 6.88% 25/04/2044			507.572	1,32	
			Total Maroc			705.954	1,83	

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*			
PAYS-BAS				ARABIE SAOUDITE					
USD	330.000	Braskem Netherlands Finance BV 4.50% 31/01/2030	281.418	0,73	USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	338.454	0,88
USD	357.200	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	321.480	0,83	USD	500.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	423.068	1,10
USD	230.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	142.600	0,37	USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	375.204	0,97
USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	428.499	1,11	USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	187.602	0,49
USD	392.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	355.005	0,92			Total Arabie saoudite	1.324.328	3,44
USD	250.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.75% 09/05/2027	234.780	0,61	SINGAPOUR				
USD	200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 7.88% 15/09/2029	209.625	0,54	USD	200.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	171.157	0,44
		Total Pays-Bas	1.973.407	5,11	USD	600.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	596.860	1,55
PÉROU				AFRIQUE DU SUD					
USD	500.000	Auna SAA 6.50% 20/11/2025	378.125	0,98	USD	200.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	198.737	0,51
USD	95.000	Volcan Compania Minera SAA 4.38% 11/02/2026	79.167	0,21	USD	250.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	246.384	0,64
		Total Pérou	457.292	1,19			Total Afrique du Sud	445.121	1,15
PHILIPPINES				THAÏLANDE					
USD	250.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	200.720	0,52	USD	700.000	Bangkok Bank pcl FRN 25/09/2034	596.625	1,55
USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	188.513	0,49	USD	235.000	GC Treasury Center Company Limited 4.30% 18/03/2051	170.595	0,44
USD	357.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	325.537	0,84	USD	200.000	GCTreasury Centre Company 2.98% 18/03/2031	164.568	0,43
USD	200.000	PLDT Inc. 2.50% 23/01/2031	162.060	0,42	USD	200.000	Kasikornbank pcl FRN 02/10/2031	176.378	0,46
USD	230.000	SMC Global Power Holdings Corp. Perp FRN	188.781	0,49			Total Thaïlande	1.108.166	2,88
		Total Philippines	1.065.611	2,76	TURQUIE				
QATAR				TURQUIE					
USD	410.000	QatarEnergy 2.25% 12/07/2031	348.836	0,90	USD	380.000	KOC Holding AS 6.50% 11/03/2025	379.109	0,99
		Total Qatar	348.836	0,90	USD	450.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	433.683	1,13
RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)				Total Turquie					
USD	200.000	Kookmin Bank 4.50% 01/02/2029	190.018	0,49			812.792	2,12	
		Total République de Corée (du Sud)	190.018	0,49					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance					
ÉMIRATS ARABES UNIS				TURQUIE					
USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	782.431	2,03	USD	200.000	Turkey (Govt of) 4.88% 09/10/2026	181.232	0,47
Total Émirats arabes unis			782.431	2,03	USD	310.000	Turkey (Govt of) 9.38% 19/01/2033	317.108	0,82
ROYAUME-UNI				Total Turquie					
USD	300.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	189.375	0,49	Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				
USD	450.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	89.250	0,23	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				
Total Royaume-Uni			278.625	0,72	32.885.899 85,21				
ÎLES VIERGES (BRITANNIQUES)				Organismes de placement collectif en valeurs mobilières					
USD	460.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	427.789	1,11	Fonds				
USD	400.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	339.978	0,88	IRLANDE				
USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	359.519	0,93	2.549.478	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.549.478	6,61	
USD	450.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	419.605	1,09	Total Irlande				
USD	400.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	403.613	1,04	Total Fonds				
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	456.896	1,19	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières				
USD	728.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	655.548	1,70	Valeur totale des investissements				
USD	400.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	308.000	0,80	(Coût total : 41.167.386 USD)				
USD	467.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	423.170	1,10	<i>*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.</i>				
Total Îles Vierges (Britanniques)			3.794.118	9,84					
Total Obligations			32.387.559	83,92					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*				
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)							
Obligations				Obligations (suite)							
AZERBAÏDJAN				INDE (suite)							
USD	200.000	Azerbaijan (Govt of) 3.50% 01/09/2032	170.901	0,56	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	158.675	0,52		
Total Azerbaïdjan		170.901	0,56	Total Inde		302.425	0,99				
BERMUDES				INDONÉSIE							
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	173.952	0,57	USD	450.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	444.594	1,46		
Total Bermudes		173.952	0,57	Total Indonésie		444.594	1,46				
ÎLES CAÏMANS				IRLANDE							
USD	319.000	Gaci First Investment Company 4.88% 14/02/2035	313.786	1,03	USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	126.510	0,42		
USD	343.000	Gaci First Investment Company 5.25% 13/10/2032	356.801	1,18	Total Irlande		126.510	0,42			
Total Îles Caïmans		670.587	2,21	Total Île de Man		175.051	0,58				
COLOMBIE				ÎLE DE MAN							
USD	345.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	318.061	1,05	USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	175.051	0,58		
Total Colombie		318.061	1,05	Total Île de Man		175.051	0,58				
GHANA				JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES							
USD	230.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	137.713	0,45	USD	253.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	208.500	0,69		
Total Ghana		137.713	0,45	USD	263.108	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	214.167	0,70			
GUATEMALA				Total Jersey - Îles Anglo-Normandes							
USD	200.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	184.483	0,61	Total Jersey - Îles Anglo-Normandes		422.667	1,39			
Total Guatemala		184.483	0,61	KAZAKHSTAN							
HONG KONG				USD	200.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 19/04/2027	184.624	0,61			
USD	200.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	201.848	0,66	USD	400.000	KazMunayGas National Company JSC 5.38% 24/04/2030	357.040	1,16		
USD	274.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	277.665	0,92	Total Kazakhstan		541.664	1,77			
USD	210.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	159.577	0,52	LUXEMBOURG						
Total Hong Kong		639.090	2,10	USD	200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	206.135	0,68			
INDE				USD	180.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	166.334	0,55			
USD	200.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	143.750	0,47	Total Luxembourg		372.469	1,23			

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
MALAISIE				ÉMIRATS ARABES UNIS					
USD	200.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	187.133	0,62	USD	200.000	Abu Dhabi Ports Company PJSC 2.50% 06/05/2031	169.500	0,56
Total Malaisie		187.133	0,62	USD	500.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	558.879	1,84	
MEXIQUE				USD	200.000	MDGH GMTN RSC Limited 5.50% 28/04/2033	213.127	0,70	
USD	450.000	Comision Federal de Electricidad 3.88% 26/07/2033	344.796	1,14	Total Émirats arabes unis				
USD	300.000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/01/2031	229.896	0,76	941.506 3,10				
USD	430.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	272.794	0,90	ROYAUME-UNI				
USD	900.000	Petroleos Mexicanos 6.70% 16/02/2032	718.531	2,35	USD	204.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	128.775	0,42
USD	200.000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/2050	141.370	0,47	Total Royaume-Uni				
USD	96.000	Petroleos Mexicanos 10.00% 07/02/2033	91.680	0,30	128.775 0,42				
Total Mexique		1.799.067	5,92	ÉTATS-UNIS					
PAYS-BAS				USD	378.000	Petroleos Mexicanos 6.63% 15/06/2035	276.316	0,91	
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	214.250	0,70	Total États-Unis				
Total Pays-Bas		214.250	0,70	276.316 0,91					
QATAR				ÎLES VIERGES (BRITANNIQUES)					
USD	356.000	QatarEnergy 2.25% 12/07/2031	302.892	1,00	USD	220.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	221.988	0,73
Total Qatar		302.892	1,00	USD	489.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	440.333	1,45	
ARABIE SAOUDITE				USD	200.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.63% 05/08/2030	165.157	0,54	
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	338.454	1,11	USD	265.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	204.050	0,67
Total Arabie saoudite		338.454	1,11	Total Îles Vierges (Britanniques)					
AFRIQUE DU SUD				1.031.528 3,39					
USD	200.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	197.107	0,65	Total Obligations				
Total Afrique du Sud		197.107	0,65	10.289.942 33,85					
TURQUIE				Titres adossés à des actifs et à des créances hypothécaires					
USD	200.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	192.747	0,64	LUXEMBOURG				
Total Turquie		192.747	0,64	USD	180.000	Millicom International Cellular SA 5.13% 15/01/2028	160.763	0,53	
				Total Luxembourg					
				160.763 0,53					
				Total Titres adossés à des actifs et à des créances hypothécaires					
				160.763 0,53					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)			
ANGOLA				COLOMBIE (suite)			
USD	200.000 Angola (Govt of) 8.00% 26/11/2029	171.697	0,56	USD	223.000 Colombia (Govt of) 3.25% 22/04/2032	167.005	0,55
USD	200.000 Angola (Govt of) 9.38% 08/05/2048	157.896	0,52	Total Colombie			1.065.066
Total Angola			1,08				
ARGENTINE				CROATIE			
USD	1.850.000 Argentina (Govt of) FRN 09/07/2035	485.311	1,60	USD	200.000 Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	201.577	0,66
USD	90.000 Argentina (Govt of) 1.50% 09/07/2046	24.297	0,08	Total Croatie			201.577
Total Argentine			1,68				
BAHREÏN				RÉPUBLIQUE DOMINICAINE			
USD	300.000 Bahrain (Govt of) 5.63% 18/05/2034	263.661	0,87	USD	200.000 Dominican Republic (Govt of) 4.88% 23/09/2032	170.820	0,56
USD	333.000 CBB International Sukuk Programme Company WLL 3.88% 18/05/2029	301.968	0,99	USD	222.000 Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	170.558	0,56
Total Bahreïn			1,86	USD	151.000 Dominican Republic (Govt of) 6.40% 05/06/2049	126.878	0,42
				USD	106.000 Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	102.452	0,34
Total République dominicaine			1,88				
BRÉSIL				ÉQUATEUR			
USD	433.000 Brazil (Govt of) 3.88% 12/06/2030	388.621	1,28	USD	192.950 Ecuador (Govt of) 1.50% 31/07/2040	58.781	0,19
USD	200.000 Brazil (Govt of) 5.00% 27/01/2045	158.261	0,52	USD	344.160 Ecuador (Govt of) 2.50% 31/07/2035	114.868	0,38
Total Brésil			1,80	Total Équateur			173.649
				0,57			
CHILI				ÉGYPTE			
USD	200.000 Chile (Govt of) 3.50% 25/01/2050	150.766	0,50	EUR	200.000 Egypt (Govt of) 6.38% 11/04/2031	130.317	0,43
Total Chili			0,50	USD	250.000 Egypt (Govt of) 7.30% 30/09/2033	154.412	0,51
				USD	250.000 Egypt (Govt of) 7.63% 29/05/2032	159.666	0,53
CHINE				USD	300.000 Egypt (Govt of) 7.90% 21/02/2048	167.563	0,55
USD	200.000 China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	192.568	0,63	Total Égypte			611.958
Total Chine			0,63				
COLOMBIE				GHANA			
USD	800.000 Colombia (Govt of) 3.00% 30/01/2030	629.543	2,06	USD	364.000 Ghana (Govt of) 0.00% 07/05/2042	124.215	0,41
USD	350.000 Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	268.518	0,88	Total Ghana			124.215
Total Colombie			2,94				
GUATEMALA							
USD	250.000 Guatemala (Govt of) 6.13% 01/06/2050	238.571	0,78	Total Guatemala			238.571
Total Guatemala			0,78				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)				Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)			
Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
HONGRIE				MONGOLIE			
USD	200.000 Hungary (Govt of) 2.13% 22/09/2031	154.624	0,51	USD	200.000 Mongolia (Govt of) 8.65% 19/01/2028	197.219	0,65
USD	200.000 Hungary (Govt of) 3.13% 21/09/2051	123.910	0,41	Total Mongolie			
EUR	58.000 Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	63.525	0,21	197.219 0,65			
USD	200.000 Hungary (Govt of) 6.75% 25/09/2052	208.090	0,68	NIGERIA			
Total Hongrie				USD	250.000 Nigeria (Govt of) 7.38% 28/09/2033	178.123	0,59
550.149 1,81				USD	200.000 Nigeria (Govt of) 7.63% 28/11/2047	128.542	0,42
INDE				Total Nigeria			
USD	400.000 Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	353.054	1,16	306.665 1,01			
Total Inde				OMAN			
353.054 1,16				USD	200.000 Oman (Govt of) 6.25% 25/01/2031	204.420	0,67
INDONÉSIE				USD	220.000 Oman (Govt of) 6.75% 17/01/2048	209.178	0,69
USD	200.000 Indonesia (Govt of) 3.70% 30/10/2049	159.593	0,53	Total Oman			
USD	200.000 Indonesia (Govt of) 4.30% 31/03/2052	174.410	0,57	413.598 1,36			
USD	350.000 Indonesia (Govt of) 4.75% 18/07/2047	329.285	1,08	PAKISTAN			
IDR	5.360.000.000 Indonesia (Govt of) 6.38% 15/04/2032	349.885	1,15	USD	200.000 Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	72.970	0,24
USD	200.000 Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	190.963	0,63	Total Pakistan			
Total Indonésie				72.970 0,24			
1.204.136 3,96				PANAMA			
CÔTE D'IVOIRE				USD	200.000 Panama (Govt of) 2.25% 29/09/2032	153.842	0,51
EUR	477.000 Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	426.846	1,40	USD	302.000 Panama (Govt of) 3.30% 19/01/2033	253.438	0,83
Total Côte d'Ivoire				USD	200.000 Panama (Govt of) 4.50% 19/01/2063	144.971	0,48
426.846 1,40				USD	200.000 Panama (Govt of) 6.40% 14/02/2035	209.273	0,69
MEXIQUE				Total Panama			
USD	650.000 Mexico (Govt of) 3.25% 16/04/2030	584.361	1,92	761.524 2,51			
USD	300.000 Mexico (Govt of) 4.60% 10/02/2048	245.944	0,81	PARAGUAY			
MXN	85.000 Mexico (Govt of) 8.50% 31/05/2029	463.752	1,53	USD	340.000 Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	303.297	1,00
Total Mexique				USD	200.000 Paraguay (Govt of) 6.10% 11/08/2044	194.031	0,64
1.294.057 4,26				Total Paraguay			
				497.328 1,64			

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)												
Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*								
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)				Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)											
PÉROU				TURQUIE (suite)											
USD	132.000 Peru (Govt of)	3.00%	15/01/2034	108.211	0,36	USD	425.000 Turkey (Govt of)	6.00%	25/03/2027	394.366	1,30				
Total Pérou				108.211	0,36	USD	250.000 Turkey (Govt of)	6.88%	17/03/2036	215.401	0,71				
PHILIPPINES				USD	315.000 Turkey (Govt of)	9.38%	14/03/2029	321.885	1,06	USD	375.000 Turkey (Govt of)	9.38%	19/01/2033	383.599	1,26
USD	539.000 Philippine (Govt of)	3.20%	06/07/2046	402.120	1,32	Total Turquie				1.693.541	5,57				
Total Philippines				402.120	1,32	UKRAINE				USD	518.000 Ukraine (Govt of)	0.00%	21/05/2031	92.123	0,30
QATAR				USD	200.000 Qatar (Govt of)	4.82%	14/03/2049	197.907	0,65	USD	560.000 Ukraine (Govt of)	7.75%	01/09/2026	107.100	0,35
USD	450.000 Qatar (Govt of)	3.75%	16/04/2030	441.067	1,45	Total Ukraine				199.223	0,65				
USD	200.000 Qatar (Govt of)	5.10%	23/04/2048	204.318	0,67	Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				16.753.854	55,11				
Total Qatar				843.292	2,77	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				27.204.559	89,49				
ROUMANIE				USD	252.000 Romania (Govt of)	3.00%	27/02/2027	230.088	0,76	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire					
USD	300.000 Romania (Govt of)	4.00%	14/02/2051	211.265	0,69	Obligations									
USD	246.000 Romania (Govt of)	5.25%	25/11/2027	242.997	0,80	LUXEMBOURG			USD	210.000 Hidrovias International Finance SARL	4.95%	08/02/2031	149.990	0,49	
Total Roumanie				684.350	2,25	Total Luxembourg				149.990	0,49				
ARABIE SAOUDITE				USD	300.000 Saudi (Govt of)	3.45%	02/02/2061	213.411	0,70	VENEZUELA					
USD	500.000 Saudi (Govt of)	3.75%	21/01/2055	387.805	1,28	Total Venezuela			USD	1.999.683 Petroleos de Venezuela SA	6.00%	15/11/2026	99.584	0,33	
USD	285.000 Saudi (Govt of)	4.50%	26/10/2046	251.115	0,83	Total Obligations				249.574	0,82				
USD	239.000 Saudi (Govt of)	4.88%	18/07/2033	243.062	0,80	AFRIQUE DU SUD									
Total Arabie saoudite				1.095.393	3,61	USD	500.000 South Africa (Govt of)	5.75%	30/09/2049	369.388	1,22				
TURQUIE				USD	430.000 Turkey (Govt of)	5.13%	17/02/2028	378.290	1,24						

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire (suite)		
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance		
VENEZUELA		
USD 2.004.400 Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	220.484	0,73
Total Venezuela	220.484	0,73
Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance	220.484	0,73
Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	470.058	1,55
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Fonds		
IRLANDE		
1.596.398 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.596.398	5,25
Total Irlande	1.596.398	5,25
Total Fonds	1.596.398	5,25
Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	1.596.398	5,25
Valeur totale des investissements	29.271.015	96,29

(Coût total : 36.073.701 USD)

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations				Obligations (suite)					
BRÉSIL				INDE (suite)					
USD	600.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	177.375	0,30	USD	600.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	593.831	0,99
Total Brésil			177.375	0,30	USD	700.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	585.905	0,98
CANADA				Total Inde					
USD	400.000	MEGlobal Canada ULC 5.00% 18/05/2025	397.688	0,66	1.786.111 2,98				
Total Canada			397.688	0,66	INDONÉSIE				
ÎLES CAÏMANS				USD 1.200.000 Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.75% 15/05/2025				1.186.658	1,98
USD	600.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	128.306	0,21	USD	700.000	Pertamina Persero PT 1.40% 09/02/2026	636.556	1,06
USD	700.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	410.931	0,69	USD	1.200.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	45.000	0,08
USD	975.000	Gaci First Investment Company 5.00% 13/10/2027	990.847	1,65	Total Indonésie				
USD	650.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	520.657	0,87	1.868.214 3,12				
USD	500.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	445.466	0,74	IRLANDE				
USD	1.300.000	SA Global Sukuk Limited 1.60% 17/06/2026	1.192.945	1,99	USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	253.020	0,42
Total Îles Caïmans			3.689.152	6,15	USD	300.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3.05% 23/01/2025	225.427	0,38
GHANA				Total Irlande					
USD	600.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	359.250	0,60	478.447 0,80				
Total Ghana			359.250	0,60	JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES				
GUATEMALA				USD 1.021.118 Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 1.75% 30/09/2027				953.829	1,59
USD	820.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	756.382	1,26	Total Jersey - Îles Anglo-Normandes				
Total Guatemala			756.382	1,26	953.829 1,59				
HONG KONG				KAZAKHSTAN					
USD	380.000	Lenovo Group Limited 5.83% 27/01/2028	383.706	0,64	USD	1.500.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025	1.462.147	2,44
USD	500.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	504.619	0,84	Total Kazakhstan				
Total Hong Kong			888.325	1,48	1.462.147 2,44				
INDE				LUXEMBOURG					
USD	700.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	606.375	1,01	USD	500.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 5.15% 11/02/2026	382.500	0,64
					USD	750.000	Millicom International Cellular SA 4.50% 27/04/2031	601.875	1,01
					USD	200.000	TMS Issuer Sarl 5.78% 23/08/2032	208.648	0,35
					Total Luxembourg				
					1.193.023 2,00				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ÎLE MAURICE				ARABIE SAOUDITE (suite)					
USD	1.000.000	HTA Group Limited 7.00% 18/10/2025	951.875	1,59	USD	450.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	440.442	0,73
Total Île Maurice			951.875	1,59	Total Arabie saoudite			783.008	1,30
MEXIQUE				AFRIQUE DU SUD					
USD	650.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	671.483	1,12	USD	1.000.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	993.685	1,65
USD	1.200.000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025	1.146.217	1,91	USD	300.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	295.660	0,49
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	727.381	1,21	Total Afrique du Sud			1.289.345	2,14
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 16/10/2025	794.499	1,33	TURQUIE				
USD	2.600.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	2.471.366	4,12	USD	600.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	578.244	0,96
Total Mexique			5.810.946	9,69	Total Turquie			578.244	0,96
PAYS-BAS				ROYAUME-UNI					
USD	421.000	Braskem Netherlands Finance BV 7.25% 13/02/2033	406.772	0,68	USD	200.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	39.667	0,07
USD	883.600	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	795.240	1,33	Total Royaume-Uni			39.667	0,07
USD	500.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	310.000	0,52	ÎLES VIERGES (BRITANNIQUES)				
USD	1.000.000	Syngenta Finance NV 4.44% 24/04/2023	999.341	1,67	USD	800.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	743.980	1,24
Total Pays-Bas			2.511.353	4,20	USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	359.519	0,60
PÉROU				ROYAUME-UNI					
USD	800.000	Auna SAA 6.50% 20/11/2025	605.000	1,01	USD	1.000.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	998.548	1,67
Total Pérou			605.000	1,01	USD	700.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	651.463	1,09
PHILIPPINES				ROYAUME-UNI					
USD	693.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	631.925	1,05	USD	700.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	634.302	1,06
Total Philippines			631.925	1,05	Total Îles Vierges (Britanniques)			3.387.812	5,66
QATAR				ROYAUME-UNI					
USD	700.000	QatarEnergy 1.38% 12/09/2026	635.858	1,06	Total Obligations			31.234.976	52,11
Total Qatar			635.858	1,06	Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				
ARABIE SAOUDITE				ANGOLA					
USD	350.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	342.566	0,57	USD	800.000	Angola (Govt of) 9.50% 12/11/2025	799.420	1,33
Total Arabie saoudite			342.566	0,57	Total Angola			799.420	1,33

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)						
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)				Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)						
Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*			
BRÉSIL				INDONÉSIE						
USD	1.500.000	Brazil (Govt of) 2.88% 06/06/2025	1.439.240	2,40	USD	640.000	Indonesia (Govt of) 4.55% 11/01/2028	641.636	1,07	
USD	400.000	Brazil (Govt of) 4.25% 07/01/2025	396.816	0,66	Total Indonésie			641.636	1,07	
Total Brésil				1.836.056	3,06	MONGOLIE				
COLOMBIE				MAROC						
USD	500.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	383.596	0,64	USD	320.000	Morocco (Govt of) 5.95% 08/03/2028	327.408	0,55	
Total Colombie				383.596	0,64	Total Maroc			327.408	0,55
COSTA RICA				NIGERIA						
USD	300.000	Costa Rica (Govt of) 4.38% 30/04/2025	294.572	0,49	USD	900.000	Nigeria (Govt of) 6.50% 28/11/2027	736.478	1,23	
Total Costa Rica				294.572	0,49	Total Nigeria			736.478	1,23
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				OMAN						
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 5.50% 27/01/2025	991.605	1,65	USD	1.000.000	Oman (Govt of) 4.40% 01/06/2024	988.426	1,65	
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 29/01/2026	1.018.007	1,70	USD	1.700.000	Oman (Govt of) 4.75% 15/06/2026	1.666.510	2,78	
Total République dominicaine				2.009.612	3,35	Total Oman			2.654.936	4,43
ÉGYPTE				PAKISTAN						
USD	700.000	Egypt (Govt of) 3.88% 16/02/2026	519.808	0,87	USD	500.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	186.253	0,31	
USD	400.000	Egypt (Govt of) 5.25% 06/10/2025	318.359	0,53	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	78.750	0,13	
USD	400.000	Egypt (Govt of) 5.80% 30/09/2027	282.259	0,47	Total Pakistan			265.003	0,44	
USD	1.300.000	Egypt (Govt of) 5.88% 11/06/2025	1.067.159	1,78	PANAMA					
Total Égypte				2.187.585	3,65	USD	1.350.000	Panama (Govt of) 3.75% 16/03/2025	1.321.121	2,20
GHANA				QATAR						
USD	700.000	Ghana (Govt of) 0.00% 11/02/2027	256.060	0,43	USD	1.500.000	Qatar (Govt of) 3.25% 02/06/2026	1.465.470	2,45	
Total Ghana				256.060	0,43	Total Qatar			1.465.470	2,45
HONGRIE										
EUR	174.000	Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	190.574	0,32						
USD	307.000	Hungary (Govt of) 6.13% 22/05/2028	315.671	0,53						
Total Hongrie				506.245	0,85					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire					
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)				Obligations					
Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
ROUMANIE				VENEZUELA					
USD	646.000	Romania (Govt of) 3.00% 27/02/2027	589.829	0,98	USD	3.288.783	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	153.619	0,26
					USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	24.489	0,04
		Total Roumanie	589.829	0,98		Total Venezuela	178.108	0,30	
AFRIQUE DU SUD				Total Obligations					
USD	600.000	South Africa (Govt of) 4.30% 12/10/2028	540.765	0,90					
USD	350.000	South Africa (Govt of) 4.85% 30/09/2029	315.428	0,53	Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				
		Total Afrique du Sud	856.193	1,43	VENEZUELA				
SRI LANKA				USD 1.245.400 Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024				136.994	0,23
USD	860.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023	311.807	0,52	Total Venezuela				
		Total Sri Lanka	311.807	0,52	Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				
TURQUIE				Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire					
USD	1.200.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 7.25% 24/02/2027	1.161.211	1,94	Organismes de placement collectif en valeurs mobilières				
USD	1.100.000	Turkey (Govt of) 4.88% 09/10/2026	996.776	1,66	Fonds				
USD	2.000.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	1.855.841	3,11	IRLANDE				
USD	935.000	Turkey (Govt of) 9.38% 14/03/2029	955.438	1,59	2.809.014 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund				
		Total Turquie	4.969.266	8,30	Total Irlande				
UKRAINE				Total Fonds					
USD	2.534.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	484.628	0,81	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières				
		Total Ukraine	484.628	0,81	Valeur totale des investissements				
Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				57.453.232					
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				95,87					
				(Coût total : 67.085.417 USD)					

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*			
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)						
Obligations				Obligations (suite)						
BERMUDES				ÎLES CAÏMANS (suite)						
USD	282.000	Nabors Industries Limited 7.25% 15/01/2026	269.310	0,23	USD	282.000	Transocean Titan Financing Limited 8.38% 01/02/2028	290.331	0,24	
USD	55.000	Nabors Industries Limited 7.50% 15/01/2028	51.123	0,04	Total Îles Caïmans			860.654	0,72	
USD	246.000	NCL Corp. Limited 5.88% 15/03/2026	209.241	0,17	FRANCE					
Total Bermudes				529.674	0,44	USD	411.000	Altice France SA 5.13% 15/07/2029	310.305	0,26
CANADA						USD	311.000	Altice France SA 5.50% 15/01/2028	255.393	0,21
USD	570.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 3.88% 15/01/2028	530.456	0,44	USD	304.000	Altice France SA 5.50% 15/10/2029	231.800	0,19	
USD	164.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 4.38% 15/01/2028	151.368	0,13	USD	160.000	Altice France SA 8.13% 01/02/2027	147.600	0,12	
USD	55.000	1375209 BC Limited 9.00% 30/01/2028	54.725	0,05	USD	617.000	Constellium SE 3.75% 15/04/2029	535.248	0,45	
USD	276.000	Air Canada 3.88% 15/08/2026	250.942	0,21	USD	346.000	Constellium SE 5.63% 15/06/2028	330.444	0,28	
USD	164.000	Bausch Health Companys Inc. 6.13% 01/02/2027	106.551	0,09	USD	325.000	Iliad Holding SASU 6.50% 15/10/2026	312.078	0,26	
USD	161.000	Bausch Health Cos Inc. 4.88% 01/06/2028	96.040	0,08	USD	679.000	Iliad Holding SASU 7.00% 15/10/2028	646.111	0,55	
USD	167.000	Bausch Health Cos Inc. 5.50% 01/11/2025	139.504	0,12	Total France			2.768.979	2,32	
USD	98.000	Bausch Health Cos Inc. 11.00% 30/09/2028	72.357	0,06	ALLEMAGNE					
USD	19.000	Bausch Health Cos Inc. 14.00% 15/10/2030	10.878	0,01	USD	261.000	IHO Verwaltungs GmbH 4.75% 15/09/2026	234.732	0,20	
USD	349.000	Bombardier Inc. 7.88% 15/04/2027	353.714	0,30	USD	384.000	IHO Verwaltungs GmbH 6.38% 15/05/2029	341.596	0,29	
USD	166.000	Clarios Global LP 6.75% 15/05/2025	168.079	0,14	USD	261.000	TK Elevator Holdco GmbH 7.63% 15/07/2028	229.632	0,19	
USD	843.000	Hudbay Minerals Inc. 4.50% 01/04/2026	785.538	0,65	Total Allemagne			805.960	0,68	
USD	178.000	Hudbay Minerals Inc. 6.13% 01/04/2029	168.433	0,14	AGENCES INTERNATIONALES					
USD	316.000	Nova Chemicals Corp. 4.25% 15/05/2029	259.910	0,22	USD	207.000	Clarios Global LP 6.25% 15/05/2026	207.277	0,17	
USD	268.000	Nova Chemicals Corp. 5.25% 01/06/2027	244.681	0,20	Total Agences internationales			207.277	0,17	
USD	63.000	Ritchie Bros Holdings Inc. 6.75% 15/03/2028	64.919	0,05	IRLANDE					
USD	142.000	Ritchie Bros Holdings Inc. 7.75% 15/03/2031	148.996	0,13	USD	313.000	James Hardie International Finance Dac 5.00% 15/01/2028	295.150	0,25	
Total Canada				3.607.091	3,02	Total Irlande			295.150	0,25
ÎLES CAÏMANS						LIBÉRIA				
USD	601.627	Hawaiian Brand Intellectual Property Limited 5.75% 20/01/2026	570.323	0,48	USD	420.000	Royal Caribbean Cruises Limited 3.70% 15/03/2028	344.873	0,29	

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
LIBÉRIA (suite)				PANAMA (suite)					
USD	306.000	Royal Caribbean Cruises Limited 4.25% 01/07/2026	274.826	0,23	USD	660.000	Carnival Corp. 6.00% 01/05/2029	525.525	0,45
USD	179.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.38% 15/07/2027	159.869	0,13	Total Panama				
USD	223.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 31/08/2026	207.390	0,17	1.183.706 1,00				
USD	42.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 01/04/2028	37.154	0,03	POLOGNE				
USD	345.000	Royal Caribbean Cruises Limited 7.25% 15/01/2030	347.372	0,29	USD	350.000	Canpack SA 3.88% 15/11/2029	288.400	0,24
Total Libéria			1.371.484	1,14	Total Pologne				
					288.400 0,24				
LUXEMBOURG				ESPAGNE					
USD	284.000	Altice France Holding SA 6.00% 15/02/2028	181.429	0,15	USD	221.000	Grifols Escrow Issuer SA 4.75% 15/10/2028	181.773	0,15
USD	280.000	Axalta Coating Systems LLC 4.75% 15/06/2027	266.756	0,22	Total Espagne				
USD	319.000	Camelot Finance SA 4.50% 01/11/2026	301.854	0,25	181.773 0,15				
USD	331.000	Fage International SA 5.63% 15/08/2026	310.844	0,26	SUPRANATIONALES				
USD	422.000	Herens Holdco Sarl 4.75% 15/05/2028	337.864	0,28	USD	319.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 6.00% 15/06/2027	315.682	0,26
USD	440.000	Ion Trading Technologies Sarl 5.75% 15/05/2028	353.100	0,30	USD	350.000	Clarios Global LP 8.50% 15/05/2027	351.969	0,29
Total Luxembourg			1.751.847	1,46	Total Supranationales				
					667.651 0,55				
PAYS-BAS				ROYAUME-UNI					
USD	187.000	Clear Channel International BV 6.63% 01/08/2025	183.026	0,15	USD	308.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 3.38% 15/01/2026	283.125	0,24
USD	193.000	Constellium SE 5.88% 15/02/2026	193.333	0,16	USD	215.000	International Game Technology plc 4.13% 15/04/2026	207.948	0,17
USD	427.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	409.500	0,34	USD	140.000	International Game Technology plc P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	141.575	0,12
USD	300.000	VZ Secured Financing BV 5.00% 15/01/2032	244.688	0,20	USD	293.000	Virgin Media Finance plc 5.00% 15/07/2030	242.142	0,20
USD	178.000	Ziggo Bond Company BV 5.13% 28/02/2030	143.913	0,12	USD	282.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.50% 15/08/2030	243.131	0,20
USD	171.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	158.068	0,13	USD	237.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.50% 15/05/2029	220.825	0,18
USD	738.000	Ziggo BV 4.88% 15/01/2030	634.434	0,53	USD	631.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.25% 31/01/2031	535.062	0,45
Total Pays-Bas			1.966.962	1,63	Total Royaume-Uni				
					1.873.808 1,56				
PANAMA				ÉTATS-UNIS					
USD	411.000	Carnival Corp. 4.00% 01/08/2028	354.488	0,30	USD	354.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.00% 15/04/2029	333.203	0,28
USD	367.000	Carnival Corp. 5.75% 01/03/2027	303.693	0,25	USD	76.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.50% 01/07/2028	73.673	0,06
				USD 534.000 AdaptHealth LLC 5.13% 01/03/2030 454.809 0,37					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ÉTATS-UNIS (suite)				ÉTATS-UNIS (suite)					
USD	390.000	AG TTMT Escrow Issuer LLC 8.63% 30/09/2027	393.811	0,33	USD	279.000	Avient Corp. 7.13% 01/08/2030	288.242	0,24
USD	353.000	Albertsons Companies Inc. 3.25% 15/03/2026	332.243	0,28	USD	180.000	Axalta Coating Systems LLC 3.38% 15/02/2029	156.600	0,13
USD	317.000	Albertsons Companies Inc. 5.88% 15/02/2028	315.371	0,26	USD	457.000	Bath & Body Works Inc. 6.63% 01/10/2030	446.091	0,37
USD	235.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 4.25% 15/10/2027	210.452	0,18	USD	67.000	Bath & Body Works Inc. 6.88% 01/11/2035	60.875	0,05
USD	268.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 5.88% 01/11/2029	227.381	0,19	USD	221.000	Bath & Body Works Inc. 7.50% 15/06/2029	226.025	0,19
USD	489.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/10/2027	455.063	0,38	USD	210.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.13% 15/05/2029	185.543	0,16
USD	604.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/04/2028	604.256	0,50	USD	196.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.50% 15/11/2026	185.955	0,16
USD	961.121	American Airlines Inc. 5.50% 20/04/2026	948.515	0,80	USD	334.000	Black Knight Infoserv LLC 3.63% 01/09/2028	303.312	0,25
USD	391.110	American Airlines Inc. 5.75% 20/04/2029	375.221	0,31	USD	346.000	Blackstone Mortgage Trust Inc. 3.75% 15/01/2027	274.922	0,23
USD	202.000	American Airlines Inc. 11.75% 15/07/2025	221.156	0,18	USD	275.000	Boyd Gaming Corp. 4.75% 15/06/2031	250.078	0,21
USD	316.000	American Builders & Contractors Supply Company Inc. 4.00% 15/01/2028	288.577	0,24	USD	350.000	BroadStreet Partners Inc. 5.88% 15/04/2029	299.548	0,25
USD	142.000	Apache Corp. 5.25% 01/02/2042	119.981	0,10	USD	291.000	BVX Technologies Inc. 4.13% 30/06/2028	264.901	0,22
USD	386.000	Arches Buyer Inc. 4.25% 01/06/2028	322.841	0,27	USD	663.000	Caesars Entertainment Inc. 4.63% 15/10/2029	582.263	0,49
USD	559.000	Arches Buyer Inc. 6.13% 01/12/2028	463.970	0,39	USD	529.000	Caesars Entertainment Inc. 6.25% 01/07/2025	529.529	0,45
USD	257.000	Archrock Partners LP Archrock Partners Finance Corp. 6.25% 01/04/2028	246.881	0,21	USD	531.000	Caesars Entertainment Inc. 7.00% 15/02/2030	541.288	0,45
USD	807.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 4.00% 01/09/2029	633.060	0,54	USD	453.000	Caesars Entertainment Inc. 8.13% 01/07/2027	462.626	0,39
USD	165.000	Asbury Automotive Group Inc. 4.63% 15/11/2029	147.778	0,12	USD	354.000	Caesars Resort Collection LLC 5.75% 01/07/2025	355.632	0,30
USD	262.000	Asbury Automotive Group Inc. 5.00% 15/02/2032	230.382	0,19	USD	280.000	Carnival Holdings Bermuda Limited 10.38% 01/05/2028	301.115	0,25
USD	405.000	Assuredpartners Inc. 5.63% 15/01/2029	349.414	0,29	USD	204.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 3.13% 15/02/2029	180.158	0,15
USD	200.000	AssuredPartners Inc. 7.00% 15/08/2025	195.780	0,16	USD	343.000	CCO Holdings LLC 5.13% 01/05/2027	324.349	0,27
USD	557.000	AthenaHealth Group Inc. 6.50% 15/02/2030	453.097	0,38	USD	438.000	CCO Holdings LLC 4.25% 01/02/2031	361.624	0,30
USD	122.000	ATI Inc. 4.88% 01/10/2029	112.016	0,09	USD	755.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/03/2030	657.321	0,55
USD	506.000	ATI Inc. 5.13% 01/10/2031	461.093	0,39	USD	428.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/02/2032	360.055	0,30
USD	539.000	Avantor Funding Inc. 3.88% 01/11/2029	483.753	0,40	USD	479.000	CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	444.512	0,37
USD	162.000	Avantor Funding Inc. 4.63% 15/07/2028	154.001	0,13	USD	678.000	CD&R Smokey Buyer Inc. 6.75% 15/07/2025	584.351	0,49

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ÉTATS-UNIS (suite)					ÉTATS-UNIS (suite)				
USD	244.000	Cedar Fair LP/ Canada's Wonderland Company 5.50% 01/05/2025	243.948	0,20	USD	763.000	CrownRock LP 5.63% 15/10/2025	752.115	0,63
USD	313.000	Cengage Learning Inc. 9.50% 15/06/2024	302.734	0,25	USD	304.000	CSC Holdings LLC 3.38% 15/02/2031	211.280	0,18
USD	159.000	Charles River Laboratories International Inc. 3.75% 15/03/2029	142.705	0,12	USD	420.000	CSC Holdings LLC 4.13% 01/12/2030	304.500	0,25
USD	161.000	Charles River Laboratories International Inc. 4.25% 01/05/2028	150.650	0,13	USD	319.000	CSC Holdings LLC 4.63% 01/12/2030	157.108	0,13
USD	197.000	Chart Industries Inc. 7.50% 01/01/2030	203.425	0,17	USD	218.000	CSC Holdings LLC 5.00% 15/11/2031	109.436	0,09
USD	67.000	Chart Industries Inc. 9.50% 01/01/2031	70.834	0,06	USD	131.000	CSC Holdings LLC 5.38% 01/02/2028	108.299	0,09
USD	896.000	CHS/ Community Health Systems Inc. 5.25% 15/05/2030	687.679	0,57	USD	403.000	CSC Holdings LLC 6.50% 01/02/2029	334.490	0,28
USD	200.000	CHS/ Community Health Systems Inc. 6.88% 15/04/2029	123.730	0,10	USD	524.000	DISH DBS Corp. 5.75% 01/12/2028	391.577	0,33
USD	101.000	Cinemark USA Inc. 5.25% 15/07/2028	87.643	0,07	USD	741.000	DISH Network Corp. 11.75% 15/11/2027	713.675	0,61
USD	537.000	Cinemark USA Inc. 5.88% 15/03/2026	508.260	0,42	USD	535.000	DT Midstream Inc. 4.13% 15/06/2029	473.141	0,40
USD	314.000	Cinemark USA Inc. 8.75% 01/05/2025	322.243	0,27	USD	207.000	DT Midstream Inc. 4.38% 15/06/2031	180.782	0,15
USD	372.000	Clarivate Science Holdings Corp. 3.88% 01/07/2028	332.987	0,28	USD	354.000	Element Solutions Inc. 3.88% 01/09/2028	310.414	0,26
USD	528.000	Clarivate Science Holdings Corp. 4.88% 01/07/2029	477.837	0,40	USD	142.000	Encompass Health Corp. 4.50% 01/02/2028	132.505	0,11
USD	561.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 5.13% 15/08/2027	504.198	0,42	USD	330.000	Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	327.938	0,27
USD	177.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 7.50% 01/06/2029	125.670	0,10	USD	623.000	Entegris Escrow Corp. 5.95% 15/06/2030	603.485	0,50
USD	521.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 7.75% 15/04/2028	391.076	0,33	USD	227.000	EQM Midstream Partner LP 4.50% 15/01/2029	193.234	0,16
USD	587.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/02/2031	506.654	0,43	USD	799.000	EQM Midstream Partner LP 4.75% 15/01/2031	668.204	0,56
USD	173.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/01/2032	145.184	0,12	USD	275.000	EQM Midstream Partner LP 5.50% 15/07/2028	251.218	0,21
USD	290.000	Clearway Energy Operating LLC 4.75% 15/03/2028	277.131	0,23	USD	369.000	EQM Midstream Partner LP 6.00% 01/07/2025	364.487	0,30
USD	677.000	Cloud Software Group Holdings Inc. 6.50% 31/03/2029	590.259	0,49	USD	118.000	EQM Midstream Partner LP 7.50% 01/06/2027	117.464	0,10
USD	317.000	CNX Midstream Partners LP 4.75% 15/04/2030	271.926	0,23	USD	281.000	Fertitta Entertainment LLC 6.75% 15/01/2030	231.363	0,19
USD	317.000	Cnx Resources Corp. 6.00% 15/01/2029	297.879	0,25	USD	328.000	Ford Motor Company 3.25% 12/02/2032	259.074	0,22
USD	138.000	CommScope Technologies LLC P.P. 144A 6.00% 15/06/2025	131.470	0,11	USD	385.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.70% 10/08/2026	343.252	0,29
USD	274.000	CrownRock LP 5.00% 01/05/2029	254.902	0,21	USD	257.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.90% 16/02/2028	221.097	0,18
					USD	402.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.38% 13/11/2025	377.353	0,32

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ÉTATS-UNIS (suite)					ÉTATS-UNIS (suite)				
USD	414.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.66% 08/09/2024	400.382	0,33	USD	188.000	Holly Energy Partners Corp. 6.38% 15/04/2027	187.754	0,16
USD	378.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.00% 13/11/2030	322.036	0,27	USD	343.000	HUB International Limited 5.63% 01/12/2029	299.268	0,25
USD	299.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.39% 08/01/2026	284.050	0,24	USD	494.000	HUB International Limited 7.00% 01/05/2026	488.896	0,41
USD	244.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.95% 28/05/2027	231.119	0,19	USD	391.000	iHeartCommunications Inc. 4.75% 15/01/2028	312.800	0,26
USD	486.000	Ford Motor Credit Company LLC 5.13% 16/06/2025	477.238	0,39	USD	282.000	iHeartCommunications Inc. 5.25% 15/08/2027	232.074	0,19
USD	279.000	Ford Motor Credit Company LLC 7.35% 04/11/2027	288.681	0,24	USD	249.000	Ingevity Corp. 3.88% 01/11/2028	215.976	0,18
USD	270.000	Frontier Communications Holdings LLC 8.63% 15/03/2031	265.059	0,22	USD	171.000	Interface Inc. 5.50% 01/12/2028	140.889	0,12
USD	214.000	Frontier Communications Holdings LLC 8.75% 15/05/2030	213.547	0,18	USD	344.000	IRB Holding Corp. 7.00% 15/06/2025	346.173	0,29
USD	735.000	Gates Global LLC 6.25% 15/01/2026	729.399	0,61	USD	237.000	Iron Mountain Inc. 5.00% 15/07/2028	220.677	0,18
USD	160.000	Goodyear Tire & Rubber Company 5.00% 15/07/2029	142.844	0,12	USD	299.000	Iron Mountain Inc. 5.25% 15/03/2028	284.137	0,24
USD	628.000	GoTo Group Inc 5.50% 01/09/2027	324.205	0,27	USD	145.000	ITT Holdings LLC 6.50% 01/08/2029	122.426	0,10
USD	275.000	Group 1 Automotive Inc. 4.00% 15/08/2028	242.254	0,20	USD	184.000	Kaiser Aluminum Corp. 4.50% 01/06/2031	151.631	0,13
USD	82.000	GTCR AP Finance Inc. 8.00% 15/05/2027	78.720	0,07	USD	161.000	Kaiser Aluminum Corp. 4.63% 01/03/2028	145.316	0,12
USD	466.000	H&E Equipment Services Inc. 3.88% 15/12/2028	410.318	0,34	USD	915.000	KAR Auction Services Inc. 5.13% 01/06/2025	904.135	0,76
USD	289.000	Hanesbrands Inc. 9.00% 15/02/2031	296.141	0,25	USD	200.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP 4.25% 01/02/2027	158.125	0,13
USD	329.000	HB Fuller Company 4.25% 15/10/2028	294.077	0,25	USD	772.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP 4.75% 15/06/2029	559.217	0,48
USD	135.000	HealthEquity Inc. 4.50% 01/10/2029	121.872	0,10	USD	371.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP 5.25% 01/10/2025	328.457	0,27
USD	486.000	Helios Software Holdings Inc. 4.63% 01/05/2028	397.305	0,33	USD	180.000	Lithia Motors Inc. 4.38% 15/01/2031	155.138	0,13
USD	307.000	Herc Holdings Inc. 5.50% 15/07/2027	296.831	0,25	USD	157.000	Live Nation Entertainment Inc. 4.75% 15/10/2027	145.870	0,12
USD	377.000	Hightower Holding LLC 6.75% 15/04/2029	321.106	0,27	USD	229.000	Live Nation Entertainment Inc. 4.88% 01/11/2024	224.563	0,19
USD	283.000	Hilcorp Energy I LP 5.75% 01/02/2029	263.190	0,22	USD	254.000	Live Nation Entertainment Inc. 6.50% 15/05/2027	257.016	0,21
USD	152.000	Hilcorp Energy I LP 6.00% 15/04/2030	141.514	0,12	USD	147.000	Madison IAQ LLC 4.13% 30/06/2028	128.032	0,11
USD	197.000	Hilcorp Energy I LP 6.25% 01/11/2028	189.136	0,16	USD	372.000	Madison IAQ LLC 5.88% 30/06/2029	287.919	0,24
USD	237.000	Hilcorp Energy I LP 6.25% 15/04/2032	220.366	0,18	USD	115.000	Match Group Holdings II LLC 3.63% 01/10/2031	93.498	0,08
USD	372.000	Holly Energy Partners Corp. 5.00% 01/02/2028	349.689	0,29	USD	463.000	Match Group Holdings II LLC 4.63% 01/06/2028	430.011	0,36
					USD	753.000	McAfee Corp. 7.38% 15/02/2030	630.167	0,53

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ÉTATS-UNIS (suite)				ÉTATS-UNIS (suite)					
Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
USD	67.000	Medline Borrower LP 3.88% 01/04/2029	58.164	0,05	USD	260.000	Olympus Water USA Holding Corp. 7.13% 01/10/2027	244.698	0,20
USD	800.000	Medline Borrower LP 5.25% 01/10/2029	695.165	0,58	USD	126.000	OneMain Finance Corp. 4.00% 15/09/2030	95.722	0,08
USD	416.000	Meritage Homes Corp. 3.88% 15/04/2029	369.460	0,31	USD	216.000	OneMain Finance Corp. 6.13% 15/03/2024	210.821	0,18
USD	214.000	Midwest Gaming Borrower LLC 4.88% 01/05/2029	186.407	0,16	USD	189.000	OneMain Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	183.683	0,15
USD	403.299	Mileage Plus Holdings LLC 6.50% 20/06/2027	402.038	0,34	USD	375.000	Organon & Company 4.13% 30/04/2028	342.656	0,29
USD	170.000	Nabors Industries Inc. 7.38% 15/05/2027	166.439	0,14	USD	196.000	Outfront Media Capital LLC 4.25% 15/01/2029	166.257	0,14
USD	391.000	Navient Corp. 6.75% 25/06/2025	385.311	0,32	USD	229.000	Outfront Media Capital LLC 4.63% 15/03/2030	193.219	0,17
USD	175.000	NCR Corp 5.75% 01/09/2027	171.978	0,14	USD	273.000	Park Intermediate Holdings LLC 4.88% 15/05/2029	235.033	0,20
USD	120.000	NCR Corp 6.13% 01/09/2029	118.501	0,10	USD	395.000	Park Intermediate Holdings LLC 5.88% 01/10/2028	363.943	0,30
USD	759.000	NCR Corp. 5.00% 01/10/2028	671.525	0,56	USD	77.000	Park Intermediate Holdings LLC 7.50% 01/06/2025	77.529	0,06
USD	729.000	Neptune Bidco USA Inc. 9.29% 15/04/2029	678.134	0,57	USD	744.000	Permian Resources Operating LLC 5.88% 01/07/2029	703.544	0,59
USD	343.000	NextEra Energy Operating Partners 4.50% 15/09/2027	327.511	0,27	USD	73.000	Permian Resources Operating LLC 6.88% 01/04/2027	71.947	0,06
USD	337.000	NFP Corp. 4.88% 15/08/2028	307.170	0,26	USD	348.000	PetSmart Inc. 4.75% 15/02/2028	328.738	0,27
USD	878.000	NFP Corp. 6.88% 15/08/2028	762.764	0,63	USD	408.000	PetSmart Inc. 7.75% 15/02/2029	401.491	0,34
USD	402.000	NFP Corp. 7.50% 01/10/2030	393.625	0,33	USD	640.000	Post Holdings Inc. 4.63% 15/04/2030	574.000	0,48
USD	287.000	Novelis Corp. 3.25% 15/11/2026	263.155	0,22	USD	340.000	Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	334.875	0,28
USD	758.000	Novelis Corp. 4.75% 30/01/2030	696.886	0,58	USD	475.000	Primo Water Holdings Inc. 4.38% 30/04/2029	418.891	0,35
USD	147.000	NRG Energy Inc. 3.38% 15/02/2029	122.656	0,10	USD	628.000	Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	557.727	0,47
USD	460.000	NRG Energy Inc. 3.63% 15/02/2031	373.951	0,32	USD	183.000	Radian Group Inc. 4.88% 15/03/2027	173.885	0,15
USD	247.000	NRG Energy Inc. 5.25% 15/06/2029	229.499	0,19	USD	291.000	Radian Group Inc. 6.63% 15/03/2025	289.810	0,24
USD	156.000	NRG Energy Inc. 5.75% 15/01/2028	152.983	0,13	USD	407.000	Radiate Holco LLC 4.50% 15/09/2026	318.986	0,27
USD	222.000	Nustar Logistics LP 5.75% 01/10/2025	217.331	0,18	USD	463.000	Radiate Holco LLC 6.50% 15/09/2028	191.566	0,16
USD	266.000	NuStar Logistics LP 5.63% 28/04/2027	253.840	0,21	USD	358.000	Resideo Funding Inc. 4.00% 01/09/2029	299.496	0,25
USD	578.000	NuStar Logistics LP 6.00% 01/06/2026	567.662	0,47	USD	129.000	RLJ Lodging Trust LP 3.75% 01/07/2026	119.229	0,10
USD	451.000	Occidental Petroleum Corp. 6.13% 01/01/2031	467.983	0,39	USD	569.000	Roblox Corp. 3.88% 01/05/2030	488.629	0,41
USD	435.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	459.728	0,38	USD	330.000	Rocket Mortgage LLC 3.63% 01/03/2029	282.975	0,24
USD	62.000	Occidental Petroleum Corp. 7.50% 01/05/2031	68.930	0,06					
USD	513.000	Olympus Water USA Holding Corp. 4.25% 01/10/2028	421.301	0,35					
USD	272.000	Olympus Water USA Holding Corp. 6.25% 01/10/2029	204.387	0,17					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ÉTATS-UNIS (suite)					ÉTATS-UNIS (suite)				
USD	247.000	Rocket Mortgage LLC 3.88% 01/03/2031	204.952	0,17	USD	168.000	Taylor Morrison Communities Inc. 5.88% 15/06/2027	166.442	0,14
USD	906.000	Rocket Mortgage LLC 4.00% 15/10/2033	721.493	0,59	USD	215.000	Tempo Acquisition LLC 5.75% 01/06/2025	215.525	0,18
USD	180.000	Sabre GBLB Inc. 7.38% 01/09/2025	160.898	0,13	USD	107.000	Tempur Sealy International 3.88% 15/10/2031	89.675	0,07
USD	137.000	Sabre GBLB Inc. 9.25% 15/04/2025	128.667	0,11	USD	233.000	Tenet Healthcare Corp. 6.13% 15/06/2030	230.117	0,19
USD	582.000	Scientific Games Holdings LP 6.63% 01/03/2030	515.070	0,43	USD	192.000	Terraform Power Operating LLC 5.00% 31/01/2028	185.312	0,15
USD	164.000	Scientific Games International Inc. 7.00% 15/05/2028	162.868	0,14	USD	529.000	TK Elevator US Newco Inc. 5.25% 15/07/2027	498.107	0,42
USD	622.000	Select Medical Corp. 6.25% 15/08/2026	604.117	0,50	USD	333.000	TransDigm Inc. 5.50% 15/11/2027	314.269	0,26
USD	362.000	Shift4 Payments LLC 4.63% 01/11/2026	341.786	0,29	USD	981.000	TransDigm Inc. 6.25% 15/03/2026	984.065	0,82
USD	290.000	Simmons Food Inc. 4.63% 01/03/2029	235.844	0,20	USD	217.000	TransDigm Inc. 6.38% 15/06/2026	214.020	0,18
USD	259.000	Sirius XM Radio Inc. 4.00% 15/07/2028	222.578	0,19	USD	296.000	TransDigm Inc. 6.75% 15/08/2028	299.145	0,25
USD	174.000	Sirius XM Radio Inc. 5.50% 01/07/2029	158.449	0,13	USD	1.024.000	Uber Technologies Inc. 4.50% 15/08/2029	936.916	0,78
USD	755.000	Southwestern Energy Company 4.75% 01/02/2032	666.470	0,56	USD	145.000	Uber Technologies Inc. 7.50% 15/05/2025	146.722	0,12
USD	206.000	Southwestern Energy Company 5.38% 01/02/2029	194.541	0,16	USD	201.000	United Airlines Inc. 4.38% 15/04/2026	192.834	0,16
USD	68.000	Southwestern Energy Company 5.70% 23/01/2025	68.000	0,06	USD	555.000	United Airlines Inc. 4.63% 15/04/2029	504.703	0,42
USD	199.000	Spectrum Brands Inc. 5.00% 01/10/2029	175.618	0,14	USD	279.000	Univision Communications Inc. 4.50% 01/05/2029	236.212	0,20
USD	64.000	Spectrum Brands Inc. 5.50% 15/07/2030	57.320	0,05	USD	235.000	Univision Communications Inc. 7.38% 30/06/2030	222.007	0,19
USD	230.000	Spectrum Brands Inc. 5.75% 15/07/2025	228.611	0,19	USD	162.000	US Foods Inc. 4.63% 01/06/2030	147.109	0,12
USD	177.000	Spirit AeroSystems Inc. 9.38% 30/11/2029	193.373	0,16	USD	399.000	US Foods Inc. 4.75% 15/02/2029	368.826	0,30
USD	133.000	SRS Distribution Inc. 4.63% 01/07/2028	117.967	0,10	USD	150.000	US Foods Inc. 6.25% 15/04/2025	151.412	0,13
USD	340.000	SRS Distribution Inc. 6.00% 01/12/2029	283.305	0,24	USD	335.000	USI Inc. 6.88% 01/05/2025	331.409	0,28
USD	519.000	SRS Distribution Inc. 6.13% 01/07/2029	438.231	0,37	USD	376.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 15/08/2029	338.849	0,28
USD	202.000	Standard Industries Inc. 5.00% 15/02/2027	192.784	0,16	USD	612.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 01/11/2033	516.213	0,43
USD	151.000	Staples Inc. 7.50% 15/04/2026	132.347	0,11	USD	363.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 4.13% 15/08/2031	319.378	0,27
USD	210.000	Surgery Center Holdings Inc. 6.75% 01/07/2025	208.967	0,17	USD	436.000	Verscend Escrow Corp. 9.75% 15/08/2026	438.945	0,37
USD	200.000	Taylor Morrison Communities Inc. 5.75% 15/01/2028	197.484	0,16	USD	82.000	Vistra Operations Company LLC 4.38% 01/05/2029	73.050	0,06
					USD	222.000	Vistra Operations Company LLC 5.50% 01/09/2026	215.340	0,18
					USD	353.000	Vistra Operations Company LLC 5.63% 15/02/2027	343.443	0,29

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ÉTATS-UNIS (suite)				ÉTATS-UNIS (suite)					
USD	612.000	Waste Pro USA Inc. 5.50% 15/02/2026	563.078	0,47	USD	637.000	DISH DBS Corp. 5.13% 01/06/2029	337.610	0,28
USD	233.000	Wesco Distribution Inc. 7.13% 15/06/2025	237.112	0,20	USD	243.000	DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	160.836	0,13
USD	635.000	Wesco Distribution Inc. 7.25% 15/06/2028	651.669	0,54	USD	608.757	iHeartCommunications Inc. 8.38% 01/05/2027	445.063	0,37
USD	171.000	Western Midstream Operating LP 4.30% 01/02/2030	156.359	0,13	USD	418.000	Matador Resources Company 5.88% 15/09/2026	412.930	0,35
USD	331.000	Western Midstream Operating LP 4.65% 01/07/2026	321.009	0,27	USD	119.000	Newell Brands Inc. 6.38% 15/09/2027	120.226	0,10
USD	619.000	White Cap Buyer LLC 6.88% 15/10/2028	540.210	0,45	USD	167.000	Newell Brands Inc. 6.63% 15/09/2029	168.955	0,14
USD	206.000	Wolverine World Wide Inc. 4.00% 15/08/2029	167.612	0,14	USD	428.000	Occidental Petroleum Corp. 6.45% 15/09/2036	448.598	0,37
USD	489.000	WR Grace Holdings LLC 4.88% 15/06/2027	472.574	0,39	USD	137.000	Occidental Petroleum Corp. 6.60% 15/03/2046	144.364	0,12
USD	852.000	WR Grace Holdings LLC 5.63% 15/08/2029	722.851	0,61	USD	447.000	Pilgrim's Pride Corp. 3.50% 01/03/2032	364.607	0,30
USD	166.000	WR Grace Holdings LLC 7.38% 01/03/2031	166.841	0,14	USD	265.000	Pilgrim's Pride Corp. 4.25% 15/04/2031	233.908	0,20
USD	373.000	Yum! Brands Inc. 5.38% 01/04/2032	360.842	0,30	USD	200.000	Scotts Miracle-Gro Company 4.00% 01/04/2031	160.779	0,14
USD	99.000	Zayo Group Holdings Inc. 4.00% 01/03/2027	75.549	0,06	USD	185.000	Scotts Miracle-Gro CoThe 4.38% 01/02/2032	149.532	0,12
USD	690.000	ZoomInfo Technologies LLC 3.88% 01/02/2029	599.438	0,51	USD	244.000	Sunoco LP Sunoco Finance Corp. 5.88% 15/03/2028	238.998	0,20
		Total États-Unis	86.465.215	72,24	USD	415.000	Tenet Healthcare Corp. 4.88% 01/01/2026	407.628	0,34
		Total Obligations	104.825.631	87,57	USD	275.000	Tenet Healthcare Corp. 5.13% 01/11/2027	265.729	0,22
		Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	104.825.631	87,57	USD	399.000	Tenet Healthcare Corp. 6.13% 01/10/2028	381.793	0,32
		Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises			USD	736.000	Tenet Healthcare Corp. 6.25% 01/02/2027	727.121	0,62
		Obligations			USD	619.000	TransMontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	535.951	0,45
		ÉTATS-UNIS			USD	317.000	USA Compression Partners LP 6.88% 01/04/2026	312.994	0,26
		USD	622.000	Callon Petroleum Company 6.38% 01/07/2026	595.732	0,50	Total États-Unis	7.219.137	6,04
		USD	188.000	CCO Holdings LLC 4.50% 01/05/2032	153.690	0,13	Total Obligations	7.219.137	6,04
		USD	272.000	Cedar Fair LP/ Canada's Wonderland Company 6.50% 01/10/2028	265.200	0,22	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises	7.219.137	6,04
		USD	189.000	Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	186.893	0,16			

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
Obligations			
LUXEMBOURG			
USD	142.000 Altice France Holding SA 10.50% 15/05/2027	108.808	0,09
	Total Luxembourg	108.808	0,09
ÉTATS-UNIS			
USD	196.000 Illuminate Buyer LLC 9.00% 01/07/2028	177.380	0,15
USD	357.000 Innophos Holdings Inc. 9.38% 15/02/2028	365.416	0,31
USD	219.000 Iris Holdings Inc. 8.75% 15/02/2026	204.628	0,17
	Total États-Unis	747.424	0,63
	Total Obligations	856.232	0,72
	Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	856.232	0,72
	Valeur totale des investissements	112.901.000	94,33
(Coût total : 124.022.245 USD)			

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations				Obligations (suite)					
Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
BAHAMAS				ÎLES CAÏMANS (suite)					
USD	200.000	Competition Team Technologies Limited 3.75% 12/03/2024	197.311	0,46	USD	400.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	344.947	0,80
Total Bahamas			197.311	0,46	USD	600.000	Times China Holdings Limited 0.00% 16/07/2023	92.750	0,22
ÎLES CAÏMANS				USD	467.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	428.559	1,00	
USD	250.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	232.975	0,54	Total Îles Caïmans			6.871.467	15,97
USD	250.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	235.151	0,55	HONG KONG				
USD	500.000	China Mengniu Dairy Company Limited 1.88% 17/06/2025	466.169	1,08	USD	400.000	Bank of East Asia Limited FRN 29/05/2030	366.277	0,85
USD	600.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	128.306	0,30	USD	260.000	Lenovo Group Limited 3.42% 02/11/2030	218.010	0,51
USD	600.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	567.434	1,32	USD	485.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	491.489	1,14
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 2.70% 12/07/2026	110.222	0,26	USD	500.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	379.944	0,88
USD	460.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	270.040	0,63	Total Hong Kong			1.455.720	3,38
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 5.40% 27/05/2025	132.289	0,31	INDE				
USD	500.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	419.158	0,97	USD	400.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	287.500	0,67
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	342.638	0,80	USD	280.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	242.550	0,56
USD	500.000	HPHT Finance 19 Limited 2.88% 05/11/2024	483.107	1,12	USD	300.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 3.10% 02/02/2031	195.961	0,46
USD	1.000.000	Logan Group Company Limited 0.00% 06/07/2026	232.745	0,54	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	158.675	0,37
USD	200.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	150.533	0,35	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	306.024	0,71
USD	400.000	Longfor Group Holdings Limited 4.50% 16/01/2028	332.116	0,77	USD	400.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	351.304	0,82
USD	800.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	640.809	1,49	USD	226.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.75% 02/02/2026	211.796	0,49
USD	500.000	Melco Resorts Finance Limited 4.88% 06/06/2025	469.846	1,09	USD	500.000	Ongc Videsh Limited 4.63% 15/07/2024	495.399	1,15
USD	300.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	267.280	0,62	USD	500.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	470.537	1,09
USD	250.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 2.75% 13/05/2030	220.569	0,51	USD	490.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	410.133	0,95
USD	270.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 3.75% 25/02/2029	255.463	0,59	Total Inde			3.129.879	7,27
USD	200.000	Sunac China Holdings Limited 6.50% 09/07/2023	48.361	0,11					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
INDONÉSIE					PHILIPPINES				
USD	400.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.80% 15/05/2050	359.265	0,84	USD	400.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	321.152	0,75
USD	400.000	Pertamina Persero PT 5.63% 20/05/2043	380.873	0,89	USD	520.000	Globe Telecom Inc. - Perp FRN	477.805	1,11
USD	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT 5.25% 24/10/2042	176.125	0,41	USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	188.513	0,44
USD	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT 6.25% 25/01/2049	194.963	0,45	USD	714.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	651.074	1,51
USD	400.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	15.000	0,03	USD	470.000	SMC Global Power Holdings Corp. Perp FRN	385.769	0,90
Total Indonésie			1.126.226	2,62	Total Philippines			2.024.313	4,71
ÎLE DE MAN					RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)				
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	368.502	0,86	USD	500.000	Shinhan Financial Group Company Limited Perp FRN	497.153	1,15
Total Île de Man			368.502	0,86	USD	400.000	SK Hynix Inc. 6.50% 17/01/2033	392.572	0,91
MALAISIE					Total République de Corée (du Sud)				
USD	200.000	Axiata SPV2 Bhd 4.36% 24/03/2026	197.267	0,46				889.725	2,06
USD	500.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	467.832	1,09	SINGAPOUR				
USD	720.000	Petronas Capital Limited 4.55% 21/04/2050	673.241	1,56	USD	300.000	ABJA Investment Company 5.45% 24/01/2028	291.496	0,68
USD	400.000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.85% 01/11/2028	399.092	0,93	USD	400.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	342.313	0,80
Total Malaisie			1.737.432	4,04	USD	550.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	547.122	1,27
ÎLE MAURICE					USD	700.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 1.88% 10/06/2030	588.780	1,37
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	385.588	0,90	USD	550.000	United Overseas Bank Limited FRN 16/03/2031	492.780	1,15
USD	469.000	Network I2i Limited Perp FRN	443.965	1,03	Total Singapour			2.262.491	5,27
Total Île Maurice			829.553	1,93	THAÏLANDE				
PAYS-BAS					USD	800.000	Bangkok Bank pcl FRN 25/09/2034	681.857	1,58
USD	526.400	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	473.760	1,10	USD	270.000	GC Treasury Center Company Limited 4.30% 18/03/2051	196.003	0,46
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	214.250	0,50	USD	200.000	GCTreasury Centre Company 2.98% 18/03/2031	164.568	0,38
USD	500.000	Royal Capital BV FRN 05/05/2169	484.346	1,13	USD	400.000	Kasikornbank pcl FRN 02/10/2031	352.755	0,82
Total Pays-Bas			1.172.356	2,73	Total Thaïlande			1.395.183	3,24
ROYAUME-UNI					USD	600.000	Standard Chartered plc FRN 26/01/2169	557.499	1,30

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*			
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)			Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)					
ROYAUME-UNI (suite)			INDONÉSIE					
USD 400.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	237.550	0,55	USD 500.000	Indonesia (Govt of) 3.05% 12/03/2051	370.472	0,86	
	Total Royaume-Uni	795.049	1,85	USD 500.000	Indonesia (Govt of) 3.20% 23/09/2061	349.110	0,81	
ÎLES VIERGES (BRITANNIQUES)			INDONÉSIE					
USD 500.000	CMHI Finance [BVI] Company - Perp FRN	495.105	1,14	USD 800.000	Indonesia (Govt of) 3.40% 18/09/2029	749.198	1,74	
USD 500.000	CNPC Global Capital Limited 1.35% 23/06/2025	462.733	1,08	USD 1.000.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 11/02/2029	1.011.528	2,36	
USD 450.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	382.475	0,89	USD 200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	230.533	0,54	
USD 600.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	539.278	1,25	USD 200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	190.963	0,44	
USD 750.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	699.342	1,62		Total Indonésie	2.901.804	6,75	
USD 511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	456.896	1,06	MONGOLIE				
USD 500.000	Hongkong Electric Finance Limited 1.88% 27/08/2030	411.321	0,96	USD 200.000	Mongolia (Govt of) 8.65% 19/01/2028	197.219	0,46	
USD 1.000.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	900.477	2,09		Total Mongolie	197.219	0,46	
USD 300.000	Nan Fung Treasury Limited 5.00% 05/09/2028	289.045	0,67	PAKISTAN				
USD 340.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.63% 05/08/2030	280.767	0,65	USD 350.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	130.377	0,30	
USD 500.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	385.000	0,89	USD 200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	78.750	0,18	
USD 400.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	372.265	0,87		Total Pakistan	209.127	0,48	
USD 850.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	770.224	1,79	PHILIPPINES				
USD 400.000	Yongda Investment Limited 2.25% 16/06/2025	374.209	0,87	USD 1.000.000	Philippine (Govt of) 3.00% 01/02/2028	942.746	2,19	
	Total Îles Vierges (Britanniques)	6.819.137	15,83	USD 400.000	Philippine (Govt of) 3.75% 14/01/2029	385.203	0,90	
Total Obligations		31.074.344	72,22		Total Philippines	1.327.949	3,09	
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance			SRI LANKA					
INDE			USD 420.000			Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023	152.278	0,35
USD 400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	353.054	0,82		Total Sri Lanka	152.278	0,35	
	Total Inde	353.054	0,82					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)		
ÎLES VIERGES (BRITANNIQUES)		
USD 500.000 Talent Yield International Limited 3.13% 06/05/2031	439.135	1,02
Total Îles Vierges (Britanniques)	439.135	1,02
Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance	5.580.566	12,97
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	36.654.910	85,19
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		
Obligations		
ÎLES CAÏMANS		
USD 450.000 Sunac China Holdings Limited 8.35% 19/04/2023	108.995	0,25
Total Îles Caïmans	108.995	0,25
Total Obligations	108.995	0,25
Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	108.995	0,25
Valeur totale des investissements	36.763.905	85,44
(Coût total : 43.946.784 USD)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Autres organismes de placement collectif		
Fonds		
ROYAUME-UNI		
– CT European Fund***	0	0,00
– CT European Select Fund***	0	0,00
– CT Japan Fund***	0	0,00
Total Royaume-Uni	0	0,00
Total Fonds	0	0,00
Total Autres organismes de placement collectif	0	0,00
Valeur totale des investissements	441.234	108,17
(Coût total : 421.736 EUR)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

**Voir annexe 18.

***Fonds de sociétés apparentées, quantité fractionnaire arrondie à 0.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				Actions (suite)				
Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	
MEXIQUE				FRANCE				
USD	660.000 Mexico (Govt of) 5.75% 12/10/2110	593.802	1,66	5.662	AXA SA	173.256	0,48	
				907	EssilorLuxottica SA	163.578	0,46	
				516	L'Oreal SA	230.550	0,64	
				235	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	215.589	0,61	
				1.533	Schneider Electric SE	255.958	0,72	
				8.663	TotalEnergies SE	511.632	1,43	
	Total Mexique	593.802	1,66		Total France	1.550.563	4,34	
ROYAUME-UNI				ALLEMAGNE				
GBP	87.000 United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051	60.270	0,17	738	Adidas AG	130.517	0,36	
GBP	600.000 United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.15% 22/03/2051	842.399	2,36		Total Allemagne	130.517	0,36	
	Total Royaume-Uni	902.669	2,53	HONG KONG				
ÉTATS-UNIS				23.200	AIA Group Limited	244.266	0,69	
USD	2.350.000 United States Treasury Bill 0.00% 16/05/2023	2.337.179	6,53		Total Hong Kong	244.266	0,69	
USD	1.200.000 United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2032	1.053.562	2,95	INDE				
USD	2.618.000 United States Treasury N/B 2.88% 15/05/2032	2.492.009	6,96	5.500	HDFC Bank Limited - ADR	366.685	1,03	
USD	1.505.000 United States Treasury N/B 3.00% 15/08/2052	1.321.931	3,70	6.929	Kotak Mahindra Bank Limited	146.100	0,41	
USD	1.775.200 United States Treasury N/B 3.38% 15/08/2042	1.668.827	4,67		Total Inde	512.785	1,44	
USD	1.850.000 United States Treasury N/B 3.88% 30/11/2027	1.869.512	5,23	INDONÉSIE				
	Total États-Unis	10.743.020	30,04	829.150	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	261.550	0,73	
Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance					Total Indonésie	261.550	0,73	
12.239.491				34,23	IRLANDE			
Actions				2.813	CRH plc	142.036	0,40	
AUSTRALIE				840	Linde plc	298.569	0,84	
	969	CSL Limited	187.103	0,52		Total Irlande	440.605	1,24
	Total Australie	187.103	0,52	JAPON				
CANADA				600	Keyence Corp.	290.555	0,81	
	2.068	Nutrien Limited	152.516	0,43	3.600	Recruit Holdings Company Limited	98.730	0,28
	Total Canada	152.516	0,43	2.000	Sony Group Corp.	180.104	0,50	
DANEMARK					Total Japon	569.389	1,59	
	1.308	Novo Nordisk AS	207.134	0,58	PAYS-BAS			
	2.406	Orsted A/S	204.718	0,57	1.135	Koninklijke DSM NV	134.040	0,37
	Total Danemark	411.852	1,15		Total Pays-Bas	134.040	0,37	

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)			Actions (suite)		
NORVÈGE			ÉTATS-UNIS (suite)		
6.643 Equinor ASA	189.463	0,53	2.008 Electronic Arts Inc.	241.864	0,68
Total Norvège	189.463	0,53	470 Elevance Health Inc.	216.111	0,60
RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)			1.026 Eli Lilly & Company	352.349	0,99
377 Samsung Sdi Company Limited	212.848	0,60	238 Equinix Inc.	171.608	0,48
Total République de Corée (du Sud)	212.848	0,60	1.697 IntercontinentalExchange Inc.	176.980	0,49
SINGAPOUR			873 Intuit Inc.	389.210	1,09
10.300 DBS Group Holdings Limited	255.650	0,71	2.906 JPMorgan Chase & Company	378.682	1,05
Total Singapour	255.650	0,71	508 Lam Research Corp.	269.301	0,75
SUISSE			1.582 Mastercard Inc. - A	574.915	1,61
295 Lonza Group AG - Reg	176.764	0,49	160 Mercadolibre Inc.	210.890	0,59
2.776 Nestle SA - Reg	338.693	0,95	3.249 Micron Technology Inc.	196.045	0,55
Total Suisse	515.457	1,44	3.484 Microsoft Corp.	1.004.437	2,80
TAÏWAN			3.102 NextEra Energy Inc.	239.102	0,68
23.000 Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	402.622	1,12	913 NVIDIA Corp.	253.604	0,71
Total Taïwan	402.622	1,12	2.220 ON Semiconductor Corp.	182.750	0,51
ROYAUME-UNI			1.585 Paypal Holdings Inc.	120.365	0,34
4.557 Anglo American plc	150.892	0,42	1.638 PepsiCo Inc.	298.607	0,83
5.402 Diageo plc	241.390	0,68	2.270 QUALCOMM Inc.	289.607	0,81
8.461 Shell plc	241.506	0,68	669 Stryker Corp.	190.979	0,54
5.043 SSE plc	112.425	0,31	488 Thermo Fisher Scientific Inc.	281.269	0,79
Total Royaume-Uni	746.213	2,09	3.508 T-Mobile USA Inc.	508.099	1,42
ÉTATS-UNIS			3.348 Trimble Inc.	175.502	0,49
1.703 Abbott Laboratories	172.446	0,48	7.433 Uber Technologies Inc.	235.626	0,66
623 Adobe Inc.	240.086	0,67	1.200 Union Pacific Corp.	241.512	0,68
1.761 Advanced Micro Devices Inc.	172.596	0,48	1.902 Walt Disney Company	190.447	0,53
7.152 Alphabet Inc. - A	741.877	2,07	Total États-Unis	10.287.107	28,76
6.203 Amazon.com Inc.	640.707	1,79	Total Actions	17.204.546	48,11
750 Autodesk Inc.	156.120	0,44	Instruments structurés - Matières premières		
511 Cooper Companies Inc.	190.787	0,53	IRLANDE		
869 Crowdstrike Holdings Inc. - A	119.279	0,33	1.035 Invesco Physical Gold ETC 0.00%	197.789	0,55
407 Deere & Company	168.042	0,47	Total Irlande	197.789	0,55
1.784 Ecolab Inc.	295.306	0,83	Total Instruments structurés - Matières premières	197.789	0,55
			Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	29.641.826	82,89

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Fonds		
LUXEMBOURG		
90.494 Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio XU**	1.885.062	5,27
Total Luxembourg	1.885.062	5,27
Total Fonds	1.885.062	5,27
Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	1.885.062	5,27
Autres organismes de placement collectif		
Fonds		
ROYAUME-UNI		
309.138 CT Emerging Market Local Fund***	884.474	2,48
Total Royaume-Uni	884.474	2,48
Total Fonds	884.474	2,48
Total Autres organismes de placement collectif	884.474	2,48
Valeur totale des investissements	32.411.362	90,64
(Coût total : 28.868.926 USD)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

**Voir annexe 18.

***Fonds de sociétés apparentées.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations				Obligations (suite)					
AUSTRALIE				FINLANDE					
EUR	100.000	APA Infrastructure Limited 0.75% 15/03/2029	88.981	0,08	EUR	100.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	92.125	0,08
USD	77.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	73.348	0,07	EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	93.134	0,09
EUR	100.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	111.159	0,10	EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.63% 31/03/2027	101.958	0,09
USD	97.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	93.652	0,09			Total Finlande	287.217	0,26
		Total Australie	367.140	0,34					
BELGIQUE				FRANCE					
EUR	100.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	110.275	0,10	EUR	100.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	101.493	0,09
EUR	100.000	Solvay SA FRN 02/03/2169	97.454	0,09	EUR	100.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	81.781	0,07
EUR	100.000	Solvay SA Perp FRN 04/03/2168	108.089	0,10	EUR	100.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	84.053	0,08
		Total Belgique	315.818	0,29	EUR	104.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	85.196	0,08
BERMUDES				FRANCE (suite)					
USD	100.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	93.753	0,09	EUR	100.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	96.287	0,09
		Total Bermudes	93.753	0,09	USD	200.000	BNP Paribas SA FRN 13/01/2029	200.138	0,19
CANADA				FRANCE (suite)					
USD	31.000	Enbridge Inc. 5.70% 08/03/2033	32.289	0,03	EUR	100.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	82.080	0,07
EUR	172.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	163.040	0,15	EUR	192.000	CAB Selas 3.38% 01/02/2028	171.782	0,16
		Total Canada	195.329	0,18	EUR	107.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	35.718	0,03
ÎLES CAÏMANS				FRANCE (suite)					
GBP	112.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	119.953	0,11	EUR	200.000	Electricite de France SA FRN 01/06/2170	172.973	0,16
		Total Îles Caïmans	119.953	0,11	EUR	200.000	Electricite de France SA FRN 15/03/2169	182.711	0,17
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE				FRANCE (suite)					
EUR	100.000	Allwyn International AS 4.13% 20/11/2024	107.092	0,10	EUR	200.000	Electricite de France SA 4.25% 25/01/2032	215.781	0,20
		Total République tchèque	107.092	0,10	EUR	100.000	Electricite de France SA FRN 22/01/2049	100.586	0,09
DANEMARK				FRANCE (suite)					
EUR	100.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025	101.540	0,09	EUR	100.000	Electricite de France SA FRN 29/12/2049	104.151	0,10
		Total Danemark	101.540	0,09	GBP	200.000	Electricite de France SA FRN 31/12/2049	205.790	0,19
					EUR	100.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	95.409	0,09
					EUR	100.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	103.379	0,10
					EUR	150.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	142.568	0,13
					EUR	187.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	181.144	0,17
					EUR	100.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	97.594	0,09
					EUR	100.000	Faurecia SE 7.25% 15/06/2026	112.289	0,10
					EUR	105.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	110.920	0,10
					EUR	317.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	332.551	0,31
					EUR	100.000	Iliad Holding SASU 5.63% 15/10/2028	101.399	0,09
					EUR	100.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	107.983	0,10
					EUR	100.000	iliad SA 5.63% 15/02/2030	105.615	0,10

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ITALIE (suite)				LUXEMBOURG (suite)					
EUR	100.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	115.473	0,11	EUR	121.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	127.421	0,12
EUR	113.000	Mundys SpA 1.88% 13/07/2027	108.947	0,10	EUR	27.029	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	29.362	0,03
EUR	193.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	190.855	0,17	EUR	100.000	Eurofins Scientific SE FRN 13/11/2166	100.380	0,09
EUR	220.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	228.598	0,21	GBP	100.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	94.184	0,09
EUR	150.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	156.508	0,14	EUR	100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	76.816	0,07
EUR	119.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	132.289	0,12	EUR	384.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	355.919	0,33
		Total Italie	1.831.692	1,66	EUR	98.240	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	106.228	0,10
					EUR	140.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	141.972	0,13
JAPON					EUR	100.000	Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	100.578	0,09
USD	200.000	Central Nippon Expressway Company Limited 0.89% 10/12/2025	180.128	0,16	EUR	100.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	81.710	0,07
EUR	100.000	Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	99.616	0,09	EUR	100.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	101.063	0,09
		Total Japon	279.744	0,25	EUR	100.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	99.859	0,09
JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES					EUR	44.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	51.292	0,05
EUR	159.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	168.809	0,15	EUR	100.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	99.553	0,09
EUR	100.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	87.896	0,08			Total Luxembourg	2.416.088	2,21
GBP	50.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	65.883	0,06	MEXIQUE				
EUR	100.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	100.678	0,09	EUR	100.000	Petroleos Mexicanos 2.75% 21/04/2027	86.636	0,08
		Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	423.266	0,38	EUR	149.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	128.282	0,12
LUXEMBOURG							Total Mexique	214.918	0,20
EUR	200.000	Agps Bondco plc 3.25% 05/08/2025	88.383	0,08	PAYS-BAS				
EUR	130.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	133.238	0,12	EUR	137.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	128.453	0,12
EUR	137.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	112.307	0,10	EUR	100.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	107.550	0,10
EUR	164.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	133.766	0,12	EUR	200.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	212.227	0,19
GBP	120.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	93.795	0,09	EUR	200.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	211.457	0,19
GBP	140.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	163.010	0,15	EUR	100.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	76.581	0,07
EUR	141.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	125.252	0,11	EUR	146.000	Dufry One BV 2.00% 15/02/2027	137.372	0,13

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
PAYS-BAS (suite)					PAYS-BAS (suite)				
GBP	68.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	88.672	0,08	EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	91.849	0,08
USD	15.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	16.432	0,02	Total Pays-Bas				
EUR	100.000	Naturgy Finance BV - Perp FRN	94.761	0,09	3.708.835 3,35				
EUR	100.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	105.917	0,10	NORVÈGE				
EUR	167.000	PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	166.900	0,15	EUR	100.000	DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	106.886	0,10
EUR	100.000	Repsol International Finance BV FRN 22/03/2170	94.780	0,09	USD	244.000	Kommunalbanken AS 0.38% 11/09/2025	222.977	0,20
EUR	100.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	91.474	0,08	Total Norvège				
EUR	100.000	Stellantis NV 1.25% 20/06/2033	81.619	0,07	329.863 0,30				
EUR	144.765	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	123.407	0,11	PORTUGAL				
EUR	129.877	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	110.716	0,10	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	91.432	0,08
EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 24/05/2170	90.537	0,08	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 23/04/2083	106.756	0,10
EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	110.843	0,10	Total Portugal				
EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	90.537	0,08	198.188 0,18				
EUR	200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	212.585	0,19	ROUMANIE				
EUR	287.000	Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	291.296	0,26	EUR	100.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	102.757	0,09
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	98.520	0,09	Total Roumanie				
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	92.239	0,08	102.757 0,09				
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.38% 15/09/2029	110.316	0,10	ESPAGNE				
EUR	100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	81.600	0,07	EUR	200.000	Banco de SAbadell SA FRN 07/02/2029	206.192	0,20
EUR	100.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	89.869	0,08	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	92.918	0,08
EUR	100.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	103.004	0,09	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	88.931	0,08
EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 3.25% 18/11/2030	101.765	0,09	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	92.733	0,08
EUR	100.000	VZ Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	87.071	0,08	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 2.00% 15/02/2033	83.416	0,08
EUR	100.000	Wolters Kluwer NV 3.75% 03/04/2031	109.296	0,10	EUR	200.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	204.447	0,20
EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	99.190	0,09	EUR	100.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	90.566	0,08
					EUR	144.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	122.450	0,11
					EUR	100.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	102.536	0,09
					EUR	100.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	92.510	0,08
					EUR	100.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	99.131	0,09
					EUR	100.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	95.652	0,09

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ESPAGNE (suite)				ROYAUME-UNI (suite)					
EUR	272.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027		GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	116.070	0,11	
			272.088	0,26	GBP	137.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	141.475	0,13
		Total Espagne	1.643.570	1,52	EUR	155.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	151.461	0,14
					EUR	109.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	109.458	0,10
SUÈDE					EUR	19.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	20.123	0,02
EUR	162.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2169	90.565	0,08	GBP	100.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	130.040	0,12
EUR	50.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	27.952	0,03	EUR	100.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	101.935	0,09
EUR	52.111	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	54.497	0,05	EUR	100.000	INEOS Finance plc 6.63% 15/05/2028	109.722	0,10
EUR	135.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	122.410	0,11	EUR	100.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	97.788	0,09
EUR	100.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	100.679	0,09	EUR	119.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	116.368	0,11
EUR	100.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	88.314	0,08	EUR	190.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	199.716	0,18
EUR	100.000	Sagax AB 2.25% 13/03/2025	102.343	0,09	GBP	187.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	219.655	0,20
EUR	110.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB - Perp FRN	44.302	0,04	EUR	136.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	145.445	0,13
EUR	100.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	101.103	0,09	EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	104.047	0,10
EUR	100.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	108.979	0,10	GBP	200.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	208.651	0,18
EUR	155.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	140.316	0,13	GBP	200.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	246.092	0,21
		Total Suède	981.460	0,89	GBP	201.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	225.118	0,20
					EUR	100.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	83.304	0,08
SUISSE					GBP	100.000	National Grid Electricity Transmission plc 1.13% 07/07/2028	101.820	0,09
EUR	100.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	85.732	0,08	EUR	100.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	87.951	0,08
EUR	100.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	71.338	0,07	EUR	200.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	201.527	0,18
		Total Suisse	157.070	0,15	GBP	100.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	112.335	0,10
					GBP	100.000	Rolls-Royce plc 3.38% 18/06/2026	112.573	0,10
ROYAUME-UNI					GBP	121.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	143.213	0,13
GBP	100.000	Barclays plc 3.25% 12/02/2027	112.541	0,10	GBP	15.000	Santander UK plc Perp 10.06%	26.901	0,02
EUR	103.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	95.358	0,09					
GBP	167.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	134.929	0,12					
USD	94.000	BP Capital Markets plc FRN 22/09/2168	90.163	0,08					
EUR	142.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	143.039	0,12					
EUR	100.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	88.685	0,08					
GBP	75.000	Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	90.043	0,08					
EUR	100.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	87.651	0,08					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ROYAUME-UNI (suite)				ÉTATS-UNIS (suite)					
EUR	171.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	160.243	0,15	EUR	219.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	197.037	0,19
EUR	100.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	99.990	0,09	USD	114.000	Astrazeneca Finance LLC 4.88% 03/03/2028	117.366	0,11
GBP	100.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	110.722	0,10	USD	119.000	AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	86.539	0,08
EUR	100.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	93.938	0,09	USD	44.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	42.257	0,04
EUR	100.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	88.113	0,08	EUR	158.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	165.625	0,15
GBP	311.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	335.987	0,32	USD	30.000	Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	24.221	0,02
EUR	100.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	103.642	0,09	USD	53.000	Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	44.925	0,04
EUR	100.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	107.189	0,10	USD	91.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	77.001	0,07
GBP	155.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	182.699	0,17	USD	66.000	Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	55.141	0,05
USD	231.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	226.144	0,21	USD	30.000	Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	25.424	0,02
GBP	100.000	Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	122.116	0,11	USD	42.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	37.445	0,03
GBP	164.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	153.414	0,14	USD	91.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/03/2052	76.680	0,07
		Total Royaume-Uni	5.939.394	5,39	USD	25.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	18.492	0,02
					USD	30.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	30.003	0,03
ÉTATS-UNIS					USD	12.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	11.141	0,01
USD	63.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	55.679	0,05	USD	25.000	Brown-Forman Corp. 4.75% 15/04/2033	25.242	0,02
USD	10.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	9.659	0,01	EUR	100.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	98.008	0,09
USD	22.000	AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	16.096	0,01	USD	18.000	Charter Communications Operating LLC 3.90% 01/06/2052	11.915	0,01
USD	161.000	Amazon.com Inc. 4.70% 01/12/2032	165.357	0,14	USD	40.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	25.435	0,02
USD	21.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	17.752	0,02	USD	17.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	14.271	0,01
USD	23.000	Amgen Inc. 2.20% 21/02/2027	21.191	0,02	USD	13.000	Commonwealth Edison Company 5.30% 01/02/2053	13.629	0,01
USD	32.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	29.433	0,03	USD	12.000	Connecticut Light and Power Company 5.25% 15/01/2053	12.427	0,01
USD	35.000	Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	27.530	0,03	USD	15.000	Consolidated Edison Company of New York Inc. 3.95% 01/04/2050	12.477	0,01
USD	12.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	10.195	0,01	USD	21.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	17.139	0,02
USD	10.000	Amgen Inc. 4.88% 01/03/2053	9.386	0,01	USD	16.000	CSX Corp. 4.50% 15/11/2052	14.671	0,01
USD	33.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	33.759	0,03	USD	150.000	Daimler Truck Finance North America LLC 5.13% 19/01/2028	150.340	0,14
USD	122.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	125.409	0,11					
USD	19.000	Amgen Inc. 5.65% 02/03/2053	19.782	0,02					
USD	56.000	Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	58.306	0,05					
USD	113.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	112.602	0,10					
USD	50.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 4.35% 01/06/2040	47.032	0,04					
USD	40.000	Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	28.398	0,03					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ÉTATS-UNIS (suite)				ÉTATS-UNIS (suite)					
Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
USD	30.000	Emera US Finance LP 4.75% 15/06/2046	24.502	0,02	USD	199.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	167.343	0,16
USD	53.000	Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	47.377	0,04	USD	33.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	28.288	0,03
USD	169.000	Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	144.327	0,13	USD	45.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	34.429	0,03
USD	31.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	23.611	0,02	USD	78.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	68.726	0,06
USD	25.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	19.041	0,02	USD	17.000	Kinder Morgan Inc. 5.20% 01/06/2033	16.882	0,02
USD	23.000	Eversource Energy 5.45% 01/03/2028	23.842	0,02	GBP	100.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	119.570	0,11
USD	20.000	Federal Home Loan Banks 5.50% 15/07/2036	22.990	0,02	USD	12.000	Lowe's Companies Inc. 5.75% 01/07/2053	12.238	0,01
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	101.370	0,09	USD	47.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	47.503	0,04
GBP	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	117.866	0,11	USD	35.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	33.637	0,03
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	106.940	0,10	USD	156.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	124.980	0,11
GBP	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	237.748	0,22	USD	25.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	24.938	0,02
EUR	139.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	146.584	0,13	EUR	100.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	104.880	0,10
GBP	108.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	133.405	0,12	USD	37.000	New York Life Global Funding 4.55% 28/01/2033	36.647	0,03
USD	19.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	14.779	0,01	USD	33.000	New York Life Global Funding 4.85% 09/01/2028	33.517	0,03
USD	15.000	Georgia Power Company 5.13% 15/05/2052	14.710	0,01	USD	17.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	15.083	0,01
USD	19.000	Goodman USA Finance Five LLC 4.63% 04/05/2032	17.835	0,02	USD	25.000	NiSource Inc. 4.38% 15/05/2047	21.729	0,02
USD	26.000	Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	24.028	0,02	USD	125.000	NiSource Inc. 4.80% 15/02/2044	115.349	0,11
USD	25.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	22.130	0,02	USD	14.000	NiSource Inc. 5.00% 15/06/2052	13.347	0,01
USD	20.000	HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	20.444	0,02	USD	86.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	63.402	0,06
USD	14.000	Indiana Michigan Power Company 5.63% 01/04/2053	14.572	0,01	USD	8.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	5.961	0,01
USD	36.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	33.057	0,03	USD	28.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	29.143	0,03
USD	24.000	Intel Corp. 5.13% 10/02/2030	24.437	0,02	USD	56.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	59.183	0,05
EUR	200.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	193.307	0,18	USD	30.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	32.944	0,03
EUR	116.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	107.667	0,10	USD	65.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	75.684	0,07
EUR	100.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	97.862	0,09	USD	44.000	Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	37.760	0,04
USD	47.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	39.380	0,04	USD	29.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	22.514	0,02
USD	40.000	JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	32.180	0,03	USD	29.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	22.462	0,02

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ÉTATS-UNIS (suite)					ÉTATS-UNIS (suite)				
USD	97.000	Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	80.119	0,07	USD	82.000	UnitedHealth Group Inc. 4.50% 15/04/2033	81.578	0,07
USD	20.000	Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	14.116	0,01	USD	34.000	UnitedHealth Group Inc. 4.95% 15/05/2062	33.125	0,03
USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	34.691	0,03	USD	60.000	UnitedHealth Group Inc. 5.30% 15/02/2030	63.319	0,06
USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	30.695	0,03	USD	20.000	UnitedHealth Group Inc. 6.05% 15/02/2063	22.785	0,02
USD	33.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	29.511	0,03	USD	101.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	96.091	0,09
USD	30.000	PPL Electric Utilities Corp. 5.00% 15/05/2033	30.647	0,03	USD	119.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	96.623	0,09
USD	56.000	Public Service Electric and Gas Company 4.65% 15/03/2033	56.306	0,05	USD	50.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.39% 15/03/2062	40.489	0,04
USD	28.000	RELX Capital Inc. 4.75% 20/05/2032	27.837	0,03	USD	50.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	44.421	0,04
USD	16.000	Republic Services Inc. 4.88% 01/04/2029	16.193	0,01			Total États-Unis	6.717.202	6,10
USD	30.000	San Diego Gas & Electric Company 3.32% 15/04/2050	22.199	0,02			Total Obligations	35.016.964	31,94
USD	17.000	San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	14.842	0,01	Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				
EUR	100.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	91.939	0,08	AUSTRALIE				
EUR	129.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	136.884	0,12	AUD	32.000	Australia (Govt of) 1.00% 21/12/2030	18.194	0,02
USD	22.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	18.283	0,02			Total Australie	18.194	0,02
USD	13.000	Southern California Gas Company 3.95% 15/02/2050	10.515	0,01	AUTRICHE				
USD	11.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.90% 15/09/2044	10.194	0,01	EUR	5.000	Austria (Govt of) 0.85% 30/06/2120	2.356	0,00
GBP	50.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	59.688	0,05	EUR	187.000	Austria (Govt of) 2.90% 20/02/2033	202.111	0,18
USD	23.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	20.286	0,02			Total Autriche	204.467	0,18
USD	42.000	T-Mobile USA Inc. 2.88% 15/02/2031	36.258	0,03	BELGIQUE				
USD	20.000	T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	14.426	0,01	EUR	18.000	Belgium (Govt of) 0.90% 22/06/2029	17.603	0,02
USD	26.000	T-Mobile USA Inc. 4.95% 15/03/2028	26.251	0,02			Total Belgique	17.603	0,02
USD	26.000	T-Mobile USA Inc. 5.05% 15/07/2033	26.141	0,02	CANADA				
USD	17.000	T-Mobile USA Inc. 5.80% 15/09/2062	17.625	0,02	CAD	52.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	36.254	0,03
USD	46.000	Toyota Motor Credit Corp. 4.63% 12/01/2028	46.578	0,04	CAD	240.000	Canada Housing Trust No 1 1.10% 15/03/2031	150.518	0,14

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)				Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)			
CANADA (suite)				MEXIQUE			
USD	80.000 Province of Ontario Canada 1.13% 07/10/2030	65.423	0,06	USD	1.268.000 Mexico (Govt of) 5.75% 12/10/2110	1.140.820	1,04
	Total Canada	252.195	0,23		Total Mexique	1.140.820	1,04
FRANCE				ESPAGNE			
EUR	100.000 Bpifrance SACA 2.88% 25/11/2029	107.378	0,10	EUR	45.000 Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2027	43.213	0,04
EUR	100.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	94.084	0,09	EUR	9.000 Spain (Govt of) 0.10% 30/04/2031	7.696	0,01
USD	200.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1.00% 21/10/2030	164.458	0,15	EUR	18.000 Spain (Govt of) 2.90% 31/10/2046	17.128	0,02
USD	200.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1.38% 20/01/2031	166.858	0,14		Total Espagne	68.037	0,07
EUR	100.000 Unedic Asseo 0.25% 16/07/2035	76.292	0,07				
	Total France	609.070	0,55	SUPRANATIONALES			
ALLEMAGNE				USD	80.000 Asian Development Bank 0.75% 08/10/2030	64.687	0,06
EUR	482.000 Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	481.341	0,44	GBP	49.000 Asian Infrastructure Investment BankThe 4.38% 11/06/2026	60.588	0,06
EUR	179.000 Germany (Govt of) 0.00% 15/02/2032	159.658	0,15	USD	25.000 European Investment Bank 0.63% 21/10/2027	21.792	0,02
EUR	24.000 Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2052	13.426	0,01	USD	25.000 European Investment Bank 1.63% 13/05/2031	21.628	0,02
	Total Allemagne	654.425	0,60	USD	40.000 Inter-American Development Bank 1.13% 13/01/2031	33.133	0,03
ITALIE				GBP	72.000 Inter-American Development Bank 2.13% 15/12/2028	80.849	0,07
USD	200.000 Italy (Govt of) 1.25% 17/02/2026	179.083	0,16	EUR	18.000 International Bank for Reconstruction & Development 0.20% 21/01/2061	7.116	0,01
EUR	12.000 Italy (Govt of) 2.45% 01/09/2033	11.246	0,01	USD	135.000 International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	126.591	0,12
EUR	3.000 Italy (Govt of) 4.00% 30/04/2035	3.188	0,00	USD	80.000 International Bank for Reconstruction & Development 0.88% 14/05/2030	65.822	0,06
	Total Italie	193.517	0,17	AUD	70.000 International Finance Corp. 1.50% 15/04/2035	33.468	0,03
JAPON				USD	200.000 New Development Bank 0.63% 29/09/2025	181.841	0,16
JPY	13.950.000 Japan (Govt of) Forty Year Bond 0.40% 20/03/2056	79.649	0,07		Total Supranationales	697.515	0,64
JPY	4.150.000 Japan (Govt of) Forty Year Bond 0.50% 20/03/2059	23.954	0,02	ROYAUME-UNI			
JPY	800.000 Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	4.891	0,00	GBP	300.000 United Kingdom Gilt 0.63% 31/07/2035	260.478	0,24
JPY	1.300.000 Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.60% 20/09/2050	8.267	0,01	GBP	161.000 United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	153.469	0,14
JPY	2.200.000 Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.70% 20/12/2051	14.277	0,01				
	Total Japon	131.038	0,11				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)					Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)				
ROYAUME-UNI (suite)					ÉTATS-UNIS (suite)				
GBP	3.000	United Kingdom Gilt 1.13% 31/01/2039	2.527	0,00	USD	2.600.000	United States Treasury N/B 3.88% 15/02/2043	2.625.594	2,41
GBP	40.000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/10/2041	32.662	0,03	USD	16.000	United States Treasury N/B 4.00% 31/10/2029	16.388	0,01
GBP	770.000	United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051	533.424	0,49	Total États-Unis				
GBP	4.000	United Kingdom Gilt 1.75% 07/09/2037	3.847	0,00	9.076.713				
GBP	55.000	United Kingdom Gilt 4.13% 29/01/2027	68.943	0,06	8,31				
GBP	1.700.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.15% 22/03/2051	2.386.798	2,18	Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				
Total Royaume-Uni					16.505.742				
3.442.148					15,08				
3,14					Actions				
ÉTATS-UNIS					AUSTRALIE				
USD	421.000	United States Treasury N/B 0.13% 15/07/2023	415.672	0,38	14.482	ANZ Group Holdings Limited	222.405	0,20	
USD	60.000	United States Treasury N/B 0.13% 31/07/2023	59.123	0,05	9.474	Coles Group Limited	114.341	0,10	
USD	40.000	United States Treasury N/B 0.50% 31/10/2027	34.719	0,03	59.546	Deterra Royalties Limited	191.428	0,17	
USD	618.000	United States Treasury N/B 0.63% 15/08/2030	503.718	0,46	19.638	Dexus	98.776	0,09	
USD	19.000	United States Treasury N/B 0.75% 31/01/2028	16.604	0,02	1.662	Macquarie Group Limited	195.531	0,18	
USD	145.000	United States Treasury N/B 1.00% 31/07/2028	126.750	0,12	3.430	Mineral Resources Limited	185.135	0,17	
USD	540.100	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	357.605	0,33	37.205	Santos Limited	171.935	0,16	
USD	17.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	9.893	0,01	11.870	Telstra Corp. Limited	33.549	0,03	
USD	95.000	United States Treasury N/B 1.38% 15/11/2040	65.535	0,06	26.697	Transurban Group	254.079	0,23	
USD	17.000	United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2032	14.925	0,01	Total Australie				
USD	47.600	United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2051	32.528	0,03	1.467.179				
USD	3.000	United States Treasury N/B 1.88% 15/11/2051	2.044	0,00	1,33				
USD	24.000	United States Treasury N/B 2.38% 31/03/2029	22.416	0,02	BELGIQUE				
USD	1.913.200	United States Treasury N/B 3.00% 15/08/2052	1.680.477	1,53	1.740	KBC Group NV	119.664	0,11	
USD	43.000	United States Treasury N/B 3.25% 30/06/2029	42.170	0,04	565	Melexis NV	65.313	0,06	
USD	3.245.000	United States Treasury N/B 3.38% 15/08/2042	3.050.552	2,80	Total Belgique				
					184.977				
					0,17				
					CANADA				
					403	Canadian National Railway Company	47.487	0,04	
					1.729	Suncor Energy Inc.	53.607	0,05	
					Total Canada				
					101.094				
					0,09				
					ÎLES CAÏMANS				
					36.000	China Mengniu Dairy Company Limited	147.670	0,14	
					48.000	China Resources Land Limited	218.905	0,20	
					5.050	JD.com Inc.	110.650	0,10	
					416	NetEase Inc. - ADR	36.791	0,03	
					9.755	NetEase Inc.	171.490	0,16	
					5.000	Parade Technologies Limited	172.426	0,16	
					Total Îles Caïmans				
					857.932				
					0,79				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions (suite)				Actions (suite)				
CHINE				ALLEMAGNE (suite)				
126.800	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	115.218	0,11	1.550	Siemens Healthineers AG	89.286	0,08	
395.000	China Construction Bank Corp.	256.122	0,23	Total Allemagne				
20.000	China Merchants Bank Company Limited - H	102.166	0,09	1.023.009 0,93				
28.500	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	120.851	0,12	GUERNESEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES				
39.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	253.874	0,23	28.524	Sherborne Investors Guernsey C Limited	18.516	0,02	
5.400	Wuliangye Yibin Company Limited - A	154.908	0,14	Total Guernesey - Îles Anglo-Normandes				
Total Chine			1.003.139	0,92	18.516 0,02			
DANEMARK				HONG KONG				
4.519	Tryg A/S	98.796	0,09	36.600	AIA Group Limited	385.350	0,35	
Total Danemark			98.796	0,09	56.000	BOC Hong Kong Holdings Limited	174.421	0,16
FINLANDE				29.000	Galaxy Entertainment Group Limited	193.765	0,18	
666	Upm-Kymmene Oyj	22.395	0,02	136.000	Guangdong Investment Limited	139.119	0,12	
Total Finlande			22.395	0,02	5.100	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	226.220	0,21
FRANCE				68.000	Lenovo Group Limited	73.631	0,07	
790	Air Liquide SA	132.349	0,12	14.000	Sun Hung Kai Properties Limited	196.179	0,18	
7.059	AXA SA	216.004	0,20	62.000	Xinyi Glass Holdings Limited	111.048	0,10	
2.863	BNP Paribas SA	171.731	0,16	Total Hong Kong				
1.494	Compagnie de Saint-Gobain	84.924	0,08	1.499.733 1,37				
184	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	168.801	0,15	INDE				
578	Pernod-Ricard SA	131.057	0,12	43.751	Embassy Office Parks REIT	166.188	0,15	
1.045	Sanofi	113.807	0,10	9.856	HDFC Bank Limited	193.030	0,18	
1.070	Schneider Electric SE	178.653	0,17	18.774	Hindalco Industries Limited	92.599	0,08	
3.719	TotalEnergies SE	219.642	0,20	15.206	Infosys Limited	264.209	0,24	
1.350	Vinci SA	155.060	0,14	58.688	Power Grid Corp. of India Limited	161.176	0,15	
Total France			1.572.028	1,44	Total Inde			
ALLEMAGNE				877.202 0,80				
1.679	Brenntag SE	126.231	0,12	INDONÉSIE				
2.236	Daimler Truck Holding AG	75.576	0,07	247.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	154.017	0,14	
6.530	Deutsche Telekom AG - Reg	158.562	0,14	669.221	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	211.102	0,19	
3.779	E.ON SE	47.215	0,04	Total Indonésie				
1.575	Evonik Industries AG	33.128	0,03	365.119 0,33				
902	Mercedes-Benz Group AG - Reg	69.363	0,06	IRLANDE				
1.450	SAP SE	182.835	0,17	10.032	Bank of Ireland Group plc	101.625	0,09	
1.485	Siemens AG - Reg	240.813	0,22	3.601	CRH plc	181.824	0,16	
				5.356	Eaton Corp. plc	917.697	0,83	

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)			Actions (suite)		
IRLANDE (suite)			PHILIPPINES		
1.985 Experian plc	65.286	0,06	74.150 BDO Unibank Inc.	175.263	0,16
4.926 Johnson Controls International plc	296.644	0,27	Total Philippines	175.263	0,16
149 Linde plc	52.961	0,05	RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)		
7.743 Medtronic plc	624.241	0,56	3.048 Kia Corp.	189.644	0,18
3.031 Trinseo plc	63.196	0,06	701 LG Chem Limited	167.194	0,14
Total Irlande	2.303.474	2,08	1.634 Samsung Electronics Company Limited	80.329	0,07
ITALIE			9.971 Samsung Electronics Company Limited Pfd	412.827	0,38
28.347 Enel SpA	173.298	0,16	4.517 SK Telecom Company Limited	167.586	0,15
14.133 Nexi SpA	114.946	0,10	Total République de Corée (du Sud)	1.017.580	0,92
Total Italie	288.244	0,26	SINGAPOUR		
JAPON			136.800 CapitaLand Integrated Commercial Trust	203.726	0,19
400 Rohm Company Limited	32.970	0,03	2.600 Jardine Cycle & Carriage Limited	61.170	0,06
100 SMC Corp.	52.468	0,05	26.800 Keppel Corp. Limited	113.485	0,10
300 Tokyo Electron Limited	36.156	0,03	8.000 United Overseas Bank Limited	179.068	0,16
15.200 Z Holdings Corp.	42.577	0,04	Total Singapour	557.449	0,51
Total Japon	164.171	0,15	ESPAGNE		
JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES			9.245 Iberdrola SA	115.358	0,11
12.533 WPP plc	148.549	0,14	5.765 Inditex SA	193.539	0,18
Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	148.549	0,14	Total Espagne	308.897	0,29
MALAISIE			SUÈDE		
99.100 CIMB Group Holdings Bhd	119.257	0,11	6.226 Sandvik AB	131.970	0,12
Total Malaisie	119.257	0,11	Total Suède	131.970	0,12
PAYS-BAS			SUISSE		
533 Akzo Nobel NV	41.682	0,04	946 Nestle SA - Reg	115.419	0,11
366 ASM International NV	147.883	0,14	621 Novartis AG - Reg	56.937	0,05
1.754 BE Semiconductor Industries NV	152.641	0,14	92 Partners Group Holding AG - Reg	86.285	0,08
26.723 Royal KPN NV	94.532	0,09	391 Roche Holding AG	111.687	0,10
Total Pays-Bas	436.738	0,41	3.484 TE Connectivity Limited	456.926	0,42
NORVÈGE			Total Suisse	827.254	0,76
1.368 Equinor ASA	39.016	0,04	TAÏWAN		
Total Norvège	39.016	0,04	21.850 Chailease Holding Company Limited	160.388	0,15

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)			Actions (suite)		
ÉTATS-UNIS (suite)			ÉTATS-UNIS (suite)		
124 Elevance Health Inc.	57.016	0,05	4.077 Voya Financial Inc.	291.342	0,27
2.264 Eli Lilly & Company	777.502	0,71	2.678 Warner Bros Discovery Inc.	40.438	0,04
5.077 Equity Lifestyle Properties Inc.	340.819	0,31	6.526 Xcel Energy Inc.	440.113	0,40
8.843 Exxon Mobil Corp.	969.723	0,88	Total États-Unis	28.055.054	25,64
20.376 Gen Digital Inc.	349.652	0,32	Total Actions	49.250.107	44,97
1.615 General Motors Company	59.238	0,05	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	100.772.813	91,99
878 Goldman Sachs Group Inc.	287.203	0,26	Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises		
2.296 Hess Corp.	303.853	0,28	Obligations		
703 IntercontinentalExchange Inc.	73.316	0,07	ÉTATS-UNIS		
2.421 JPMorgan Chase & Company	315.481	0,29	USD 23.000 Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	19.442	0,02
2.347 KLA Corp.	936.852	0,85	USD 67.000 Broadcom Inc. 4.93% 15/05/2037	61.045	0,06
7.455 Kontoor Brands Inc.	360.748	0,33	USD 119.000 Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	104.343	0,10
2.258 Lamb Weston Holding Inc.	236.006	0,22	USD 100.000 GE HealthCare Technologies Inc. 5.86% 15/03/2030	104.742	0,10
1.518 Lowe's Companies Inc.	303.554	0,28	USD 34.000 HCA Inc. 3.63% 15/03/2032	29.992	0,03
243 Marsh & McLennan Companies Inc.	40.472	0,04	USD 25.000 Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	28.068	0,03
867 Mastercard Inc. - A	315.076	0,29	USD 30.000 Verizon Communications Inc. 2.36% 15/03/2032	24.661	0,02
163 McDonald's Corp.	45.576	0,04	Total États-Unis	372.293	0,36
7.458 Merck & Company Inc.	793.456	0,73	Total Obligations	372.293	0,36
8.724 Metlife Inc.	505.469	0,46	Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance		
7.303 Microsoft Corp.	2.105.455	1,92	CHINE		
5.151 Moelis & Company - A	198.004	0,18	CNY 470.000 China (Govt of) 2.85% 04/06/2027	69.147	0,06
6.619 Morgan Stanley	581.149	0,54	CNY 2.550.000 China (Govt of) 3.02% 27/05/2031	375.880	0,34
3.403 Northern Trust Corp.	299.906	0,27	Total Chine	445.027	0,40
2.907 PepsiCo Inc.	529.947	0,49			
8.160 Philip Morris International Inc.	793.560	0,73			
352 PNC Financial Services Group Inc.	44.739	0,04			
6.260 Procter & Gamble Company	930.800	0,84			
5.319 Prologis Inc.	663.651	0,61			
222 QUALCOMM Inc.	28.323	0,03			
318 Quest Diagnostics Inc.	44.991	0,04			
6.485 Raytheon Technologies Corp.	635.076	0,58			
4.711 Republic Services Inc.	637.021	0,58			
5.257 Starbucks Corp.	547.411	0,50			
825 State Street Corp.	62.444	0,06			
1.950 Target Corp.	322.979	0,29			
3.372 Texas Instruments Inc.	627.226	0,57			
7.029 TJX Companies Inc.	550.792	0,51			
3.216 Union Pacific Corp.	647.252	0,59			
4.129 United Parcel Service Inc.	800.985	0,74			
3.100 Valero Energy Corp.	432.760	0,39			
5.009 Verizon Communications Inc.	194.800	0,18			
18.332 Vici Properties Inc.	597.990	0,55			
3.000 Virtu Financial Inc.	56.700	0,05			

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises (suite)			Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire (suite)				
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance (suite)			Obligations (suite)				
ÉTATS-UNIS			ROYAUME-UNI				
USD 139.000	Federal National Mortgage Association 5.63% 15/07/2037	162.227	0,15	GBP 235.000	Bellis Acquisition Company plc 3.25% 16/02/2026	238.974	0,23
				GBP 205.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	237.845	0,22
	Total États-Unis	162.227	0,15		Total Royaume-Uni	476.819	0,45
	Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance	607.254	0,55		ÉTATS-UNIS		
	Obligations - convertibles			USD 75.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	63.345	0,06
	CANADA				Total États-Unis	63.345	0,06
USD 121.000	Air Canada 4.00% 01/07/2025	143.012	0,13		Total Obligations	721.026	0,67
	Total Canada	143.012	0,13		Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	721.026	0,67
	Total Obligations - convertibles	143.012	0,13		Autres organismes de placement collectif		
	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises	1.122.559	1,04		Fonds		
	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				ROYAUME-UNI		
	Obligations			66.280	CT Emerging Market Local Fund***	189.634	0,17
	AUSTRALIE				Total Royaume-Uni	189.634	0,17
USD 35.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	33.891	0,03		Total Fonds	189.634	0,17
	Total Australie	33.891	0,03		Total Autres organismes de placement collectif	189.634	0,17
	BERMUDES				Valeur totale des investissements	102.806.032	93,87
USD 100.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	99.392	0,09		(Coût total : 101.827.337 USD)		
	Total Bermudes	99.392	0,09				
	CANADA						
CAD 50.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	35.628	0,03				
	Total Canada	35.628	0,03				
	PORTUGAL						
EUR 100.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	11.951	0,01				
	Total Portugal	11.951	0,01				

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

**Titre à la juste valeur.

***Fonds de sociétés apparentées.

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
BRÉSIL			GRÈCE (suite)		
22.644 B3 SA Brasil Bolsa Balcao	46.224	0,90	1.314 Jumbo SA	27.838	0,54
16.145 Itau Unibanco Holding SA - ADR	78.626	1,53	Total Grèce	64.159	1,25
11.218 Localiza Rent a Car SA	118.148	2,30	HONG KONG		
12.019 Sendas Distribuidora SA	36.838	0,72	2.400 AIA Group Limited	25.269	0,49
7.406 Weg SA	59.230	1,15	700 Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	31.050	0,60
Total Brésil	339.066	6,60	976 Techtronic Industries Company	10.550	0,21
ÎLES CAÏMANS			Total Hong Kong	66.869	1,30
535 Afya Limited	5.971	0,12	INDE		
2.216 JD.com Inc. - ADR	97.260	1,89	2.063 Apollo Hospitals Enterprise Limited	108.215	2,11
4.286 JD.com Inc.	93.910	1,83	2.270 Astral Limited	36.930	0,72
10.088 Kingdee International Software Group Company Limited	16.346	0,32	7.749 AU Small Finance Bank Limited	54.613	1,06
10.110 Meituan	184.814	3,60	7.594 Cholamandalam Investment and Finance Company Limited	70.347	1,37
915 PDD Holdings Inc.	69.449	1,35	2.637 HDFC Bank Limited - ADR	175.809	3,42
2.400 Shenzhou International Group Holdings Limited	25.192	0,49	7.647 ICICI Bank Limited - ADR	165.022	3,21
7.100 Tencent Holdings Limited	348.941	6,80	2.813 Infosys Limited - ADR	49.059	0,95
3.000 Wuxi Biologics Cayman Inc.	18.573	0,36	17.328 Max Healthcare Institute Limited	93.005	1,81
Total Îles Caïmans	860.456	16,76	2.697 Reliance Industries Limited	76.498	1,49
CHINE			Total Inde	829.498	16,14
1.138 Bafang Electric Suzhou Company Limited	17.546	0,34	INDONÉSIE		
34.200 Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	145.022	2,82	109.700 Bank BTPN Syariah Tbk PT	16.022	0,31
11.300 Midea Group Company Limited - A	88.543	1,72	267.200 Bank Central Asia Tbk PT	155.921	3,04
2.400 Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	108.937	2,12	649.036 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	204.735	3,99
35.800 Songcheng Performance Development Company Limited	84.818	1,65	Total Indonésie	376.678	7,34
20.900 Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	78.368	1,53	JERSEY - ÎLES ANGLONORMANDES		
Total Chine	523.234	10,18	414 WNS Holdings Limited - ADR	38.572	0,75
CHYPRE			Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	38.572	0,75
1.129 Ozon Holdings plc**	0	0,00	KAZAKHSTAN		
545 TCS Group Holding plc - Reg**	0	0,00	625 Kaspi.KZ JSC	47.188	0,92
Total Chypre	0	0,00	Total Kazakhstan	47.188	0,92
GRÈCE			LUXEMBOURG		
27.470 Eurobank Ergasias Services and Holdings SA	36.321	0,71	196 Globant SA	32.146	0,63
			Total Luxembourg	32.146	0,63

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)			Actions (suite)		
MEXIQUE			ÎLES VIERGES (BRITANNIQUES)		
10.905 Grupo Financiero Banorte SAB de CV	91.740	1,79	12.165 Fix Price Group Limited**	0	0,00
21.245 Wal-Mart de Mexico SAB de CV	84.751	1,65	Total Îles Vierges (Britanniques)	0	0,00
Total Mexique	176.491	3,44	Total Actions	4.832.155	94,08
RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)			Droits		
742 Hana Financial Group Inc.	23.197	0,45	BRÉSIL		
64 Samsung Biologics Company Limited	38.739	0,75	50 Localiza Rent a Car SA Right	129	0,00
602 Samsung Electro-Mechanics Company Limited	70.612	1,37	Total Brésil	129	0,00
5.697 Samsung Electronics Company Limited	280.070	5,45	Total des droits	129	0,00
189 Samsung Sdi Company Limited	106.706	2,08	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	4.832.284	94,08
979 SK Hynix Inc.	66.628	1,30	Valeur totale des investissements	4.832.284	94,08
Total République de Corée (du Sud)	585.952	11,40	(Coût total : 5.440.926 USD)		
AFRIQUE DU SUD			<i>*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.</i>		
4.303 Absa Group Limited	44.086	0,86	<i>**Titre à la juste valeur.</i>		
807 Capitec Bank Holdings Limited	76.763	1,50			
6.081 Shoprite Holdings Limited	76.177	1,48			
Total Afrique du Sud	197.026	3,84			
TAÏWAN					
6.475 Advantech Company Limited	78.896	1,54			
11.000 Delta Electronics Inc.	108.743	2,12			
4.094 Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	380.824	7,41			
Total Taïwan	568.463	11,07			
THAÏLANDE					
12.200 Kasikornbank pcl	47.273	0,92			
Total Thaïlande	47.273	0,92			
ÉTATS-UNIS					
60 Mercadolibre Inc.	79.084	1,54			
Total États-Unis	79.084	1,54			

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
CANADA			JAPON (suite)		
268.384 Waste Connections Inc.	37.324.163	2,00	213.600 Sony Group Corp.	19.235.068	1,03
Total Canada	37.324.163	2,00	Total Japon	152.061.151	8,17
DANEMARK			SINGAPOUR		
118.512 Novo Nordisk AS	18.767.511	1,01	682.200 DBS Group Holdings Limited	16.932.492	0,91
Total Danemark	18.767.511	1,01	Total Singapour	16.932.492	0,91
FRANCE			SUISSE		
306.535 Legrand SA	28.001.579	1,50	127.417 Lonza Group AG - Reg	76.348.395	4,10
65.362 L'Oreal SA	29.203.909	1,57	302.050 Nestle SA - Reg	36.852.386	1,98
42.113 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	38.634.398	2,08	Total Suisse	113.200.781	6,08
350.276 Schneider Electric SE	58.484.055	3,15	TAIWAN		
Total France	154.323.941	8,30	2.432.000 Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	42.572.936	2,29
HONG KONG			Total Taïwan	42.572.936	2,29
2.430.800 AIA Group Limited	25.593.166	1,37	ROYAUME-UNI		
Total Hong Kong	25.593.166	1,37	741.930 Compass Group plc	18.649.916	1,00
INDE			975.319 Diageo plc	43.582.425	2,34
4.490.784 HDFC Bank Limited	87.952.024	4,73	Total Royaume-Uni	62.232.341	3,34
1.711.474 Kotak Mahindra Bank Limited	36.086.975	1,94	ÉTATS-UNIS		
Total Inde	124.038.999	6,67	405.255 Alphabet Inc. - A	42.037.101	2,26
INDONÉSIE			233.762 Amphenol Corp.	19.103.031	1,03
33.630.700 Bank Central Asia Tbk PT	19.624.775	1,05	687.569 Coca Cola Company	42.649.905	2,29
60.469.600 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	19.074.754	1,02	37.214 Costco Wholesale Corp.	18.490.520	0,99
Total Indonésie	38.699.529	2,07	136.062 Danaher Corp.	34.293.066	1,84
IRLANDE			80.078 Elevance Health Inc.	36.820.665	1,98
266.775 Linde plc	94.822.506	5,09	81.037 Eli Lilly & Company	27.829.727	1,49
Total Irlande	94.822.506	5,09	66.411 Hess Corp.	8.788.832	0,47
JAPON			169.066 Hilton Worldwide Holdings Inc.	23.816.327	1,28
215.400 Hoya Corp.	23.564.677	1,27	309.475 IntercontinentalExchange Inc.	32.275.148	1,73
115.612 Keyence Corp.	55.986.106	3,01	111.604 Intuit Inc.	49.756.411	2,67
1.160.100 Recruit Holdings Company Limited	31.815.791	1,71	93.759 Lam Research Corp.	49.703.521	2,67
40.900 SMC Corp.	21.459.509	1,15	222.910 Marsh & McLennan Companies Inc.	37.125.661	2,00
			439.719 Marvell Technology Inc.	19.039.833	1,02
			274.086 Mastercard Inc. - A	99.605.593	5,36
			12.708 Mettler-Toledo International Inc.	19.445.909	1,04
			539.239 Microsoft Corp.	155.462.603	8,36

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)		
ÉTATS-UNIS (suite)		
89.886 NVIDIA Corp.	24.967.634	1,34
244.156 ON Semiconductor Corp.	20.098.922	1,08
144.850 QUALCOMM Inc.	18.479.963	0,99
129.149 Thermo Fisher Scientific Inc.	74.437.609	4,00
223.821 T-Mobile USA Inc.	32.418.234	1,74
88.015 Union Pacific Corp.	17.713.899	0,95
212.107 Zoetis Inc.	35.303.089	1,90
Total États-Unis	939.663.203	50,48
Total Actions	1.820.232.719	97,78
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	1.820.232.719	97,78
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Fonds		
IRLANDE		
33.597.075 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	33.597.075	1,80
Total Irlande	33.597.075	1,80
Total Fonds	33.597.075	1,80
Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	33.597.075	1,80
Valeur totale des investissements	1.853.829.794	99,58

(Coût total : 1.698.866.084 USD)

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			
Actions				Actions (suite)			
BRÉSIL				CHINE (suite)			
1.562.294	B3 SA Brasil Bolsa Balcao	3.189.142	0,90	490.000	Midea Group Company Limited - A	3.839.495	1,09
542.341	Banco BTG Pactual SA	2.101.870	0,59	113.500	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	5.151.832	1,46
149.691	Banco do Brasil SA	1.154.660	0,33	1.853.200	Songcheng Performance Development Company Limited	4.390.610	1,24
1.112.908	Itau Unibanco Holding SA - ADR	5.419.862	1,53	959.400	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	3.597.427	1,02
541.534	Localiza Rent a Car SA	5.703.452	1,61		Total Chine	34.223.042	9,68
747.199	Petro Rio SA	4.596.449	1,30				
1.122.219	Sendas Distribuidora SA	3.439.532	0,97				
244.783	Weg SA	1.957.685	0,55				
	Total Brésil	27.562.652	7,78				
CANADA				CHYPRE			
177.889	Parex Resources Inc.	3.304.488	0,93	31.029	Ozon Holdings plc**	0	0,00
	Total Canada	3.304.488	0,93	12.232	TCS Group Holding plc - Reg**	0	0,00
					Total Chypre	0	0,00
ÎLES CAÏMANS				GRÈCE			
19.390	Afya Limited	216.392	0,06	1.570.968	Eurobank Ergasias Services and Holdings SA	2.077.149	0,59
305.030	Full Truck Alliance Company Limited	2.321.278	0,66	467.973	National Bank of Greece SA	2.272.679	0,64
120.857	JD.com Inc.	2.648.087	0,75		Total Grèce	4.349.828	1,23
156.512	JD.com Inc. - ADR	6.869.312	1,94				
857.000	Kingdee International Software Group Company Limited	1.388.673	0,39	HONG KONG			
239.800	Kuaishou Technology	1.846.619	0,52	174.400	AIA Group Limited	1.836.205	0,52
751.000	Li Ning Company Limited	5.921.921	1,67	34.500	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.530.311	0,43
539.720	Meituan	9.866.255	2,79	77.500	Techtronic Industries Company	837.694	0,24
445.470	NetEase Inc.	7.831.221	2,21		Total Hong Kong	4.204.210	1,19
64.285	PDD Holdings Inc.	4.879.232	1,38				
171.600	Shenzhou International Group Holdings Limited	1.801.260	0,51	INDE			
499.700	Tencent Holdings Limited	24.558.593	6,94	96.264	Apollo Hospitals Enterprise Limited	5.049.531	1,43
224.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	1.386.808	0,39	326.704	AU Small Finance Bank Limited	2.302.514	0,65
	Total Îles Caïmans	71.535.651	20,21	492.572	Cholamandalam Investment and Finance Company Limited	4.562.940	1,30
CHINE				92.540	Eicher Motors Limited	3.320.484	0,94
264.400	Alibaba Group Holding Limited	3.381.638	0,96	193.900	HDFC Bank Limited - ADR	12.927.312	3,65
51.454	Bafang Electric Suzhou Company Limited	793.320	0,22	569.062	ICICI Bank Limited - ADR	12.280.357	3,47
332.200	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Company Limited - A	1.619.572	0,46	242.183	Larsen & Toubro Limited	6.377.644	1,80
188.800	China Tourism Group Duty Free Corp. Limited	5.037.758	1,42	230.626	Mahindra & Mahindra Limited	3.251.610	0,92
74.700	Eastroc Beverage Group Company Limited	2.092.971	0,59	185.522	Reliance Industries Limited	5.262.186	1,49
1.018.400	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	4.318.419	1,22		Total Inde	55.334.578	15,65
				INDONÉSIE			
				9.280.100	Astra International Tbk PT	3.713.339	1,05
				15.389.200	Bank BTPN Syariah Tbk PT	2.247.610	0,64

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

État du Portefeuille

(suite)

Quantité	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			
Actions (suite)				Actions (suite)			
INDONÉSIE (suite)				POLOGNE			
16.867.300	Bank Central Asia Tbk PT	9.842.702	2,78	37.219	Dino Polska SA	3.378.878	0,96
32.437.166	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	10.232.100	2,89	Total Pologne			
Total Indonésie		26.035.751	7,36	3.378.878 0,96			
JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES				RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)			
19.385	WNS Holdings Limited - ADR	1.806.100	0,51	52.283	Hana Financial Group Inc.	1.634.539	0,46
Total Jersey - Îles Anglo-Normandes		1.806.100	0,51	2.938	Samsung Biologics Company Limited	1.778.355	0,50
KAZAKHSTAN				41.984	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	4.924.512	1,39
21.388	Kaspi.KZ JSC	1.614.794	0,46	414.441	Samsung Electronics Company Limited	20.374.317	5,76
Total Kazakhstan		1.614.794	0,46	8.394	Samsung Sdi Company Limited	4.739.109	1,34
LUXEMBOURG				69.138	SK Hynix Inc.	4.705.339	1,33
13.715	Globant SA	2.249.398	0,64	Total République de Corée (du Sud)			
Total Luxembourg		2.249.398	0,64	38.156.171 10,78			
MALAISIE				AFRIQUE DU SUD			
1.228.000	Public Bank Bhd	1.113.202	0,31	303.032	Absa Group Limited	3.104.710	0,88
Total Malaisie		1.113.202	0,31	32.605	Capitec Bank Holdings Limited	3.101.439	0,88
MEXIQUE				188.911	Shoprite Holdings Limited	2.366.492	0,67
119.381	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV - B	2.318.120	0,66	Total Afrique du Sud			
778.964	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	6.553.173	1,85	8.572.641 2,43			
1.093.027	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	4.360.344	1,23	TAÏWAN			
Total Mexique		13.231.637	3,74	443.000	Delta Electronics Inc.	4.379.384	1,24
PAYS-BAS				287.770	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	26.768.366	7,57
33.179	Yandex NV - A**	0	0,00	Total Taïwan			
Total Pays-Bas		0	0,00	31.147.750 8,81			
PHILIPPINES				THAÏLANDE			
2.364.500	Ayala Land Inc.	1.152.554	0,33	845.900	Kasikornbank plc	3.277.719	0,93
695.860	BDO Unibank Inc.	1.644.755	0,47	Total Thaïlande			
Total Philippines		2.797.309	0,80	3.277.719 0,93			
ÉTATS-UNIS				ÎLES VIERGES (BRITANNIQUES)			
Total États-Unis				Total Îles Vierges (Britanniques)			
8.221.810 2,33				0 0,00			
Total Actions				342.117.609 96,73			

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Droits		
BRÉSIL		
2.423 Localiza Rent a Car SA Right	6.275	0,00
Total Brésil	6.275	0,00
Total des droits	6.275	0,00
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	342.123.884	96,73
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		
Actions		
FÉDÉRATION DE RUSSIE		
597.602 Detsky Mir PJSC**	0	0,00
Total Fédération de Russie	0	0,00
Total Actions	0	0,00
Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	0	0,00
Valeur totale des investissements	342.123.884	96,73
(Coût total : 349.263.838 USD)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

**Titre à la juste valeur.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions			Actions (suite)				
AUSTRALIE			HONG KONG (suite)				
597.016	Telstra Corp. Limited	1.687.373	1,00	39.900	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.769.838	1,05
	Total Australie	1.687.373	1,00		Total Hong Kong	4.374.638	2,59
CANADA			IRLANDE				
19.709	Canadian National Railway Company	2.322.380	1,38	29.585	CRH plc	1.493.828	0,89
87.953	Suncor Energy Inc.	2.726.942	1,62	100.895	Experian plc	3.318.393	1,97
	Total Canada	5.049.322	3,00	7.593	Linde plc	2.698.856	1,60
				30.886	Medtronic plc	2.490.029	1,48
					Total Irlande	10.001.106	5,94
ÎLES CAÏMANS			JAPON				
20.487	NetEase Inc. - ADR	1.811.870	1,08	20.200	Rohm Company Limited	1.664.993	0,99
	Total Îles Caïmans	1.811.870	1,08	4.400	SMC Corp.	2.308.602	1,37
CHINE				8.100	Tokyo Electron Limited	976.211	0,58
278.292	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.811.563	1,08	755.600	Z Holdings Corp.	2.116.520	1,26
	Total Chine	1.811.563	1,08		Total Japon	7.066.326	4,20
DANEMARK			JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES				
54.473	Tryg A/S	1.190.906	0,71	86.397	WPP plc	1.024.030	0,61
	Total Danemark	1.190.906	0,71		Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	1.024.030	0,61
FRANCE			PAYS-BAS				
41.692	AXA SA	1.275.770	0,76	26.662	Akzo Nobel NV	2.085.040	1,24
47.507	BNP Paribas SA	2.849.608	1,69		Total Pays-Bas	2.085.040	1,24
2.469	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	2.265.057	1,35	NORVÈGE			
13.968	Schneider Electric SE	2.332.176	1,38	56.796	Equinor ASA	1.619.866	0,96
65.533	TotalEnergies SE	3.870.341	2,30		Total Norvège	1.619.866	0,96
	Total France	12.592.952	7,48	RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)			
ALLEMAGNE				86.399	Samsung Electronics Company Limiteda	4.247.458	2,51
157.154	Deutsche Telekom AG - Reg	3.816.039	2,27		Total République de Corée (du Sud)	4.247.458	2,51
197.536	E.ON SE	2.468.049	1,47	ESPAGNE			
80.910	Evonik Industries AG	1.701.834	1,01	62.297	Inditex SA	2.091.392	1,24
25.452	SAP SE	3.209.329	1,91		Total Espagne	2.091.392	1,24
25.715	Siemens AG - Reg	4.170.035	2,48	SUÈDE			
	Total Allemagne	15.365.286	9,14	77.692	Sandvik AB	1.646.809	0,98
HONG KONG					Total Suède	1.646.809	0,98
247.400	AIA Group Limited	2.604.800	1,54				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

État du Portefeuille

(suite)

Quantité	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			
Actions (suite)				Actions (suite)			
SUISSE				ÉTATS-UNIS (suite)			
31.223	Novartis AG - Reg	2.862.721	1,70	42.171	State Street Corp.	3.191.923	1,89
9.144	TE Connectivity Limited	1.199.236	0,71	9.772	Target Corp.	1.618.536	0,96
	Total Suisse	4.061.957	2,41	9.532	United Parcel Service Inc.	1.849.113	1,10
				42.343	Xcel Energy Inc.	2.855.612	1,69
					Total États-Unis	64.436.308	38,27
TAIWAN				Total Actions			
62.000	MediaTek Inc.	1.602.541	0,95			165.565.286	98,32
215.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.763.644	2,23	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			
	Total Taiwan	5.366.185	3,18			165.565.286	98,32
ROYAUME-UNI				Organismes de placement collectif en valeurs mobilières			
111.793	3i Group plc	2.329.116	1,38	Fonds			
92.606	Anglo American plc	3.066.382	1,82	IRLANDE			
1.624.999	BT Group plc	2.929.457	1,74	2.037.234	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.037.234	1,21
38.991	Diageo plc	1.742.325	1,03		Total Irlande	2.037.234	1,21
111.543	GSK plc	1.970.839	1,17	Total Fonds			
227.550	Haleon plc	905.961	0,54			2.037.234	1,21
43.415	Reckitt Benckiser Group plc	3.305.644	1,96	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières			
55.157	RELX plc	1.785.175	1,06			2.037.234	1,21
	Total Royaume-Uni	18.034.899	10,70	Valeur totale des investissements			
						167.602.520	99,53
ÉTATS-UNIS				(Coût total : 159.617.831 USD)			
20.813	AbbVie Inc.	3.316.968	1,97	<i>*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.</i>			
29.481	American Electric Power Company Inc.	2.682.476	1,59				
8.416	American Express Company	1.388.219	0,82				
11.064	Analog Devices Inc.	2.182.042	1,30				
49.338	Bristol-Myers Squibb Company	3.419.616	2,03				
39.764	Coca Cola Company	2.466.561	1,47				
57.093	Ebay Inc.	2.533.216	1,50				
6.301	Elevance Health Inc.	2.897.262	1,72				
7.942	Eli Lilly & Company	2.727.442	1,62				
81.635	General Motors Company	2.994.372	1,78				
35.525	IntercontinentalExchange Inc.	3.704.903	2,21				
12.434	Marsh & McLennan Companies Inc.	2.070.883	1,23				
8.326	McDonald's Corp.	2.328.033	1,39				
29.709	Microsoft Corp.	8.565.105	5,08				
13.481	PepsiCo Inc.	2.457.586	1,46				
15.581	PNC Financial Services Group Inc.	1.980.345	1,18				
23.003	Procter & Gamble Company	3.420.316	2,03				
11.294	QUALCOMM Inc.	1.440.889	0,86				
16.574	Quest Diagnostics Inc.	2.344.890	1,39				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Select

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions			Actions (suite)				
AUSTRALIE			IRLANDE (suite)				
27.541	CSL Limited	5.317.862	0,93	27.388	Linde plc	9.734.791	1,70
	Total Australie	5.317.862	0,93		Total Irlande	14.663.440	2,56
CANADA			JAPON				
64.965	Nutrien Limited	4.791.189	0,84	16.900	Keyence Corp.	8.183.971	1,43
	Total Canada	4.791.189	0,84	122.400	Recruit Holdings Company Limited	3.356.825	0,59
DANEMARK			63.900 Sony Group Corp.			5.754.311	1,00
43.410	Novo Nordisk AS	6.874.390	1,20		Total Japon	17.295.107	3,02
77.273	Orsted A/S	6.574.893	1,15	PAYS-BAS			
	Total Danemark	13.449.283	2,35	54.912	Akzo Nobel NV	4.294.265	0,75
FRANCE			37.663 Koninklijke DSM NV			4.447.892	0,78
192.403	AXA SA	5.887.506	1,03		Total Pays-Bas	8.742.157	1,53
32.403	EssilorLuxottica SA	5.843.904	1,02	NORVÈGE			
17.196	L'Oreal SA	7.683.217	1,34	238.971	Equinor ASA	6.815.637	1,19
6.914	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	6.342.893	1,11		Total Norvège	6.815.637	1,19
50.484	Schneider Electric SE	8.429.093	1,47	RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)			
290.809	TotalEnergies SE	17.175.012	2,99	12.736	Samsung Sdi Company Limited	7.190.528	1,26
	Total France	51.361.625	8,96		Total République de Corée (du Sud)	7.190.528	1,26
ALLEMAGNE			SINGAPOUR				
24.025	Adidas AG	4.248.877	0,74	328.900	DBS Group Holdings Limited	8.163.437	1,43
	Total Allemagne	4.248.877	0,74		Total Singapour	8.163.437	1,43
HONG KONG			SUISSE				
760.600	AIA Group Limited	8.008.130	1,40	9.648	Lonza Group AG - Reg	5.781.091	1,01
	Total Hong Kong	8.008.130	1,40	89.945	Nestle SA - Reg	10.973.971	1,92
INDE			Total Suisse			16.755.062	2,93
599.482	HDFC Bank Limited	11.740.857	2,05	TAÏWAN			
226.120	Kotak Mahindra Bank Limited	4.767.812	0,83	770.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	13.479.095	2,35
	Total Inde	16.508.669	2,88		Total Taïwan	13.479.095	2,35
INDONÉSIE			ROYAUME-UNI				
27.351.774	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	8.627.945	1,51	139.798	Anglo American plc	4.629.010	0,81
	Total Indonésie	8.627.945	1,51	159.926	Diageo plc	7.146.342	1,25
IRLANDE							
97.611	CRH plc	4.928.649	0,86				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Select

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Organismes de placement collectif en valeurs mobilières				
Actions (suite)			Fonds				
ROYAUME-UNI (suite)			IRLANDE				
278.081	Shell plc	7.937.391	1,39	14.622.250	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	14.622.250	2,55
168.684	SSE plc	3.760.505	0,66	Total Irlande		14.622.250	2,55
Total Royaume-Uni		23.473.248	4,11	Total Fonds		14.622.250	2,55
ÉTATS-UNIS			Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières			14.622.250	2,55
53.562	Abbott Laboratories	5.423.688	0,95	Valeur totale des investissements		581.342.531	101,50
19.908	Adobe Inc.	7.671.946	1,34	(Coût total : 533.797.154 USD)			
57.522	Advanced Micro Devices Inc.	5.637.731	0,98	<i>*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.</i>			
233.759	Alphabet Inc. - A	24.247.821	4,23				
202.645	Amazon.com Inc.	20.931.201	3,65				
24.815	Autodesk Inc.	5.165.490	0,90				
17.172	Cooper Companies Inc.	6.411.338	1,12				
30.150	CrowdStrike Holdings Inc. - A	4.138.389	0,72				
12.933	Deere & Company	5.339.777	0,93				
59.380	Ecolab Inc.	9.829.171	1,71				
67.079	Electronic Arts Inc.	8.079.666	1,41				
15.907	Elevance Health Inc.	7.314.198	1,28				
33.490	Eli Lilly & Company	11.501.136	2,01				
7.924	Equinix Inc.	5.713.521	1,00				
56.676	IntercontinentalExchange Inc.	5.910.740	1,03				
28.507	Intuit Inc.	12.709.276	2,22				
95.399	JPMorgan Chase & Company	12.431.443	2,16				
17.180	Lam Research Corp.	9.107.462	1,59				
51.335	Mastercard Inc. - A	18.655.652	3,26				
5.404	Mercadolibre Inc.	7.122.796	1,24				
102.048	Micron Technology Inc.	6.157.576	1,08				
113.826	Microsoft Corp.	32.816.035	5,72				
96.013	NextEra Energy Inc.	7.400.683	1,29				
29.806	NVIDIA Corp.	8.279.213	1,45				
72.536	ON Semiconductor Corp.	5.971.164	1,04				
56.991	Paypal Holdings Inc.	4.327.897	0,76				
53.940	PepsiCo Inc.	9.833.262	1,71				
75.828	QUALCOMM Inc.	9.674.135	1,69				
21.792	Stryker Corp.	6.220.962	1,09				
15.950	Thermo Fisher Scientific Inc.	9.193.101	1,61				
115.502	T-Mobile USA Inc.	16.729.310	2,92				
111.687	Trimble Inc.	5.854.633	1,02				
246.713	Uber Technologies Inc.	7.820.802	1,37				
39.781	Union Pacific Corp.	8.006.324	1,40				
61.934	Walt Disney Company	6.201.451	1,08				
Total États-Unis		337.828.990	58,96				
Total Actions		566.720.281	98,95				
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs		566.720.281	98,95				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions			Actions (suite)				
BELGIQUE			JAPON (suite)				
173.340	Azelis Group NV	4.049.222	0,24	332.500	Mani Inc.	4.152.925	0,25
1.562	Lotus Bakeries NV	10.074.900	0,60	750.440	Shoei Company Limited	14.396.838	0,85
	Total Belgique	14.124.122	0,84	1.177.000	SMS Company Limited	26.007.105	1,54
CANADA			446.710	Square Enix Holdings Company Limited	19.648.413	1,16	
262.597	Cargojet Inc.	19.661.546	1,17	Total Japon	128.087.411	7,60	
	Total Canada	19.661.546	1,17	PAYS-BAS			
DANEMARK			339.511	BE Semiconductor Industries NV	27.194.831	1,61	
1.530.665	ALK-Abello AS	21.801.196	1,29	173.267	IMCD NV	26.059.357	1,55
	Total Danemark	21.801.196	1,29	Total Pays-Bas	53.254.188	3,16	
FINLANDE			ESPAGNE				
283.948	Revenio Group Oyj	10.971.751	0,65	847.223	Fluidra SA	13.716.540	0,81
	Total Finlande	10.971.751	0,65	Total Espagne	13.716.540	0,81	
FRANCE			SUÈDE				
325.266	Lectra	11.823.419	0,70	2.892.838	Fortnox AB	18.210.517	1,08
169.043	Remy Cointreau SA	28.399.224	1,68	576.923	Hemnet Group AB	8.941.112	0,53
	Total France	40.222.643	2,38	367.751	MIPS AB	17.091.609	1,01
ALLEMAGNE			771.711	Nordnet AB publ	11.696.202	0,69	
499.674	CTS Eventim AG & Company KGaA	28.706.271	1,71	722.214	Thule Group AB	16.327.673	0,97
521.346	Nemetschek SE	32.990.775	1,96	Total Suède	72.267.113	4,28	
26.022	Rational AG	16.055.574	0,95	SUISSE			
76.043	STRATEC SE	4.760.292	0,28	44.702	Belimo Holding AG	19.862.026	1,18
	Total Allemagne	82.512.912	4,90	22.462	Inficon Holding AG	22.336.935	1,32
ITALIE			4.362	LEM Holding SA	8.640.267	0,51	
199.463	Diasorin SpA	19.359.879	1,15	1.141.414	SIG Group AG	27.048.209	1,60
753.168	Stevanato Group SpA	17.954.854	1,06	159.849	SKAN Group AG	13.480.108	0,80
1.941.852	Technoprobe SpA	12.948.269	0,77	59.108	Tecan Group AG - Reg	23.773.592	1,41
	Total Italie	50.263.002	2,98	80.485	VAT Group AG	26.614.084	1,58
JAPON			80.485	Total Suisse	141.755.221	8,40	
459.200	Asahi Intecc Company Limited	7.380.447	0,44	ROYAUME-UNI			
531.900	Capcom Company Limited	17.417.855	1,03	1.604.445	Abcam plc	19.877.426	1,17
514.600	Daiseki Company Limited	14.929.541	0,89	1.414.269	Auction Technology Group plc	9.882.509	0,59
90.585	Disco Corp.	9.585.006	0,57	689.486	Future plc	9.094.435	0,54
498.200	Japan Elevator Service Holdings Company Limited	7.400.868	0,44	272.823	Games Workshop Group plc	29.931.248	1,77
211.535	Jtower Inc.	7.168.413	0,43	509.334	Genus plc	16.659.281	0,99
				485.619	Keywords Studios plc	15.242.519	0,90
				250.520	Renishaw plc	11.672.317	0,69

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions (suite)			Actions (suite)				
ROYAUME-UNI (suite)			ÉTATS-UNIS (suite)				
2.139.607	Watches of Switzerland Group plc	19.857.509	1,18	83.914	Visteon Corp.	12.113.059	0,72
				96.723	WD-40 Company	15.851.194	0,94
	Total Royaume-Uni	132.217.244	7,83	496.455	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	21.421.888	1,27
				364.434	Workiva Inc.	34.351.959	2,04
				119.969	XPEL Inc.	7.503.239	0,44
				224.776	YETI Holdings Inc.	8.275.613	0,49
					Total États-Unis	879.730.318	52,17
					Total Actions	1.660.585.207	98,46
					Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	1.660.585.207	98,46
					Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
					Fonds		
					IRLANDE		
				26.602.496	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	24.485.707	1,45
					Total Irlande	24.485.707	1,45
					Total Fonds	24.485.707	1,45
					Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	24.485.707	1,45
					Valeur totale des investissements	1.685.070.914	99,91
					(Coût total : 1.703.395.198 EUR)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - American

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
ÎLES CAÏMANS			ÉTATS-UNIS (suite)		
252.441 Globalfoundries Inc.	18.221.191	1,72	225.942 QUALCOMM Inc.	28.825.681	2,72
Total Îles Caïmans	18.221.191	1,72	83.473 Republic Services Inc.	11.287.219	1,07
CURAÇAO			15.291 S&P Global Inc.	5.271.878	0,50
154.738 Schlumberger Limited	7.597.636	0,72	98.400 Salesforce Inc.	19.658.352	1,86
Total Curaçao	7.597.636	0,72	65.688 Sherwin-Williams Company	14.764.692	1,40
SUISSE			167.556 Stanley Black & Decker Inc.	13.501.662	1,28
236.623 TE Connectivity Limited	31.033.106	2,93	442.203 State Street Corp.	33.470.345	3,17
Total Suisse	31.033.106	2,93	299.508 Take-Two Interactive Software Inc.	35.731.304	3,38
ÉTATS-UNIS			77.779 Teradyne Inc.	8.362.020	0,79
161.246 Advanced Micro Devices Inc.	15.803.720	1,49	71.503 TransUnion	4.443.196	0,42
721.542 AES Corp.	17.374.731	1,64	177.902 Trimble Inc.	9.325.623	0,88
145.921 Alphabet Inc. - A	15.136.385	1,43	538.410 Uber Technologies Inc.	17.067.597	1,61
315.537 Amazon.com Inc.	32.591.817	3,08	46.243 Union Pacific Corp.	9.306.866	0,88
94.949 BioMarin Pharmaceuticals Inc.	9.232.841	0,87	95.802 United Parcel Service Inc.	18.584.630	1,76
338.334 Bristol-Myers Squibb Company	23.449.929	2,21	63.571 Vertex Pharmaceuticals Inc.	20.029.314	1,89
36.356 Broadcom Inc.	23.323.829	2,20	398.029 Virtu Financial Inc.	7.522.748	0,71
113.542 Catalent Inc.	7.460.845	0,71	441.703 Voya Financial Inc.	31.564.096	2,98
16.834 Cigna Group	4.301.592	0,41	57.050 Walt Disney Company	5.712.417	0,54
31.184 Cintas Corp.	14.428.214	1,36	403.055 WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	18.895.218	1,79
409.101 Coca Cola Company	25.376.535	2,40	39.971 Zebra Technologies Corp.	12.710.778	1,20
97.189 CrowdStrike Holdings Inc. - A	13.340.162	1,26	Total États-Unis	954.610.311	90,23
232.751 Darling International Inc.	13.592.658	1,28	Total Actions	1.011.462.244	95,60
94.134 Doximity Inc.	3.048.059	0,29	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	1.011.462.244	95,60
151.739 Electronic Arts Inc.	18.276.963	1,73	Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
56.166 Eli Lilly & Company	19.288.528	1,82	Fonds		
479.771 Endeavor Group Holdings Inc.	11.480.920	1,09	IRLANDE		
77.476 Exact Sciences Corp.	5.253.648	0,50	43.005.955 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	43.005.955	4,06
86.157 FMC Corp.	10.522.354	0,99	Total Irlande	43.005.955	4,06
29.895 Goldman Sachs Group Inc.	9.778.953	0,92	Total Fonds	43.005.955	4,06
78.255 Hess Corp.	10.356.267	0,98	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	43.005.955	4,06
294.316 Hilton Worldwide Holdings Inc.	41.460.295	3,92	Valeur totale des investissements	1.054.468.199	99,66
127.259 Howmet Aerospace Inc.	5.391.964	0,51	(Coût total : 1.001.157.212 USD)		
126.464 IntercontinentalExchange Inc.	13.188.931	1,25			
113.014 Intuitive Surgical Inc.	28.871.687	2,73			
239.150 Kellogg Company	16.013.484	1,52			
47.303 Lam Research Corp.	25.076.267	2,37			
100.697 Lamb Weston Holding Inc.	10.524.850	0,99			
440.188 Marvell Technology Inc.	19.060.141	1,80			
178.794 Microchip Technology Inc.	14.979.361	1,42			
152.548 Microsoft Corp.	43.979.588	4,15			
291.561 Northern Trust Corp.	25.695.271	2,43			
1.851.825 NOV Inc.	34.277.281	3,24			
167.608 Procter & Gamble Company	24.921.634	2,36			
174.040 Prologis Inc.	21.714.971	2,05			

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - American Select

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
CANADA			ÉTATS-UNIS (suite)		
42.257 Ritchie Bros Auctioneers Inc.	2.378.647	0,71	285.521 Uber Technologies Inc.	9.051.016	2,69
Total Canada	2.378.647	0,71	31.353 United Parcel Service Inc.	6.082.168	1,81
ÎLES CAÏMANS			60.171 Vertex Pharmaceuticals Inc.	18.958.076	5,63
85.942 Globalfoundries Inc.	6.203.294	1,84	18.381 Walt Disney Company	1.840.490	0,55
Total Îles Caïmans	6.203.294	1,84	131.178 WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	6.149.625	1,83
CURAÇAO			11.807 Zebra Technologies Corp.	3.754.626	1,11
50.229 Schlumberger Limited	2.466.244	0,73	Total États-Unis	319.657.085	94,92
Total Curaçao	2.466.244	0,73	Total Actions	330.705.270	98,20
ÉTATS-UNIS			Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs		
89.835 Advanced Micro Devices Inc.	8.804.728	2,61		330.705.270	98,20
248.820 AES Corp.	5.991.586	1,78	Valeur totale des investissements		
48.079 Alphabet Inc. - A	4.987.235	1,48		330.705.270	98,20
96.755 Amazon.com Inc.	9.993.824	2,97	(Coût total : 323.485.629 USD)		
38.337 BioMarin Pharmaceuticals Inc.	3.727.890	1,11	<i>*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.</i>		
48.581 Catalent Inc.	3.192.258	0,95			
240.608 Coca Cola Company	14.924.914	4,43			
50.222 CrowdStrike Holdings Inc. - A	6.893.472	2,05			
65.917 Darling International Inc.	3.849.553	1,14			
77.493 Electronic Arts Inc.	9.334.032	2,77			
67.013 Exact Sciences Corp.	4.544.152	1,35			
9.612 Goldman Sachs Group Inc.	3.144.181	0,93			
24.957 Hess Corp.	3.302.809	0,98			
120.283 Hilton Worldwide Holdings Inc.	16.944.266	5,03			
54.662 Intuitive Surgical Inc.	13.964.501	4,15			
86.967 Kellogg Company	5.823.310	1,73			
187.062 Kontoor Brands Inc.	9.051.930	2,69			
35.994 Lam Research Corp.	19.081.138	5,67			
35.603 Lamb Weston Holding Inc.	3.721.226	1,11			
79.890 Marvell Technology Inc.	3.459.237	1,03			
54.315 Microsoft Corp.	15.659.014	4,64			
158.721 Northern Trust Corp.	13.988.082	4,15			
757.479 NOV Inc.	14.020.936	4,17			
75.167 Procter & Gamble Company	11.176.581	3,32			
56.120 Prologis Inc.	7.002.092	2,08			
110.141 QUALCOMM Inc.	14.051.789	4,17			
4.910 S&P Global Inc.	1.692.821	0,50			
99.067 Schnitzer Steel Industries Inc.	3.080.984	0,91			
21.150 Sherwin-Williams Company	4.753.886	1,41			
53.769 Stanley Black & Decker Inc.	4.332.706	1,29			
240.020 State Street Corp.	18.167.114	5,39			
35.226 Teradyne Inc.	3.787.147	1,12			
61.790 TransUnion	3.839.630	1,14			
67.380 Trimble Inc.	3.532.060	1,05			

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)		
ÉTATS-UNIS (suite)		
411.071 Virtu Financial Inc.	7.769.242	1,68
206.834 Voya Financial Inc.	14.780.358	3,21
107.897 Westrock Company	3.287.622	0,71
285.598 WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	13.388.834	2,91
42.136 Wingstop Inc.	7.735.327	1,68
407.409 Xponential Fitness Inc.	12.381.160	2,68
Total États-Unis	422.602.137	91,62
Total Actions	454.967.310	98,65
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	457.443.463	99,19
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Fonds		
IRLANDE		
2.289.664 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.289.664	0,50
Total Irlande	2.289.664	0,50
Total Fonds	2.289.664	0,50
Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	2.289.664	0,50
Valeur totale des investissements	459.733.127	99,69

(Coût total : 456.072.251 USD)

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
AUSTRALIE			HONG KONG (suite)		
21.473 Amcor plc	240.028	0,54	174.500 BOC Hong Kong Holdings Limited	543.508	1,23
65.459 ANZ Group Holdings Limited	1.005.278	2,27	126.400 Galaxy Entertainment Group Limited	844.548	1,90
4.159 CSL Limited	803.057	1,81	522.000 Guangdong Investment Limited	533.971	1,20
32.529 Goodman Group	409.365	0,92	24.221 Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.074.368	2,42
3.809 Macquarie Group Limited	448.122	1,01	Total Hong Kong	5.243.219	11,81
52.172 Newcrest Mining Limited	938.198	2,11			
11.726 Rio Tinto Limited	943.518	2,13			
143.371 Santos Limited	662.557	1,49			
149.344 Telstra Corp. Limited	422.098	0,95			
78.850 Transurban Group	750.427	1,69			
Total Australie	6.622.648	14,92			
			INDE		
			39.414 HDFC Bank Limited	771.923	1,74
			32.252 Infosys Limited	560.388	1,26
			59.341 Reliance Industries Limited	1.683.161	3,80
			7.954 Tata Consultancy Services Limited	310.281	0,70
			37.370 UPL Limited	326.328	0,74
			Total Inde	3.652.081	8,24
			INDONÉSIE		
			499.600 Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	332.350	0,75
			Total Indonésie	332.350	0,75
			RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)		
			3.005 Kia Corp.	186.969	0,42
			964 LG Chem Limited P.P. 144A	527.227	1,18
			5.067 Naver Corp.	786.217	1,77
			45.056 Samsung Electronics Company Limited	2.214.996	4,99
			704 Samsung Sdi Company Limited	397.466	0,90
			20.349 SK Hynix Inc.	1.384.896	3,12
			12.450 SK Telecom Company Limited	461.909	1,04
			Total République de Corée (du Sud)	5.959.680	13,42
			SINGAPOUR		
			186.900 Singapore Telecommunications Limited	345.812	0,78
			23.200 United Overseas Bank Limited	519.297	1,17
			Total Singapour	865.109	1,95
			TAIÏWAN		
			219.000 Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.833.665	8,65
			HONG KONG		
			213.400 AIA Group Limited	2.246.824	5,06

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)		
TAÏWAN (suite)		
36.000 Yageo Corp.	625.462	1,41
Total Taïwan	4.459.127	10,06
THAÏLANDE		
52.500 Kasikornbank pcl	203.429	0,46
Total Thaïlande	203.429	0,46
Total Actions	42.931.606	96,78
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	42.931.606	96,78
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Fonds		
IRLANDE		
18.558 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	18.558	0,04
Total Irlande	18.558	0,04
Total Fonds	18.558	0,04
Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	18.558	0,04
Valeur totale des investissements	42.950.164	96,82

(Coût total : 41.862.008 USD)

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
AUSTRALIE			HONG KONG		
165.677 ANZ Group Holdings Limited	2.544.363	2,17	406.400 AIA Group Limited	4.278.864	3,65
228.651 Chalice Mining Limited	1.147.011	0,98	432.000 BOC Hong Kong Holdings Limited	1.345.534	1,15
13.947 CSL Limited	2.693.012	2,30	384.000 Galaxy Entertainment Group Limited	2.565.717	2,19
733.851 Deterra Royalties Limited	2.359.184	2,01	39.337 Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.744.865	1,49
121.316 IGO Limited	1.037.580	0,89	826.000 Lenovo Group Limited	894.398	0,76
20.118 Macquarie Group Limited	2.366.848	2,02	128.500 Sun Hung Kai Properties Limited	1.800.644	1,54
30.471 Mineral Resources Limited	1.644.677	1,40	41.661 Techtronic Industries Company	450.312	0,38
304.829 Santos Limited	1.408.699	1,20			
157.974 Transurban Group	1.503.462	1,28			
Total Australie	16.704.836	14,25	Total Hong Kong	13.080.334	11,16
ÎLES CAÏMANS			INDE		
385.000 China Mengniu Dairy Company Limited	1.579.242	1,35	157.652 Bharti Airtel Limited	1.436.814	1,22
546.816 China Resources Land Limited	2.493.768	2,13	136.622 HDFC Bank Limited	2.675.742	2,28
35.792 Hesai Group	553.702	0,47	286.116 ICICI Bank Limited	3.054.109	2,62
71.785 JD.com Inc.	1.572.875	1,34	106.853 Infosys Limited	1.856.602	1,59
17.500 Li Ning Company Limited	137.994	0,12	107.198 Reliance Industries Limited	3.040.587	2,60
86.693 Meituan	1.584.776	1,35	200.460 UPL Limited	1.750.490	1,50
44.000 Parade Technologies Limited	1.517.347	1,30			
113.600 Sunny Optical Technology Group Company Limited	1.374.059	1,17	Total Inde	13.814.344	11,81
98.500 Tencent Holdings Limited	4.840.947	4,14			
21.300 Trip.com Group Limited	797.193	0,68	INDONÉSIE		
37.000 Wuxi Biologics Cayman Inc.	229.071	0,20	8.969.956 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	2.829.516	2,42
Total Îles Caïmans	16.680.974	14,25	Total Indonésie	2.829.516	2,42
CHINE			MALAISIE		
223.628 Alibaba Group Holding Limited	2.860.170	2,45	1.034.300 CIMB Group Holdings Bhd	1.244.677	1,06
25.000 BYD Company Limited	731.850	0,62			
3.316.000 China Construction Bank Corp.	2.150.128	1,84	Total Malaisie	1.244.677	1,06
214.500 China Merchants Bank Company Limited - H	1.095.730	0,94	PHILIPPINES		
44.100 China Tourism Group Duty Free Corp. Limited	1.176.722	1,00	1.162.525 Metropolitan Bank & Trust Company	1.250.934	1,07
256.000 Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	1.085.541	0,93	Total Philippines	1.250.934	1,07
245.500 NARI Technology Company Limited	969.161	0,83	RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)		
302.000 Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.965.893	1,68	29.219 Kia Corp.	1.817.987	1,56
466.100 Songcheng Performance Development Company Limited	1.104.286	0,94	36.094 KT Corp.	816.508	0,70
59.177 Wuliangye Yibin Company Limited - A	1.697.595	1,45	2.469 LG Chem Limited P.P. 144A	1.350.335	1,15
Total Chine	14.837.076	12,68	4.639 Lotte Chilsung Beverage Company Limited	587.605	0,50
			2.016 Samsung Biologics Company Limited	1.220.273	1,04

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Actions (suite)			Fonds		
RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD) (suite)			IRLANDE		
108.436 Samsung Electronics Company Limited	5.330.818	4,55	14.119 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	14.119	0,01
2.875 Samsung Sdi Company Limited	1.623.176	1,39	Total Irlande	14.119	0,01
18.234 SK Hynix Inc.	1.240.955	1,06	Total Fonds	14.119	0,01
Total République de Corée (du Sud)	13.987.657	11,95	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	14.119	0,01
SINGAPOUR			Valeur totale des investissements	115.440.088	98,58
219.700 Keppel Corp. Limited	930.323	0,79	(Coût total : 109.237.239 USD)		
108.500 United Overseas Bank Limited	2.428.611	2,07	<i>*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.</i>		
Total Singapour	3.358.934	2,86			
TAIÛWAN					
256.550 Chailease Holding Company Limited	1.883.183	1,61			
188.000 Chroma ATE Inc.	1.095.971	0,94			
132.000 Delta Electronics Inc.	1.304.918	1,11			
548.000 Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	9.592.914	8,20			
70.000 Yageo Corp.	1.216.176	1,03			
Total Taïwan	15.093.162	12,89			
THAÏLANDE					
712.663 Thai Oil pcl	1.094.159	0,93			
Total Thaïlande	1.094.159	0,93			
ÉTATS-UNIS					
23.050 Yum China Holdings Inc.	1.449.366	1,24			
Total États-Unis	1.449.366	1,24			
Total Actions	115.425.969	98,57			
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	115.425.969	98,57			

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
CANADA			ÉTATS-UNIS (suite)		
52.183 Canadian Natural Resources Limited	2.888.329	1,08	7.979 IBM Corp.	1.045.967	0,39
Total Canada	2.888.329	1,08	29.820 International Flavors & Fragrances Inc.	2.742.247	1,03
IRLANDE			10.576 Intuit Inc.	4.715.099	1,76
5.061 Accenture plc	1.446.485	0,54	7.062 IQVIA Holdings Inc.	1.404.561	0,52
7.143 Aon plc	2.252.116	0,84	38.981 Johnson & Johnson	6.042.055	2,26
37.085 Medtronic plc	2.989.793	1,11	16.544 JPMorgan Chase & Company	2.155.849	0,80
Total Irlande	6.688.394	2,49	5.809 Lam Research Corp.	3.079.467	1,15
SUISSE			5.879 Lowe's Companies Inc.	1.175.624	0,44
21.435 TE Connectivity Limited	2.811.200	1,04	32.814 Marvell Technology Inc.	1.420.846	0,53
Total Suisse	2.811.200	1,04	11.896 Mastercard Inc. - A	4.323.125	1,61
ÉTATS-UNIS			29.936 Match Group Inc.	1.149.243	0,43
21.206 Abbott Laboratories	2.147.320	0,80	7.657 McDonald's Corp.	2.140.974	0,80
20.017 AbbVie Inc.	3.190.109	1,19	23.846 Meta Platforms Inc.	5.053.921	1,89
11.203 Adobe Inc.	4.317.300	1,61	6.692 Microchip Technology Inc.	560.656	0,21
16.111 Advanced Micro Devices Inc.	1.579.039	0,59	66.681 Microsoft Corp.	19.224.133	7,18
52.034 Alphabet Inc. - A	5.397.486	2,02	64.229 Mondelez International Inc.	4.478.045	1,67
49.161 Alphabet Inc. - C	5.112.744	1,91	16.724 Monster Beverage Corp.	903.263	0,34
85.007 Amazon.com Inc.	8.780.374	3,27	2.616 MSCI Inc. - A	1.464.149	0,55
39.401 American Electric Power Company Inc.	3.585.097	1,34	26.720 Newmont Corp.	1.309.814	0,49
1.808 American Express Company	298.230	0,11	24.482 NVIDIA Corp.	6.800.366	2,54
18.446 American Tower Corp.	3.769.256	1,41	8.003 Palo Alto Networks Inc.	1.598.519	0,60
100.287 Apple Inc.	16.537.326	6,17	10.871 Parker Hannifin Corp.	3.653.851	1,36
51.859 Avantor Inc.	1.096.299	0,41	29.357 Pinterest Inc.	800.565	0,30
56.805 Bank of America Corp.	1.624.623	0,61	43.313 Procter & Gamble Company	6.440.210	2,40
22.532 Berkshire Hathaway Inc.	6.957.206	2,60	32.023 Public Service Enterprise Group Inc.	1.999.836	0,75
14.747 BioMarin Pharmaceuticals Inc.	1.433.998	0,54	11.536 QUALCOMM Inc.	1.471.763	0,55
2.480 BlackRock Inc.	1.659.417	0,62	53.171 Raytheon Technologies Corp.	5.207.036	1,94
58.699 Boston Scientific Corp.	2.936.711	1,10	3.636 S&P Global Inc.	1.253.584	0,47
32.876 Chevron Corp.	5.364.048	2,00	10.028 Sherwin-Williams Company	2.253.994	0,84
64.893 Comcast Corp.	2.460.094	0,92	42.214 State Street Corp.	3.195.178	1,19
21.325 Corteva Inc.	1.286.111	0,48	35.937 Sysco Corp.	2.775.415	1,04
123.881 Coty Inc. - A	1.494.005	0,56	35.908 Take-Two Interactive Software Inc.	4.283.824	1,60
8.039 Elevance Health Inc.	3.696.413	1,38	49.645 Tapestry Inc.	2.140.196	0,80
15.734 Eli Lilly & Company	5.403.370	2,02	15.912 Tesla Inc.	3.301.104	1,23
66.319 Endeavor Group Holdings Inc.	1.587.014	0,59	4.538 Thermo Fisher Scientific Inc.	2.615.567	0,98
12.644 Entegris Inc.	1.036.934	0,39	6.931 TJX Companies Inc.	543.113	0,20
16.616 EOG Resources Inc.	1.904.692	0,71	24.452 T-Mobile USA Inc.	3.541.628	1,32
21.036 GE HealthCare Technologies Inc.	1.725.583	0,64	98.452 Uber Technologies Inc.	3.120.928	1,17
35.461 General Electric Company	3.390.072	1,27	19.737 Union Pacific Corp.	3.972.269	1,48
7.925 Honeywell International Inc.	1.514.626	0,57	12.396 Vertex Pharmaceuticals Inc.	3.905.608	1,45
			20.273 Visa Inc. - A	4.570.750	1,71
			23.223 Walmart Inc.	3.424.231	1,28
			33.561 Walt Disney Company	3.360.463	1,25
			112.381 Wells Fargo & Company	4.200.801	1,57
			2.913 Zebra Technologies Corp.	926.334	0,35

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)		
ÉTATS-UNIS (suite)		
53.862 ZoomInfo Technologies Inc.	1.330.930	0,50
Total États-Unis	248.362.598	92,75
Total Actions	260.750.521	97,36
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	260.750.521	97,36
Valeur totale des investissements	260.750.521	97,36

(Coût total : 209.689.959 USD)

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité	Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			
Actions				Actions (suite)			
IRLANDE				ÉTATS-UNIS (suite)			
608	Aon plc	191.696	0,15	20.809	Hologic Inc.	1.679.286	1,32
	Total Irlande	191.696	0,15	63.118	Host Hotels & Resorts Inc.	1.040.816	0,82
ÉTATS-UNIS				1.129	Humana Inc.	548.084	0,43
14.383	Abbott Laboratories	1.456.423	1,15	9.657	IQVIA Holdings Inc.	1.920.681	1,51
8.226	AbbVie Inc.	1.310.978	1,03	42.045	Kroger Company	2.075.762	1,63
4.199	Adobe Inc.	1.618.169	1,27	3.175	Lam Research Corp.	1.683.131	1,32
21.628	Advanced Micro Devices Inc.	2.119.760	1,67	12.909	Lennar Corp.	1.356.865	1,06
59.411	Alphabet Inc. - A	6.162.703	4,85	6.489	Lincoln National Corp.	145.808	0,11
38.481	Altria Group Inc.	1.717.022	1,35	4.912	Lockheed Martin Corp.	2.322.050	1,83
17.163	Amazon.com Inc.	1.772.766	1,39	12.518	Marathon Petroleum Corp.	1.687.802	1,33
22.279	American Electric Power Company Inc.	2.027.166	1,60	13.635	Marsh & McLennan Companies Inc.	2.270.910	1,79
446	Amgen Inc.	107.821	0,08	6.944	Masco Corp.	345.256	0,27
58.304	Apple Inc.	9.614.329	7,56	8.490	Mastercard Inc. - A	3.085.351	2,43
23.244	Archer-Daniels-Midland Company	1.851.617	1,46	2.792	McKesson Corp.	994.092	0,78
3.444	Autodesk Inc.	716.903	0,56	14.277	Meta Platforms Inc.	3.025.867	2,39
3.625	Automatic Data Processing Inc.	807.034	0,63	24.748	Metlife Inc.	1.433.899	1,13
656	Autozone Inc.	1.612.546	1,27	30.774	Microsoft Corp.	8.872.144	6,99
7.536	Bath & Body Works Inc.	275.667	0,22	26.901	Morgan Stanley	2.361.907	1,85
4.204	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	408.797	0,32	18.004	Mosaic Company	826.023	0,65
36.853	Bristol-Myers Squibb Company	2.554.280	2,01	10.556	Nucor Corp.	1.630.585	1,28
13.341	Cardinal Health Inc.	1.007.246	0,79	2.739	NVIDIA Corp.	760.812	0,60
2.375	Caterpillar Inc.	543.495	0,43	2.308	O'Reilly Automotive Inc.	1.959.447	1,53
5.061	Centene Corp.	319.906	0,25	5.305	Parker Hannifin Corp.	1.783.063	1,40
5.206	CF Industries Holdings Inc.	377.383	0,30	62.316	Pfizer Inc.	2.542.493	2,00
3.068	Cintas Corp.	1.419.502	1,12	10.176	Philip Morris International Inc.	989.616	0,78
54.623	Cisco Systems Inc.	2.855.417	2,25	3.710	Procter & Gamble Company	551.640	0,43
26.255	Citigroup Inc.	1.231.097	0,97	21.286	PulteGroup Inc.	1.240.548	0,98
2.210	CME Group Inc.	423.259	0,33	20.341	QUALCOMM Inc.	2.595.105	2,04
11.166	CSX Corp.	334.310	0,26	754	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	619.539	0,49
13.968	CVS Health Corp.	1.037.962	0,82	15.620	Regions Financial Corp.	289.907	0,23
3.045	Delta Air Lines Inc.	106.331	0,09	3.028	SBA Communications Corp.	790.520	0,62
6.117	Electronic Arts Inc.	736.793	0,58	2.853	Southwest Airlines Company	92.837	0,07
4.222	EQT Corp.	134.724	0,11	27.024	State Street Corp.	2.045.447	1,61
8.193	Etsy Inc.	912.127	0,72	13.084	Synchrony Financial	380.483	0,30
17.108	Evergy Inc.	1.045.641	0,82	4.864	Tesla Inc.	1.009.085	0,79
16.917	Expedia Group Inc.	1.641.457	1,29	16.184	Textron Inc.	1.143.076	0,90
25.243	Exxon Mobil Corp.	2.768.148	2,17	2.905	Ulta Beauty Inc.	1.585.171	1,25
38.039	Fortinet Inc.	2.528.072	1,99	5.091	United Parcel Service Inc.	987.603	0,78
7.361	Fortive Corp.	501.799	0,39	13.832	Valero Energy Corp.	1.930.947	1,52
20.110	Fox Corp.	684.746	0,54	2.672	Vertex Pharmaceuticals Inc.	841.867	0,67
14.287	General Mills Inc.	1.220.967	0,96	20.483	Viatis Inc.	197.046	0,16
				55.955	Wells Fargo & Company	2.091.598	1,65

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)		
ÉTATS-UNIS (suite)		
54.711 Weyerhaeuser Company	1.648.442	1,30
Total États-Unis	125.346.974	98,62
Total Actions	125.538.670	98,77
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	125.538.670	98,77
Valeur totale des investissements	125.538.670	98,77

(Coût total : 121.462.832 USD)

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
BELGIQUE			ITALIE		
65.217 KBC Group NV	4.128.236	0,95	95.844 Moncler SpA	6.089.928	1,40
Total Belgique	4.128.236	0,95	Total Italie	6.089.928	1,40
DANEMARK			PAYS-BAS		
25.662 DSV A/S	4.569.646	1,05	3.064 Adyen NV	4.470.989	1,03
144.741 Novo Nordisk AS	21.097.267	4,84	13.710 ASML International NV	5.098.749	1,17
Total Danemark	25.666.913	5,89	25.882 ASML Holding NV	16.181.426	3,72
FRANCE			586.548 ING Groep NV	6.410.970	1,47
53.739 Air Liquide SA	8.286.554	1,89	40.697 Koninklijke DSM NV	4.423.764	1,02
343.575 AXA SA	9.676.790	2,22	96.326 STMicroelectronics NV	4.715.158	1,08
128.351 BNP Paribas SA	7.086.259	1,62	Total Pays-Bas	41.301.056	9,49
111.793 Compagnie de Saint-Gobain	5.849.010	1,34	NORVÈGE		
38.023 EssilorLuxottica SA	6.311.818	1,45	319.976 DNB Bank ASA	5.268.505	1,21
4.194 Hermes International	7.817.616	1,80	Total Norvège	5.268.505	1,21
36.148 L'Oreal SA	14.865.865	3,41	SUÈDE		
22.515 LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	19.011.666	4,36	352.766 Atlas Copco AB	4.118.831	0,95
51.710 Pernod-Ricard SA	10.791.877	2,48	417.493 Sandvik AB	8.145.286	1,87
99.521 Publicis Groupe SA	7.143.617	1,64	Total Suède	12.264.117	2,82
46.147 Schneider Electric SE	7.091.871	1,63	SUISSE		
18.924 Teleperformance	4.195.451	0,96	73.743 Compagnie Financiere Richemont SA - Reg	10.840.120	2,49
275.943 TotalEnergies SE	15.000.261	3,44	11.822 Lonza Group AG - Reg	6.520.092	1,50
40.784 Vinci SA	4.311.684	0,99	128.590 Nestle SA - Reg	14.440.566	3,32
Total France	127.440.339	29,23	55.593 Roche Holding AG	14.616.231	3,36
ALLEMAGNE			28.315 Sika AG	7.288.958	1,67
62.806 Brenntag SE	4.346.175	1,00	359.341 UBS Group AG	6.983.884	1,60
138.052 Daimler Truck Holding AG	4.294.798	0,99	Total Suisse	60.689.851	13,94
66.654 Dr Ing hc F Porsche AG	7.865.172	1,80	ROYAUME-UNI		
66.221 Mercedes-Benz Group AG - Reg	4.687.122	1,08	667.317 3i Group plc	12.796.727	2,95
19.869 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG - Reg	6.407.753	1,47	190.368 Ashtead Group plc	10.741.559	2,47
Total Allemagne	27.601.020	6,34	116.049 Astrazeneca plc	14.834.241	3,41
IRLANDE			363.364 Compass Group plc	8.407.098	1,93
670.756 Bank of Ireland Group plc	6.254.129	1,44	530.676 Howden Joinery Group plc	4.215.525	0,97
198.328 CRH plc	9.217.294	2,12	37.154 London Stock Exchange Group plc	3.326.877	0,76
124.165 Experian plc	3.758.786	0,86	125.317 Reckitt Benckiser Group plc	8.782.466	2,02
70.337 Kingspan Group plc	4.434.044	1,02	1.060.943 Rentokil Initial plc	7.143.105	1,64
Total Irlande	23.664.253	5,44	90.799 Rio Tinto plc	5.660.697	1,30
			483.603 SSE plc	9.923.195	2,28

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)		
ROYAUME-UNI (suite)		
451.841 St James's Place plc	6.227.254	1,43
Total Royaume-Uni	92.058.744	21,16
Total Actions	426.172.962	97,87
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	426.172.962	97,87
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Fonds		
IRLANDE		
71.065 BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	7.024.720	1,61
Total Irlande	7.024.720	1,61
Total Fonds	7.024.720	1,61
Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	7.024.720	1,61
Valeur totale des investissements	433.197.682	99,48

(Coût total : 365.924.793 EUR)

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
BELGIQUE			ITALIE (suite)		
27.229 KBC Group NV	1.723.596	2,48	206.146 Nexi SpA	1.543.209	2,22
6.477 Melexis NV	689.153	0,99	Total Italie	3.828.367	5,50
Total Belgique	2.412.749	3,47			
DANEMARK			JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES		
51.629 Tryg A/S	1.038.915	1,50	162.913 WPP plc	1.777.297	2,56
Total Danemark	1.038.915	1,50	Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	1.777.297	2,56
FINLANDE			PAYS-BAS		
19.383 Upm-Kymmene Oyj	599.904	0,86	5.190 ASM International NV	1.930.161	2,78
Total Finlande	599.904	0,86	24.841 BE Semiconductor Industries NV	1.989.764	2,86
FRANCE			390.793 Royal KPN NV	1.272.422	1,83
11.196 Air Liquide SA	1.726.423	2,49	Total Pays-Bas	5.192.347	7,47
86.603 AXA SA	2.439.175	3,52	ESPAGNE		
30.801 BNP Paribas SA	1.700.523	2,45	129.173 Iberdrola SA	1.483.552	2,14
21.995 Compagnie de Saint-Gobain	1.150.778	1,66	65.410 Inditex SA	2.021.169	2,91
1.905 LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1.608.582	2,31	Total Espagne	3.504.721	5,05
8.483 Pernod-Ricard SA	1.770.402	2,55	SUÈDE		
6.863 Sanofi	687.947	0,99	66.546 Sandvik AB	1.298.312	1,87
11.113 Schneider Electric SE	1.707.846	2,46	Total Suède	1.298.312	1,87
41.680 TotalEnergies SE	2.265.725	3,26	SUISSE		
19.706 Vinci SA	2.083.318	3,00	14.069 Nestle SA - Reg	1.579.939	2,27
Total France	17.140.719	24,69	1.306 Partners Group Holding AG - Reg	1.127.407	1,62
ALLEMAGNE			7.080 Roche Holding AG	1.861.438	2,68
24.633 Brenntag SE	1.704.604	2,45	Total Suisse	4.568.784	6,57
38.275 Daimler Truck Holding AG	1.190.735	1,71	ROYAUME-UNI		
59.735 Deutsche Telekom AG - Reg	1.335.077	1,92	99.464 3i Group plc	1.907.359	2,75
12.737 Mercedes-Benz Group AG - Reg	901.525	1,30	224.011 Allfunds Group plc	1.361.987	1,96
14.024 SAP SE	1.627.625	2,34	32.499 Anglo American plc	990.484	1,43
14.606 Siemens AG - Reg	2.180.092	3,14	15.573 Astrazeneca plc	1.990.656	2,86
23.161 Siemens Healthineers AG	1.227.996	1,77	12.199 London Stock Exchange Group plc	1.092.334	1,57
Total Allemagne	10.167.654	14,63	56.140 Persimmon plc	802.470	1,15
IRLANDE			19.099 Reckitt Benckiser Group plc	1.338.496	1,93
152.998 Bank of Ireland Group plc	1.426.553	2,05	69.397 SSE plc	1.423.978	2,05
44.787 CRH plc	2.081.476	2,99	131.777 St James's Place plc	1.816.145	2,61
Total Irlande	3.508.029	5,04			
ITALIE					
406.106 Enel SpA	2.285.158	3,28			

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)		
ROYAUME-UNI (suite)		
1.100.499 Vodafone Group plc	1.118.428	1,61
Total Royaume-Uni	13.842.337	19,92
Total Actions	68.880.135	99,13
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	68.880.135	99,13
Valeur totale des investissements	68.880.135	99,13

(Coût total : 63.774.985 EUR)

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
BELGIQUE			IRLANDE (suite)		
131.576 Azelis Group NV	3.073.615	0,78	680.437 Dalata Hotel Group Limited	2.851.031	0,73
310 Lotus Bakeries NV	1.999.500	0,51	816.790 Irish Continental Group plc	3.565.288	0,91
94.065 Melexis NV	10.008.516	2,55	Total Irlande	10.602.798	2,71
Total Belgique	15.081.631	3,84			
DANEMARK			ÎLE DE MAN		
130.763 ALK-Abello AS	1.862.452	0,48	2.333.609 Strix Group plc	2.650.486	0,68
77.665 Simcorp A/S	5.408.914	1,38	Total Île de Man	2.650.486	0,68
Total Danemark	7.271.366	1,86			
FINLANDE			ITALIE		
166.527 Huhtamaki Oyj	5.695.223	1,45	379.682 Carel Industries SpA	9.567.986	2,44
114.086 Musti Group Oyj	1.837.925	0,47	20.815 Diasorin SpA	2.020.304	0,52
67.452 Revenio Group Oyj	2.606.345	0,67	243.561 Infrastrutture Wireless Italiane SpA	2.951.959	0,75
112.485 Vaisala Oyj	4.471.279	1,14	112.226 Interpump Group SpA	5.796.473	1,48
Total Finlande	14.610.772	3,73	170.544 MARR SpA	2.258.003	0,58
			405.117 Technoprobe SpA	2.701.320	0,69
			Total Italie	25.296.045	6,46
FRANCE			JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES		
214.777 Elis SA	3.788.666	0,97	1.010.259 JTC plc	8.082.670	2,05
20.196 Gaztransport et Technigaz SA	1.902.463	0,49	Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	8.082.670	2,05
235.576 Lectra	8.563.187	2,18			
11.914 Remy Cointreau SA	2.001.552	0,51			
242.485 Verallia SA	9.529.661	2,44			
6.135 Virbac SA	1.815.960	0,46			
Total France	27.601.489	7,05			
ALLEMAGNE			PAYS-BAS		
169.969 CANCOM SE	5.354.024	1,37	65.510 BE Semiconductor Industries NV	5.247.351	1,34
170.028 CompuGroup Medical SE & Company KgaA	8.055.926	2,06	27.874 IMCD NV	4.192.249	1,07
156.562 CTS Eventim AG & Company KGaA	8.994.486	2,29	Total Pays-Bas	9.439.600	2,41
38.200 Gerresheimer AG	3.481.930	0,89			
75.257 Nemetschek SE	4.762.263	1,22			
109.253 Stabilus SE	7.035.893	1,80			
51.064 STRATEC SE	3.196.606	0,82			
Total Allemagne	40.881.128	10,45			
ISLANDE			ESPAGNE		
1.338.292 Marel HF	5.031.978	1,28	406.822 Fluidra SA	6.586.448	1,68
Total Islande	5.031.978	1,28	37.494 Viscofan SA	2.474.604	0,63
			Total Espagne	9.061.052	2,31
IRLANDE			SUÈDE		
1.118.781 AIB Group plc	4.186.479	1,07	370.024 Avanza Bank Holding AB	7.981.153	2,04
			527.436 Elekta AB - B	3.702.251	0,95
			376.391 Engcon AB	2.629.320	0,67
			851.083 Fortnox AB	5.357.598	1,37
			290.419 Hexpol AB	3.312.513	0,85
			1.582.406 Karnov Group AB	7.598.794	1,94
			134.909 MIPS AB	6.270.036	1,60
			1.031.556 Munters Group AB	8.748.890	2,23
			229.814 Nordnet AB publ	3.483.106	0,89

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)			Actions (suite)		
SUÈDE (suite)			ROYAUME-UNI (suite)		
190.972 Thule Group AB	4.317.458	1,10	864.703 Watches of Switzerland Group plc	8.025.235	2,05
Total Suède	53.401.119	13,64	Total Royaume-Uni	114.480.060	29,22
SUISSE			Total Actions		
17.655 Belimo Holding AG	7.844.483	2,00	389.105.544	99,33	
4.034 Inficon Holding AG	4.011.539	1,02	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs		
2.842 LEM Holding SA	5.629.445	1,45	389.105.544	99,33	
426.345 SIG Group AG	10.103.143	2,58	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		
11.375 Tecan Group AG - Reg	4.575.093	1,16	Actions		
18.945 VAT Group AG	6.264.569	1,60	DANEMARK		
95.212 VZ Holding AG	7.185.078	1,83	49.761 Ow Bunker A/S**	0	0,00
Total Suisse	45.613.350	11,64	Total Danemark	0	0,00
ROYAUME-UNI			Total Actions		
211.317 Abcam plc	2.618.001	0,67	0	0,00	
651.180 Allfunds Group plc	3.959.174	1,01	Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		
1.793.953 Ascential plc	4.920.338	1,26	0	0,00	
440.323 Auction Technology Group plc	3.076.852	0,79	Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
484.480 Big Yellow Group plc	6.445.508	1,65	Fonds		
430.504 Cvs Group plc	9.088.410	2,32	IRLANDE		
1.741.785 Dr. Martens plc	2.820.761	0,72	2.621 BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	259.128	0,07
173.004 FD Technologies plc	3.366.814	0,86	Total Irlande	259.128	0,07
309.944 Future plc	4.088.213	1,04	Total Fonds	259.128	0,07
31.644 Games Workshop Group plc	3.471.644	0,89	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
237.472 Genus plc	7.767.227	1,98	259.128	0,07	
480.124 GlobalData plc	6.666.226	1,70	Valeur totale des investissements		
1.035.438 Howden Joinery Group plc	8.225.198	2,10	389.364.672	99,40	
1.401.145 Ibstock plc	2.750.673	0,70	(Coût total : 349.754.549 EUR)		
125.231 Intermediate Capital Group plc	1.734.480	0,44	<i>*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.</i>		
4.800.426 Johnson Service Group plc	6.686.949	1,71	<i>**Titre à la juste valeur.</i>		
108.817 Keywords Studios plc	3.415.528	0,87			
906.770 Moonpig Group plc	1.273.442	0,33			
61.660 Renishaw plc	2.872.885	0,73			
605.064 Rightmove plc	3.876.827	0,98			
512.177 RWS Holdings plc	1.742.842	0,44			
310.263 St James's Place plc	4.276.032	1,09			
1.145.425 Synthomer plc	1.521.263	0,39			
603.957 Victoria plc	3.367.975	0,86			
99.498 Victrex plc	1.803.836	0,46			
942.515 Volution Group plc	4.617.727	1,18			

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			
Actions				Actions (suite)			
BELGIQUE				ISLANDE			
261.718	Azelis Group NV	6.113.733	0,82	2.567.671	Marel HF	9.654.443	1,29
571	Lotus Bakeries NV	3.682.950	0,49		Total Islande	9.654.443	1,29
96.570	Melexis NV	10.275.048	1,38				
	Total Belgique	20.071.731	2,69				
DANEMARK				IRLANDE			
303.203	ALK-Abello AS	4.318.507	0,58	2.069.705	AIB Group plc	7.744.836	1,04
152.604	Simcorp A/S	10.627.978	1,42	1.941.851	Dalata Hotel Group Limited	8.136.356	1,09
382.153	Tryg A/S	7.689.953	1,03	1.424.908	Irish Continental Group plc	6.219.723	0,84
	Total Danemark	22.636.438	3,03		Total Irlande	22.100.915	2,97
FINLANDE				ITALIE			
82.000	Cargotec Oyj	3.671.960	0,49	72.998	Diasorin SpA	7.085.186	0,95
333.698	Huhtamaki Oyj	11.412.472	1,53	1.019.423	Fincobank Banca Fineco SpA	14.414.641	1,93
241.944	Musti Group Oyj	3.897.718	0,52	1.273.881	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	15.439.438	2,07
131.285	Revenio Group Oyj	5.072.852	0,68	209.136	Interpump Group SpA	10.801.874	1,45
	Total Finlande	24.055.002	3,22	324.056	MARR SpA	4.290.501	0,57
FRANCE				JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES			
334.492	Bureau Veritas SA	8.854.003	1,19	627.754	JTC plc	5.022.404	0,67
121.406	Edenred	6.621.483	0,89		Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	5.022.404	0,67
786.894	Elis SA	13.880.811	1,85				
37.534	Gaztransport et Technigaz SA	3.535.703	0,47				
44.124	Remy Cointreau SA	7.412.832	0,99				
45.171	SEB SA	4.733.921	0,63				
109.073	Ubisoft Entertainment SA	2.667.926	0,36				
477.570	Verallia SA	18.768.501	2,51				
13.215	Virbac SA	3.911.640	0,52				
	Total France	70.386.820	9,41				
ALLEMAGNE				LUXEMBOURG			
380.757	CANCOM SE	11.993.846	1,61	219.115	Eurofins Scientific SE	13.506.249	1,81
56.164	Carl Zeiss Meditec AG	7.188.992	0,96		Total Luxembourg	13.506.249	1,81
319.897	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	15.156.720	2,04				
296.380	CTS Eventim AG & Company KGaA	17.027.031	2,28				
88.163	Gerresheimer AG	8.036.057	1,08				
107.649	Nemetschek SE	6.812.029	0,91				
126.203	Puma SE	7.175.903	0,96				
166.956	Stabilus SE	10.751.966	1,44				
100.000	STRATEC SE	6.260.000	0,84				
285.092	TeamViewer AG	4.463.115	0,60				
	Total Allemagne	94.865.659	12,72				
				PAYS-BAS			
				47.954	ASM International NV	17.834.093	2,38
				125.623	BE Semiconductor Industries NV	10.062.402	1,35
				575.806	Davide Campari-Milano NV	6.477.818	0,87
				45.945	IMCD NV	6.910.128	0,93
					Total Pays-Bas	41.284.441	5,53
				ESPAGNE			
				807.190	Fluidra SA	13.068.406	1,75
				69.937	Viscofan SA	4.615.842	0,62
					Total Espagne	17.684.248	2,37
				SUÈDE			
				707.996	Avanza Bank Holding AB	15.270.966	2,06

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions (suite)			Actions (suite)				
SUÈDE (suite)			ROYAUME-UNI (suite)				
1.098.143	Elekta AB - B	7.708.236	1,03	1.609.897	Watches of Switzerland Group plc	14.941.316	2,00
1.931.229	Fortnox AB	12.157.155	1,63				
592.500	Hexpol AB	6.758.043	0,91		Total Royaume-Uni	209.684.411	28,08
101.132	MIPS AB	4.700.215	0,63				
435.249	Nordnet AB publ	6.596.718	0,88		Total Actions	740.586.909	99,21
366.590	Thule Group AB	8.287.795	1,11				
	Total Suède	61.479.128	8,25		Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	740.586.909	99,21
SUISSE			Organismes de placement collectif en valeurs mobilières				
33.323	Belimo Holding AG	14.806.100	1,98	Fonds			
8.039	Inficon Holding AG	7.994.240	1,07	IRLANDE			
812.894	SIG Group AG	19.263.236	2,58	25.474	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	2.518.125	0,34
23.651	Tecan Group AG - Reg	9.512.574	1,28		Total Irlande	2.518.125	0,34
37.471	VAT Group AG	12.390.586	1,66				
	Total Suisse	63.966.736	8,57		Total Fonds	2.518.125	0,34
ROYAUME-UNI			Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières				
457.833	Abcam plc	5.672.081	0,76			2.518.125	0,34
1.226.449	Allfunds Group plc	7.456.810	1,00		Valeur totale des investissements	743.105.034	99,55
3.719.060	Ascential plc	10.200.396	1,37				
854.007	Auction Technology Group plc	5.967.557	0,81		(Coût total : 735.954.012 EUR)		
1.009.163	Big Yellow Group plc	13.425.876	1,80				
827.092	Cvs Group plc	17.460.817	2,34				
3.338.856	Dr. Martens plc	5.407.162	0,72				
2.944.960	Elementis plc	3.991.701	0,53				
300.975	FD Technologies plc	5.857.244	0,78				
650.639	Future plc	8.582.036	1,15				
59.642	Games Workshop Group plc	6.543.288	0,88				
441.534	Genus plc	14.441.680	1,93				
611.764	GlobalData plc	8.493.967	1,14				
1.973.607	Howden Joinery Group plc	15.677.720	2,10				
2.694.398	Ibstock plc	5.289.537	0,71				
233.588	Intermediate Capital Group plc	3.235.251	0,43				
113.834	Keywords Studios plc	3.573.000	0,48				
1.774.903	Moonpig Group plc	2.492.623	0,33				
210.486	Renishaw plc	9.807.038	1,31				
842.977	Rentokil Initial plc	5.675.586	0,76				
622.736	Rightmove plc	3.990.058	0,53				
990.445	RWS Holdings plc	3.370.299	0,45				
1.087.708	St James's Place plc	14.990.747	2,01				
1.573.955	Synthomer plc	2.090.403	0,28				
913.925	Victoria plc	5.096.517	0,68				
328.401	Victrex plc	5.953.701	0,80				

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Select

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions			Actions (suite)				
DANEMARK			NORVÈGE				
178.285	DSV A/S	31.747.303	2,07	1.697.015	DNB Bank ASA	27.941.884	1,82
356.109	Novo Nordisk AS	51.906.001	3,39	Total Norvège		27.941.884	1,82
2.044.278	Tryg A/S	41.136.408	2,68				
Total Danemark		124.789.712	8,14	ESPAGNE			
FRANCE			SUÈDE				
180.756	Air Liquide SA	27.872.575	1,82	808.940	Amadeus IT Holding SA - A	49.879.241	3,26
204.189	Dassault Systemes SE	7.733.658	0,50	2.201.075	Inditex SA	68.013.217	4,44
26.472	Hermes International	49.343.808	3,22	Total Espagne		117.892.458	7,70
363.057	Legrand SA	30.525.833	1,99	SUISSE			
99.821	L'Oreal SA	41.051.386	2,68	5.530.396	Atlas Copco AB	41.220.258	2,69
86.686	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	73.197.658	4,78	2.090.329	Sandvik AB	40.782.306	2,66
238.386	Pernod-Ricard SA	49.751.158	3,24	Total Suède		82.002.564	5,35
486.897	Schneider Electric SE	74.826.331	4,89	ROYAUME-UNI			
Total France		354.302.407	23,12	111.363	Lonza Group AG - Reg	61.419.138	4,01
ALLEMAGNE			ROYAUME-UNI (suite)				
681.022	Brenntag SE	47.126.722	3,08	884.567	Nestle SA - Reg	99.336.252	6,48
228.494	Hannover Rueck SE - Reg	41.208.892	2,69	17.091	Partners Group Holding AG - Reg	14.753.835	0,96
87.305	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG - Reg	28.155.863	1,84	105.370	Roche Holding AG	27.703.349	1,81
457.154	SAP SE	53.057.293	3,47	113.054	Sika AG	29.102.804	1,90
339.077	Siemens Healthineers AG	17.977.863	1,17	83.978	VAT Group AG	27.769.119	1,81
540.866	Zalando SE	20.844.976	1,36	Total Suisse		260.084.497	16,97
Total Allemagne		208.371.609	13,61	ROYAUME-UNI (suite)			
ITALIE			ROYAUME-UNI (suite)				
2.516.341	Fincobank Banca Fineco SpA	35.581.062	2,33	2.596.632	Allfunds Group plc	15.787.522	1,04
1.746.641	Nexi SpA	13.075.355	0,85	Total Royaume-Uni		15.787.522	1,04
Total Italie		48.656.417	3,18	Total Actions			
PAYS-BAS			Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				
6.342	Adyen NV	9.254.246	0,60	1.505.974.526			
71.576	ASM International NV	26.619.114	1,74	98,30			
137.341	ASML Holding NV	85.865.594	5,60				
4.135.926	Davide Campari-Milano NV	46.529.168	3,04				
270.157	IMCD NV	40.631.613	2,65				
188.305	Koninklijke DSM NV	20.468.754	1,34				
751.317	STMicroelectronics NV	36.776.967	2,40				
Total Pays-Bas		266.145.456	17,37				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Select

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Fonds		
IRLANDE		
268.997 BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	26.590.262	1,74
10.204 ILF EUR Liquidity Fund	991.817	0,06
Total Irlande	27.582.079	1,80
Total Fonds	27.582.079	1,80
Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	27.582.079	1,80
Valeur totale des investissements	1.533.556.605	100,10

(Coût total : 1.238.142.720 EUR)

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions			Actions (suite)				
BELGIQUE			ALLEMAGNE (suite)				
898.717	Azelis Group NV	20.994.029	1,45	324.573	Stabilus SE	20.902.501	1,45
2.449	Lotus Bakeries NV	15.796.050	1,09	226.925	STRATEC SE	14.205.505	0,98
345.221	Melexis NV	36.731.514	2,54		Total Allemagne	243.115.535	16,82
365.673	Umicore SA	11.412.654	0,79				
	Total Belgique	84.934.247	5,87				
DANEMARK			ISLANDE				
988.925	ALK-Abello AS	14.085.216	0,97	4.986.949	Marel HF	18.750.928	1,30
286.655	Simcorp A/S	19.963.849	1,38		Total Islande	18.750.928	1,30
1.458.911	Tryg A/S	29.357.239	2,03				
	Total Danemark	63.406.304	4,38				
FINLANDE			IRLANDE				
227.331	Cargotec Oyj	10.179.882	0,70	3.948.632	AIB Group plc	14.775.781	1,02
706.564	Huhtamaki Oyj	24.164.489	1,67	2.948.273	Dalata Hotel Group Limited	12.353.264	0,86
578.834	Konecranes Oyj	17.851.241	1,24	2.725.080	Irish Continental Group plc	11.894.974	0,83
448.364	Musti Group Oyj	7.223.144	0,50	234.563	Kingspan Group plc	14.786.852	1,02
218.963	Revenio Group Oyj	8.460.730	0,59		Total Irlande	53.810.871	3,73
460.475	Vaisala Oyj	18.303.881	1,27				
	Total Finlande	86.183.367	5,97				
FRANCE			ITALIE				
1.291.970	Bureau Veritas SA	34.198.447	2,37	140.219	Diasorin SpA	13.609.656	0,94
323.447	Edenred	17.640.799	1,22	2.301.428	Fincombank Banca Fineco SpA	32.542.192	2,25
1.475.565	Elis SA	26.028.967	1,80	2.629.360	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	31.867.843	2,21
71.507	Gaztransport et Technigaz SA	6.735.959	0,47	547.678	Intercos SpA	7.289.594	0,50
144.080	Remy Cointreau SA	24.205.440	1,68	403.022	Interpump Group SpA	20.816.086	1,44
109.910	SEB SA	11.518.568	0,80	617.980	MARR SpA	8.182.055	0,57
934.608	Verallia SA	36.730.094	2,55	1.444.177	Nexi SpA	10.811.109	0,75
	Total France	157.058.274	10,89	1.457.144	Technoprobe SpA	9.716.236	0,67
ALLEMAGNE			LUXEMBOURG				
52.201	Atoss Software AG	8.696.687	0,60	372.636	Eurofins Scientific SE	22.969.283	1,59
327.720	Brenntag SE	22.678.224	1,57		Total Luxembourg	22.969.283	1,59
536.325	CANCOM SE	16.894.238	1,17				
124.273	Carl Zeiss Meditec AG	15.906.944	1,10				
571.164	CompuGroup Medical SE & Company KGaA	27.061.750	1,87				
612.086	CTS Eventim AG & Company KGaA	35.164.341	2,43				
165.174	Gerresheimer AG	15.055.610	1,04				
352.369	Nemetschek SE	22.297.910	1,55				
257.530	Puma SE	14.643.156	1,01				
16.643	Rational AG	10.268.731	0,71				
49.974	Sartorius AG	19.339.938	1,34				
PAYS-BAS			ESPAGNE				
113.692	ASM International NV	42.282.055	2,93	1.445.765	Fluidra SA	23.406.935	1,62
221.688	BE Semiconductor Industries NV	17.757.209	1,23	134.147	Viscofan SA	8.853.702	0,61
2.558.881	Davide Campari-Milano NV	28.787.411	1,99		Total Espagne	32.260.637	2,23
247.997	IMCD NV	37.298.749	2,58				
	Total Pays-Bas	126.125.424	8,73				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*				
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire						
Actions (suite)			Actions						
SUÈDE			DANEMARK						
1.339.050	Avanza Bank Holding AB	28.882.349	2,00	280.528	Ow Bunker A/S**	0	0,00		
2.189.646	Elekta AB - B	15.369.864	1,06	Total Danemark		0	0,00		
3.208.660	Fortnox AB	20.198.628	1,40	Total Actions			0	0,00	
776.668	Hemnet Group AB	12.036.746	0,83	Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			0	0,00	
989.485	Hexpol AB	11.286.045	0,78	Organismes de placement collectif en valeurs mobilières					
228.687	MIPS AB	10.628.465	0,74	Fonds					
1.332.347	Nordnet AB publ	20.193.310	1,40	IRLANDE					
603.290	Thule Group AB	13.639.062	0,94	177.747	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	17.570.241	1,22		
145.906	Vitrolife AB	2.787.051	0,19	Total Irlande		17.570.241	1,22		
Total Suède			135.021.520	9,34	Total Fonds			17.570.241	1,22
SUISSE			Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières			17.570.241	1,22		
79.420	Belimo Holding AG	35.287.953	2,45	Valeur totale des investissements			1.435.047.467	99,34	
54.690	Burckhardt Compression Holding AG	31.297.833	2,17	(Coût total : 1.097.203.125 EUR)					
18.744	Inficon Holding AG	18.639.636	1,29	<i>*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.</i>					
11.394	LEM Holding SA	22.569.282	1,55	<i>**Titre à la juste valeur.</i>					
1.601.929	SIG Group AG	37.961.082	2,63						
112.193	Sika AG	28.881.162	2,00						
173.749	SKAN Group AG	14.652.299	1,02						
62.911	Tecan Group AG - Reg	25.303.181	1,76						
98.482	VAT Group AG	32.565.176	2,25						
Total Suisse			247.157.604	17,12					
ROYAUME-UNI									
1.948.760	Allfunds Group plc	11.848.461	0,82						
Total Royaume-Uni			11.848.461	0,82					
Total Actions			1.417.477.226	98,12					
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			1.417.477.226	98,12					

Au cours de la période de rapport précédente (du 1^{er} octobre 2022 au 31 mars 2023), le portefeuille de Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies Fund a respecté la limite d'investissement du PEA de 75 % minimum en Actions émises dans et cotées sur une Bourse de l'Espace économique européen. Le montant au 31 mars 2023 était de 81,06 %.

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions (suite)		
TAÏWAN		
121.625 Chailease Holding Company Limited	892.777	1,71
146.000 Chroma ATE Inc.	851.126	1,63
94.000 Delta Electronics Inc.	929.260	1,78
233.000 Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	4.078.740	7,81
120.000 Unimicron Technology Corp.	581.321	1,11
52.000 Yageo Corp.	903.446	1,73
Total Taïwan	8.236.670	15,77
THAÏLANDE		
1.144.600 Thai Beverage plc	542.362	1,04
322.063 Thai Oil plc	494.467	0,95
Total Thaïlande	1.036.829	1,99
Total Actions	51.275.240	98,14
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	51.275.240	98,14
Valeur totale des investissements	51.275.240	98,14
(Coût total : 49.295.163 USD)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions			Actions (suite)				
ÎLES CAÏMANS			ÉTATS-UNIS (suite)				
48.989	Globalfoundries Inc.	3.536.026	0,55	617.914	Dropbox Inc. - A	13.359.301	2,08
240.374	SMART Global Holdings Inc.	4.144.048	0,64	126.457	DXC Technology Company	3.232.241	0,50
	Total Îles Caïmans	7.680.074	1,19	260.103	Ebay Inc.	11.540.770	1,79
ALLEMAGNE			379.313	Eiger Biopharmaceuticals Inc.	340.206	0,05	
317.128	TeamViewer AG	5.393.832	0,84	52.679	F5 Inc.	7.674.804	1,19
	Total Allemagne	5.393.832	0,84	62.395	Fidelity National Information Services Inc.	3.389.920	0,53
ISRAËL			61.991	Fiserv Inc.	7.006.843	1,09	
43.748	Check Point Software Technologies	5.687.239	0,88	195.669	Fortinet Inc.	13.004.162	2,02
20.002	Cyberark Software Limited	2.959.896	0,46	481.748	Gen Digital Inc.	8.266.796	1,29
45.819	Tower Semiconductor Limited	1.945.933	0,30	188.603	GoDaddy Inc.	14.658.225	2,28
	Total Israël	10.593.068	1,64	101.902	HireRight Holdings Corp.	1.081.180	0,17
JAPON			75.891	Lam Research Corp.	40.231.336	6,26	
1.448.500	Renesas Electronics Corp.	20.825.786	3,24	115.587	Lumentum Holdings Lite US	6.242.854	0,97
163.400	SUMCO Corp.	2.432.153	0,38	311.087	Marvell Technology Inc.	13.470.067	2,09
	Total Japon	23.257.939	3,62	59.023	Match Group Inc.	2.265.893	0,35
PAYS-BAS			128.981	Microchip Technology Inc.	10.806.028	1,68	
56.071	NXP Semiconductor NV	10.455.840	1,63	81.223	Microsoft Corp.	23.416.592	3,64
	Total Pays-Bas	10.455.840	1,63	32.108	National Instruments Corp.	1.682.780	0,26
SUÈDE			179.984	NetApp Inc.	11.491.978	1,79	
572.585	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - ADR	3.349.622	0,52	58.688	ON Semiconductor Corp.	4.831.196	0,75
	Total Suède	3.349.622	0,52	168.007	Oracle Corp.	15.611.210	2,43
ÉTATS-UNIS			70.761	Palo Alto Networks Inc.	14.133.803	2,20	
119.680	Activision Blizzard Inc.	10.243.411	1,59	93.042	Qorvo Inc.	9.450.276	1,47
451.459	Adeia Inc.	3.999.927	0,62	4.260	QUALCOMM Inc.	543.491	0,08
111.675	Advanced Energy Industries Inc.	10.944.150	1,70	128.953	Rambus Inc.	6.610.131	1,03
233.631	Alphabet Inc. - A	24.234.544	3,76	21.890	Salesforce Inc.	4.373.184	0,68
93.781	Alphabet Inc. - C	9.753.224	1,52	10.987	Skyworks Solutions Inc.	1.296.246	0,20
103.995	Analog Devices Inc.	20.509.894	3,19	32.613	Splunk Inc.	3.126.934	0,49
227.800	Apple Inc.	37.564.220	5,83	156.604	Synaptics Inc.	17.406.535	2,71
179.453	Applied Materials Inc.	22.042.212	3,43	59.711	Synopsys Inc.	23.063.374	3,59
55.713	Arista Networks Inc.	9.351.984	1,45	42.022	Tenable Holdings Inc.	1.996.465	0,31
759.191	Bloom Energy Corp.	15.130.677	2,35	219.287	Teradyne Inc.	23.575.545	3,67
47.663	Broadcom Inc.	30.577.721	4,75	136.507	Thoughtworks Holding Inc.	1.004.692	0,16
83.178	Cerence Inc.	2.336.470	0,36	17.629	T-Mobile USA Inc.	2.553.384	0,40
83.223	Comcast Corp.	3.154.984	0,49	76.490	Visa Inc. - A	17.245.435	2,68
167.344	Dell Technologies Inc. - C	6.728.902	1,05	42.733	VMware Inc. - A	5.335.215	0,83
				191.894	Western Digital Corp.	7.228.647	1,12
					Total États-Unis	559.120.059	86,92
					Total Actions	619.850.434	96,36
					Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	619.850.434	96,36
					Valeur totale des investissements	619.850.434	96,36
					(Coût total : 505.613.589 USD)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en GBP	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en GBP	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
IRLANDE			ROYAUME-UNI (suite)		
113.041 CRH plc	4.613.768	2,76	284.138 Smith & Nephew plc	3.188.028	1,91
35.317 DCC plc	1.666.256	1,00	55.943 Spectris plc	2.046.954	1,23
156.357 Experian plc	4.159.096	2,49	221.555 SSE plc	3.994.637	2,39
Total Irlande	10.439.120	6,25	1.028.764 SSP Group plc	2.531.788	1,51
			307.039 St James's Place plc	3.718.242	2,22
			380.707 Standard Chartered plc	2.338.302	1,40
			634.595 Synthomer plc	740.572	0,44
			345.652 Tate & Lyle plc	2.711.986	1,62
			1.463.535 Tesco plc	3.888.612	2,33
			197.087 Unilever plc	8.257.945	4,93
			199.478 Weir Group plc	3.708.296	2,22
			149.583 Whitbread plc	4.468.044	2,67
			Total Royaume-Uni	151.539.216	90,57
			Total Actions	164.623.185	98,40
			Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	164.623.185	98,40
			Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
			Fonds		
			IRLANDE		
			863.488 BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	863.488	0,52
			Total Irlande	863.488	0,52
			Total Fonds	863.488	0,52
			Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	863.488	0,52
			Valeur totale des investissements	165.486.673	98,92
			(Coût total : 162.652.378 GBP)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en GBP	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en GBP	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions			Actions (suite)				
GUERNESEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES			ROYAUME-UNI (suite)				
3.451.163	Sherborne Investors Guernsey C Limited	1.811.861	0,75	187.189	Unilever plc	7.843.219	3,26
				111.180	Whitbread plc	3.320.947	1,38
				1.063.628	Wincanton plc	2.297.436	0,95
	Total Guernesey - Îles Anglo-Normandes	1.811.861	0,75		Total Royaume-Uni	237.032.176	98,44
ROYAUME-UNI			Total Actions				
632.650	3i Group plc	10.660.153	4,43			238.844.037	99,19
110.603	Astrazeneca plc	12.422.929	5,15	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			
722.523	BAE Systems plc	7.099.511	2,95			238.844.037	99,19
4.558.314	BT Group plc	6.646.022	2,76	Organismes de placement collectif en valeurs mobilières			
5.336.559	Centrica plc	5.659.421	2,35	Fonds			
828.289	Chesnara plc	2.484.867	1,03	IRLANDE			
302.267	Compass Group plc	6.145.088	2,55	1.055.454	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.055.454	0,44
2.475.424	Direct Line Insurance Group plc	3.403.708	1,41		Total Irlande	1.055.454	0,44
1.168.669	DS Smith plc	3.675.464	1,53	Total Fonds			
955.044	Elementis plc	1.137.457	0,47			1.055.454	0,44
66.514	Ferguson plc	7.083.741	2,94	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières			
714.647	GSK plc	10.212.306	4,24			1.055.454	0,44
969.400	Haleon plc	3.121.468	1,30	Valeur totale des investissements			
3.887.726	Hays plc	4.334.814	1,80			239.899.491	99,63
223.780	Hikma Pharmaceuticals plc	3.748.315	1,56	(Coût total : 229.385.981 GBP)			
121.686	Hostmore plc	15.381	0,01	<i>*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.</i>			
271.010	IMI plc	4.157.293	1,73				
707.450	Imperial Brands plc	13.186.868	5,48				
4.964.720	ITV plc	4.110.788	1,71				
194.613	Johnson Matthey plc	3.860.149	1,61				
2.460.165	Legal & General Group plc	5.877.334	2,44				
3.207.600	Marks & Spencer Group plc	5.356.692	2,22				
1.832.170	Melrose Industries plc	3.050.563	1,27				
552.429	Morgan Advanced Materials plc	1.563.374	0,65				
163.996	Morgan Sindall plc	2.771.532	1,15				
213.140	Oxford Instruments plc	5.339.157	2,22				
1.099.007	Pearson plc	9.280.015	3,85				
188.811	Pennon Group plc	1.650.208	0,69				
1.399.397	Phoenix Group Holdings plc	7.646.305	3,18				
1.333.040	Rank Group plc	974.452	0,40				
302.450	RELX plc	7.918.141	3,29				
2.299.439	Rentokil Initial plc	13.603.481	5,64				
1.691.034	RS Group plc	15.456.051	6,41				
417.653	Smith & Nephew plc	4.686.067	1,95				
377.113	Smiths Group plc	6.473.145	2,68				
182.555	SSE plc	3.291.467	1,37				
749.745	Tate & Lyle plc	5.882.499	2,45				
2.195.313	Tesco plc	5.832.947	2,42				
391.881	Travis Perkins plc	3.747.950	1,56				
40.597	Unbound Group plc	3.451	0,00				

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance			Actions (suite)		
ÉTATS-UNIS			ÉTATS-UNIS (suite)		
22.850 Liveperson Inc. 0.00%	100.769	0,51	913 Herc Holdings Inc.	103.991	0,53
Total États-Unis	100.769	0,51	1.408 Hess Corp.	186.335	0,95
Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance	100.769	0,51	3.703 Hilton Worldwide Holdings Inc.	521.642	2,66
Actions			1.863 Hostess Brands Inc.	46.351	0,24
CANADA			580 Installed Building Products Inc.	66.137	0,34
3.682 Ritchie Bros Auctioneers Inc.	207.260	1,06	1.440 Intuitive Surgical Inc.	367.877	1,87
Total Canada	207.260	1,06	6.247 Kellogg Company	418.299	2,13
ÎLES CAÏMANS			7.006 Kontoor Brands Inc.	339.020	1,73
6.247 Globalfoundries Inc.	450.908	2,30	1.576 Lam Research Corp.	835.469	4,25
Total Îles Caïmans	450.908	2,30	59.433 Latham Group Inc.	169.978	0,87
CURAÇAO			10.425 Marvell Technology Inc.	451.403	2,30
5.020 Schlumberger Limited	246.482	1,26	6.010 Northern Trust Corp.	529.661	2,70
Total Curaçao	246.482	1,26	41.091 NOV Inc.	760.594	3,87
JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES			8.492 Nutanix Inc. - A	220.707	1,12
11.453 Clarivate plc	107.544	0,55	2.484 Planet Fitness Inc.	192.932	0,98
Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	107.544	0,55	3.957 Procter & Gamble Company	588.366	3,00
ÉTATS-UNIS			5.300 Prologis Inc.	661.281	3,37
11.147 Advanced Micro Devices Inc.	1.092.517	5,56	3.253 QUALCOMM Inc.	415.018	2,11
27.087 AES Corp.	652.255	3,32	8.719 REVOLUTION Medicines Inc.	188.854	0,96
4.742 Alphabet Inc. - A	491.888	2,51	296 S&P Global Inc.	102.052	0,52
1.920 Applied Industrial Technologies Inc.	272.889	1,39	3.318 Salesforce Inc.	662.871	3,37
11.700 Aris Water Solutions Inc.	91.143	0,46	3.564 Schnitzer Steel Industries Inc.	110.840	0,56
3.400 Beacon Roofing Supply Inc.	200.090	1,02	75.149 Sharecare Inc.	106.712	0,54
1.783 BioMarin Pharmaceuticals Inc.	173.379	0,88	1.428 Sherwin-Williams Company	320.972	1,64
2.048 Catalent Inc.	134.574	0,69	1.045 Shift4 Payments Inc.	79.211	0,40
492 Cintas Corp.	227.638	1,15	3.248 Stanley Black & Decker Inc.	261.724	1,33
2.037 Cirrus Logic Inc.	222.807	1,14	7.590 State Street Corp.	574.488	2,93
3.082 Coca Cola Company	191.176	0,97	5.240 Teradata Corp.	211.067	1,08
869 Conmed Corp.	90.254	0,46	2.449 Teradyne Inc.	263.292	1,34
2.955 CrowdStrike Holdings Inc. - A	405.603	2,07	3.340 TransUnion	207.548	1,06
6.753 Darling International Inc.	394.375	2,01	2.419 Trimble Inc.	126.804	0,65
7.175 Domo Inc.	101.813	0,52	20.385 Uber Technologies Inc.	646.205	3,29
3.925 Electronic Arts Inc.	472.766	2,41	1.080 United Parcel Service Inc.	209.509	1,07
2.078 Exact Sciences Corp.	140.909	0,72	1.229 Vertex Pharmaceuticals Inc.	387.221	1,98
567 Goldman Sachs Group Inc.	185.471	0,94	2.462 Voya Financial Inc.	175.935	0,90
			1.609 Walt Disney Company	161.109	0,82
			4.502 Westrock Company	137.176	0,70
			6.220 WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	291.594	1,48
			2.954 Xponential Fitness Inc.	89.772	0,46
			Total États-Unis	17.731.564	90,32
			Total Actions	18.743.758	95,49
			Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	18.844.527	96,00

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Fonds		
IRLANDE		
3.647 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.647	0,02
Total Irlande	3.647	0,02
Total Fonds	3.647	0,02
Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	3.647	0,02
Valeur totale des investissements	18.848.174	96,02
(Coût total : 18.253.926 USD)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

État du Portefeuille

(suite)

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
ALLEMAGNE (suite)				ITALIE (suite)					
EUR	2.700.000	Volkswagen Financial Services AG 0.88% 31/01/2028	2.320.015	0,54	EUR	100.000	Lottomatica SpA 5.13% 15/07/2025	98.832	0,02
EUR	500.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	468.940	0,11	EUR	362.000	Lottomatica SpA 6.25% 15/07/2025	361.779	0,09
Total Allemagne			41.329.791	9,64	EUR	1.096.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	1.164.879	0,27
GIBRALTAR				ITALIE (suite)					
EUR	525.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	446.947	0,10	EUR	1.500.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.489.954	0,35
Total Gibraltar			446.947	0,10	EUR	790.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	808.338	0,19
GRÈCE				Total Italie					
EUR	2.400.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029	2.339.648	0,55	8.062.168				
Total Grèce			2.339.648	0,55	1,88				
INDE				JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES					
USD	2.080.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.464.700	0,35	EUR	286.352	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	285.721	0,07
USD	1.729.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	1.397.684	0,32	EUR	6.500.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	6.479.692	1,51
Total Inde			2.862.384	0,67	GBP	416.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	504.532	0,12
IRLANDE				Total Jersey - Îles Anglo-Normandes					
EUR	1.275.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.156.400	0,27	7.269.945				
EUR	1.716.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	1.602.431	0,37	1,70				
EUR	3.710.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	3.189.797	0,74	LUXEMBOURG				
EUR	2.747.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	2.609.846	0,61	EUR	1.423.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	1.137.956	0,27
Total Irlande			8.558.474	1,99	EUR	2.882.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	2.163.647	0,50
ÎLE DE MAN				JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES					
EUR	1.207.547	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.204.162	0,28	EUR	3.300.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.215.220	0,52
Total Île de Man			1.204.162	0,28	EUR	3.600.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	2.241.273	0,52
ITALIE				JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES					
EUR	709.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	700.799	0,16	GBP	1.855.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	1.334.546	0,31
EUR	1.444.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	1.239.299	0,29	EUR	2.826.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	2.310.617	0,54
EUR	2.461.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	2.198.288	0,51	EUR	603.559	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	603.502	0,14
				JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES					
				Total Jersey - Îles Anglo-Normandes					
				7.269.945					
				1,70					
				LUXEMBOURG					
				Total Luxembourg					
				1,88					

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
LUXEMBOURG (suite)					PAYS-BAS (suite)				
EUR	1.500.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	1.400.085	0,33	EUR	3.635.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	3.540.992	0,82
EUR	840.000	Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	810.587	0,19	EUR	1.038.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	984.104	0,23
EUR	3.200.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	3.172.661	0,74	Total Pays-Bas				
EUR	3.835.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	2.884.242	0,66	45.693.920 10,66				
EUR	1.673.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	1.556.251	0,36	ESPAGNE				
EUR	2.340.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	2.150.756	0,50	EUR	2.800.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	2.334.070	0,54
Total Luxembourg					EUR	1.503.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.371.386	0,32
					EUR	2.400.000	International Consolidated Airlines Group SA 0.50% 04/07/2023	2.377.794	0,56
PAYS-BAS					EUR	2.439.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	2.245.648	0,52
EUR	702.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	728.850	0,17	Total Espagne				
EUR	1.000.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	989.923	0,23	8.328.898 1,94				
EUR	4.300.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	4.199.798	0,98	SUÈDE				
EUR	4.600.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2169	3.520.986	0,82	EUR	817.623	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	787.017	0,18
EUR	3.600.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2170	3.109.287	0,73	EUR	3.731.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	3.457.449	0,80
EUR	3.028.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	2.946.715	0,69	EUR	2.306.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.874.479	0,44
GBP	1.718.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	2.062.023	0,48	EUR	1.252.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.113.464	0,26
USD	4.600.000	ING Groep NV FRN 16/11/2170	3.074.923	0,72	EUR	170.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	151.189	0,04
EUR	1.000.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	974.889	0,23	EUR	380.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	381.169	0,09
EUR	1.391.000	Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	1.020.323	0,24	EUR	642.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	690.523	0,16
EUR	4.700.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	3.895.402	0,90	Total Suède				
EUR	2.920.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	2.458.514	0,57	8.455.290 1,97				
EUR	3.140.000	Stichting AK Rabobank Certificaten 6.50% 29/03/2070	3.040.178	0,71	SUISSE				
EUR	2.738.715	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	2.148.887	0,50	USD	2.876.000	Credit Suisse AG 5.00% 09/07/2027	2.551.194	0,60
EUR	300.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	306.068	0,07	EUR	3.100.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	2.035.512	0,47
EUR	1.600.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	1.333.326	0,31	USD	5.205.000	UBS Group AG Perp FRN	4.552.287	1,06
EUR	900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	880.514	0,21	Total Suisse				
EUR	4.200.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.154.511	0,74	9.138.993 2,13				
EUR	1.430.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	1.323.707	0,31	ROYAUME-UNI				
					EUR	2.300.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	1.713.146	0,40
					GBP	1.973.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	1.467.257	0,34
					EUR	2.838.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	2.316.608	0,54

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Obligations (suite)					Obligations (suite)				
ROYAUME-UNI (suite)					ROYAUME-UNI (suite)				
GBP	397.500	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	421.973	0,10	EUR	1.609.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	1.387.808	0,32
EUR	2.258.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	1.821.672	0,43	EUR	3.220.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	2.963.488	0,69
GBP	3.028.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	3.234.938	0,75	GBP	1.769.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.802.818	0,42
GBP	1.801.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	1.711.842	0,40	GBP	4.904.213	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	5.531.644	1,29
EUR	3.308.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	3.057.584	0,71	GBP	1.940.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	1.955.072	0,46
EUR	6.500.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	6.336.285	1,48	EUR	1.490.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	1.208.422	0,28
EUR	6.600.000	HSBC Holdings plc FRN 04/01/2066	5.336.167	1,24	EUR	695.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	568.864	0,13
GBP	1.001.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	1.198.124	0,28	GBP	2.767.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.00% 31/01/2029	2.611.455	0,62
EUR	521.000	INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025	489.857	0,11	USD	3.500.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	3.153.785	0,74
EUR	1.337.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	1.254.423	0,29	GBP	1.400.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	1.504.886	0,35
EUR	1.217.000	INEOS Finance plc 6.63% 15/05/2028	1.229.062	0,29	GBP	3.634.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	3.128.935	0,73
EUR	787.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	708.357	0,17	Total Royaume-Uni			82.716.784	19,31
EUR	294.217	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	292.807	0,07	ÉTATS-UNIS				
EUR	2.200.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	2.128.494	0,50	EUR	2.541.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	2.558.801	0,60
EUR	1.466.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	1.443.057	0,34	USD	1.426.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	1.207.238	0,28
GBP	2.376.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	2.342.825	0,55	USD	932.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	877.562	0,20
GBP	1.251.766	Mitchells & Butlers Finance plc 5.57% 15/12/2030	1.380.650	0,32	EUR	2.086.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	1.727.464	0,40
GBP	49.877	Mitchells & Butlers Finance plc 5.97% 15/12/2023	55.912	0,01	EUR	920.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	723.975	0,17
GBP	2.033.412	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	2.159.780	0,51	USD	1.853.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	1.424.515	0,33
EUR	1.117.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	1.095.554	0,26	EUR	2.453.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 1.50% 18/03/2030	2.159.228	0,50
EUR	2.253.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	1.823.853	0,43	EUR	1.050.000	Berry Global Inc. 1.00% 15/01/2025	998.735	0,23
EUR	1.856.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	1.521.236	0,35	EUR	1.630.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	1.470.409	0,34
EUR	3.866.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	3.256.305	0,76	EUR	5.114.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	4.196.423	0,99
EUR	2.140.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	1.984.758	0,46	EUR	1.208.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	1.189.044	0,28
GBP	3.100.000	Santander UK plc Perp 10.06%	5.117.081	1,19	EUR	3.073.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	2.952.086	0,68
					EUR	3.019.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	2.930.392	0,68

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

État du Portefeuille

(suite)

	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*				
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises							
Obligations (suite)				Obligations							
ÉTATS-UNIS (suite)				PAYS-BAS							
GBP	1.608.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	1.828.210	0,43	USD	2.956.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	2.702.106	0,63		
USD	2.819.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	2.174.032	0,51	Total Pays-Bas						
USD	1.840.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	1.407.413	0,33	2.702.106 0,63						
USD	1.829.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	1.415.654	0,33	ÉTATS-UNIS						
USD	810.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	753.530	0,18	USD	860.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	888.694	0,21		
GBP	962.000	Morgan Stanley FRN 18/11/2033	1.116.758	0,26	Total États-Unis						
GBP	810.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	877.354	0,20	888.694 0,21						
EUR	1.242.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.198.965	0,28	Total Obligations						
EUR	4.000.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	3.936.012	0,92	3.590.800 0,84						
EUR	640.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	654.259	0,15	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises						
USD	845.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	821.975	0,19	3.590.800 0,84						
USD	775.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	783.328	0,18	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire						
USD	1.430.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	1.532.566	0,36	Obligations						
USD	1.338.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	1.095.451	0,26	AUSTRALIE						
EUR	4.149.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	4.052.255	0,95	USD	3.582.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	3.192.496	0,74		
GBP	3.515.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	3.862.174	0,90	Total Australie						
USD	5.735.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	4.286.037	1,00	3.192.496 0,74						
Total États-Unis			58.651.022	13,69	BERMUDES						
Total Obligations			368.284.669	85,92	USD	9.121.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	8.344.218	1,95		
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				PORTUGAL							
ALLEMAGNE				ROYAUME-UNI							
GBP	11.400.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	11.645.664	2,72	EUR	12.900.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	1.419.000	0,33		
Total Allemagne			11.645.664	2,72	Total Portugal						
Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance			11.645.664	2,72	1.419.000 0,33						
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs				379.930.333	88,64	ROYAUME-UNI					
				GBP				4.319.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	4.612.257	1,08
				GBP				2.009.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	1.915.016	0,45
				Total Royaume-Uni				6.527.273	1,53		
				Total Obligations				19.482.987	4,55		
				Total Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				19.482.987	4,55		

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Fonds		
IRLANDE		
10.122 BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	1.000.544	0,23
951.941 BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.083.370	0,25
45.545 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	41.921	0,01
33.057 Insight Liquidity Funds plc	37.621	0,01
Total Irlande	2.163.456	0,50
Total Fonds	2.163.456	0,50
Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	2.163.456	0,50
Valeur totale des investissements	405.167.576	94,53
(Coût total : 456.035.102 EUR)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

**Titre à la juste valeur.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)						
Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale	Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Obligations			Obligations (suite)						
AUSTRALIE			FRANCE						
EUR	174.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	128.293	0,72	USD	300.000	BNP Paribas SA FRN 12/07/2171	216.104	1,21
USD	139.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	123.885	0,69	EUR	200.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	144.027	0,81
EUR	100.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	76.294	0,43	EUR	100.000	BPCE SA FRN 02/03/2030	101.466	0,57
EUR	228.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	181.348	1,01	EUR	200.000	Credit Agricole SA 4.00% 18/01/2033	204.308	1,14
EUR	190.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 03/02/2033	190.265	1,06	EUR	100.000	Electricite de France SA 4.25% 25/01/2032	99.306	0,56
EUR	100.000	NBN Company Limited 4.38% 15/03/2033	103.645	0,58	EUR	141.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	114.975	0,64
GBP	110.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	124.104	0,70	EUR	100.000	La Banque Postale SA FRN 26/01/2031	88.352	0,49
USD	150.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	133.299	0,75	Total France		968.538	5,42	
Total Australie		1.061.133	5,94	ALLEMAGNE					
BELGIQUE			IRLANDE						
EUR	200.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	167.864	0,94	EUR	300.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	247.989	1,38
EUR	200.000	Kbc Group NV Perp FRN	169.069	0,95	EUR	300.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	221.740	1,24
Total Belgique		336.933	1,89	EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	82.365	0,46	
ÎLES CAÏMANS			ITALIE						
GBP	100.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	98.579	0,55	EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 18/01/2030	98.622	0,55
GBP	200.000	Thames Water Kemble Finance plc 2.38% 03/05/2023	227.008	1,27	EUR	200.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	157.876	0,88
Total Îles Caïmans		325.587	1,82	EUR	1.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 05/05/2027	889.494	4,97	
DANEMARK			IRLANDE						
USD	242.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	195.066	1,09	EUR	300.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	309.920	1,73
Total Danemark		195.066	1,09	Total Allemagne		2.008.006	11,21		
FINLANDE			IRLANDE						
EUR	203.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	172.132	0,96	EUR	125.000	Aib Group plc FRN 30/05/2031	113.373	0,63
Total Finlande		172.132	0,96	EUR	190.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	163.359	0,91	
DANEMARK			ITALIE						
USD	242.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	195.066	1,09	EUR	140.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	113.536	0,63
Total Danemark		195.066	1,09	Total Italie		113.536	0,63		
FINLANDE			JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES						
EUR	203.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	172.132	0,96	GBP	96.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	116.431	0,65
Total Finlande		172.132	0,96	Total Jersey - Îles Anglo-Normandes		116.431	0,65		

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)					
Obligations (suite)				Obligations (suite)					
LUXEMBOURG				SUISSE (suite)					
EUR	200.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	134.256	0,75	EUR	100.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	65.662	0,37
EUR	200.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	124.515	0,70	USD	200.000	UBS Group AG Perp FRN	174.920	0,98
EUR	100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	70.704	0,40	Total Suisse				
EUR	200.000	Grand City Properties SA - Perp FRN	71.704	0,40	424.551 2,38				
USD	200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	189.732	1,07	ROYAUME-UNI				
EUR	268.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	201.558	1,13	GBP	149.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	136.929	0,77
EUR	231.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	212.318	1,19	EUR	100.000	Anglo American Capital plc 5.00% 15/03/2031	102.725	0,57
Total Luxembourg			1.004.787	5,64	EUR	100.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	74.485	0,42
PAYS-BAS				ROYAUME-UNI					
EUR	100.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	103.825	0,58	GBP	300.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	280.910	1,57
EUR	400.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2169	306.172	1,71	USD	69.000	BP Capital Markets plc FRN 22/09/2168	60.917	0,34
EUR	200.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2170	172.738	0,97	GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance plc T FRN 06/04/2027	106.834	0,60
GBP	130.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	156.032	0,87	EUR	32.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	31.194	0,17
USD	400.000	ING Groep NV FRN 16/11/2170	267.384	1,50	EUR	438.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	426.967	2,38
GBP	100.000	ING Groep NV FRN 20/05/2033	111.425	0,62	EUR	400.000	HSBC Holdings plc FRN 04/01/2066	323.403	1,81
EUR	160.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	132.609	0,74	GBP	100.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	119.693	0,67
EUR	387.000	Stedin Holding NV - Perp FRN 28/10/2034	325.838	1,83	GBP	40.187	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	42.253	0,24
EUR	100.000	TenneT Holding BV 4.50% 05/02/2032	107.685	0,60	GBP	85.086	Mitchells & Butlers Finance plc FRN 15/12/2028	88.724	0,50
EUR	100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	75.107	0,42	EUR	100.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	98.080	0,55
GBP	200.000	Volkswagen Financial Services NV 1.38% 14/09/2028	185.531	1,04	EUR	210.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	170.000	0,95
Total Pays-Bas			1.944.346	10,88	EUR	213.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	179.408	1,00
SUÈDE				ROYAUME-UNI					
EUR	468.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	380.424	2,12	GBP	100.000	Northumbrian Water Finance plc 4.50% 14/02/2031	108.176	0,60
Total Suède			380.424	2,12	GBP	150.000	Santander UK plc Perp 10.06%	247.601	1,38
SUISSE				ROYAUME-UNI					
EUR	100.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	78.910	0,44	GBP	161.706	Tesco Property Finance 1 plc 7.62% 13/07/2039	208.218	1,16
EUR	160.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	105.059	0,59	EUR	200.000	Thames Water Kemble Finance plc 0.19% 23/10/2023	196.317	1,10
					GBP	100.000	Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	112.398	0,63
					Total Royaume-Uni		3.115.232	17,41	

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

État du Portefeuille

(suite)

Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement		Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises					
Obligations (suite)				Obligations					
ÉTATS-UNIS				PAYS-BAS					
EUR	156.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	157.093	0,88	USD	50.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	45.705	0,26
USD	250.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	211.648	1,18	Total Pays-Bas				
USD	94.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	88.509	0,49	45.705 0,26				
USD	232.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	219.507	1,24	Total Obligations				
USD	147.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	113.008	0,63	45.705 0,26				
EUR	289.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	237.146	1,33	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises				
USD	181.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	139.588	0,78	45.705 0,26				
USD	131.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	101.395	0,57	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				
EUR	248.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	239.407	1,34	Obligations				
USD	119.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	97.428	0,54	BERMUDES				
USD	200.000	Stellantis Finance USA Inc. 6.38% 12/09/2032	193.219	1,08	USD	233.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	213.157	1,19
GBP	195.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	214.260	1,20	Total Bermudes				
USD	316.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	236.162	1,32	213.157 1,19				
Total États-Unis			2.248.370	12,58	Total Obligations				
Total Obligations			14.691.804	82,16	213.157 1,19				
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance				Organismes de placement collectif en valeurs mobilières					
ALLEMAGNE				Fonds					
GBP	700.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.13% 04/07/2025	746.360	4,17	IRLANDE				
Total Allemagne			746.360	4,17	7.720	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	763.152	4,27	
Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance			746.360	4,17	Total Irlande				
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			15.438.164	86,33	763.152 4,27				
				Total Fonds					
				763.152 4,27					
				Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières					
				763.152 4,27					
				Valeur totale des investissements					
				16.460.178 92,05					
				(Coût total : 18.185.794 EUR)					

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en EUR	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)		
Actions			Actions (suite)		
DANEMARK			SUISSE		
26.619 Novo Nordisk AS	3.879.952	4,97	21.107 Compagnie Financiere Richemont SA - Reg	3.102.700	3,97
22.018 Pandora A/S	1.937.176	2,48	18.528 Novartis AG - Reg	1.563.591	2,00
Total Danemark	5.817.128	7,45	3.470 Swatch Group AG - B	1.095.687	1,40
FRANCE			196.979 UBS Group AG	3.828.337	4,91
18.908 Air Liquide SA	2.915.614	3,73	Total Suisse	9.590.315	12,28
63.340 Compagnie de Saint-Gobain	3.313.949	4,24	ROYAUME-UNI		
871 Hermes International	1.623.544	2,08	199.217 3i Group plc	3.820.262	4,89
1.347 Kering SA	808.200	1,04	55.689 Burberry Group plc	1.638.946	2,10
4.523 Legrand SA	380.294	0,49	18.055 Compass Group plc	417.736	0,53
8.675 L'Oreal SA	3.567.594	4,57	59.716 InterContinental Hotels Group plc	3.610.070	4,62
4.520 LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	3.816.687	4,89	113.102 RELX plc	3.369.820	4,32
18.450 Pernod-Ricard SA	3.850.515	4,93	Total Royaume-Uni	12.856.834	16,46
49.718 Publicis Groupe SA	3.568.758	4,57	Total Actions	73.806.142	94,51
Total France	23.845.155	30,54	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs		
ALLEMAGNE			73.806.142 94,51		
30.804 Beiersdorf AG	3.694.940	4,73	Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Total Allemagne	3.694.940	4,73	Fonds		
ITALIE			IRLANDE		
47.063 Moncler SpA	2.990.383	3,83	17.816 BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	1.761.093	2,26
Total Italie	2.990.383	3,83	Total Irlande	1.761.093	2,26
JERSEY - ÎLES ANGLO-NORMANDES			Total Fonds		
333.818 WPP plc	3.641.782	4,66	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Total Jersey - Îles Anglo-Normandes	3.641.782	4,66	1.761.093 2,26		
PAYS-BAS			Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
2.241 ASM International NV	833.428	1,07	1.761.093 2,26		
1.363 ASML Holding NV	852.148	1,09	Valeur totale des investissements		
51.794 Davide Campari-Milano NV	582.683	0,75	75.567.235 96,77		
40.672 STMicroelectronics NV	1.991.097	2,55	(Coût total : 68.115.751 EUR)		
18.622 Wolters Kluwer NV	2.166.670	2,77	<i>*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.</i>		
Total Pays-Bas	6.426.026	8,23			
SUÈDE					
134.549 Epiroc AB	2.457.850	3,15			
127.408 Sandvik AB	2.485.729	3,18			
Total Suède	4.943.579	6,33			

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions			Actions (suite)				
CANADA			ÉTATS-UNIS (suite)				
13.212	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	743.703	0,84	18.065	Salesforce Inc.	3.609.025	4,06
	Total Canada	743.703	0,84	37.314	Schnitzer Steel Industries Inc.	1.160.465	1,31
				393.139	Sharecare Inc.	558.257	0,63
				6.315	Sherwin-Williams Company	1.419.423	1,60
				4.704	Shift4 Payments Inc.	356.563	0,40
				14.078	Stanley Black & Decker Inc.	1.134.405	1,28
				63.592	State Street Corp.	4.813.278	5,42
				29.050	Teradata Corp.	1.170.134	1,32
				6.949	Teradyne Inc.	747.087	0,84
				19.789	TransUnion	1.229.689	1,38
				10.880	Trimble Inc.	570.330	0,64
				89.177	Uber Technologies Inc.	2.826.911	3,18
				5.689	United Parcel Service Inc.	1.103.609	1,24
				5.719	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1.801.885	2,02
				22.793	Voya Financial Inc.	1.628.788	1,83
				4.710	Walt Disney Company	471.612	0,53
				25.276	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	1.184.939	1,33
				14.777	Xponential Fitness Inc.	449.073	0,51
					Total États-Unis	83.701.506	94,18
					Total Actions	87.275.196	98,20
					Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	87.275.196	98,20
					Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
					Fonds		
					IRLANDE		
				520.573	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	520.573	0,59
					Total Irlande	520.573	0,59
					Total Fonds	520.573	0,59
					Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	520.573	0,59
					Valeur totale des investissements	87.795.769	98,79
					(Coût total : 90.132.022 USD)		

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)				
Actions			Actions (suite)				
AUSTRALIE			JAPON				
3.874	CSL Limited	748.027	0,92	3.400	Keyence Corp.	1.646.479	2,04
	Total Australie	748.027	0,92	11.300	Sony Group Corp.	1.017.586	1,26
CANADA			PAYS-BAS				
6.865	Nutrien Limited	506.296	0,63	10.742	Akzo Nobel NV	840.053	1,04
	Total Canada	506.296	0,63	5.286	Koninklijke DSM NV	624.261	0,77
DANEMARK			NORVÈGE				
6.107	Novo Nordisk AS	967.102	1,19	43.152	Equinor ASA	1.230.728	1,52
14.739	Orsted A/S	1.254.091	1,54		Total Norvège	1.230.728	1,52
	Total Danemark	2.221.193	2,73	RÉPUBLIQUE DE CORÉE (DU SUD)			
FRANCE			1.455 Samsung Sdi Company Limited			821.468	1,01
26.964	AXA SA	825.095	1,02	Total République de Corée (du Sud)			
3.603	EssilorLuxottica SA	649.804	0,80		821.468	1,01	
1.956	L'Oreal SA	873.946	1,08	SINGAPOUR			
902	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	827.493	1,02	50.200	DBS Group Holdings Limited	1.245.985	1,54
5.310	Schneider Electric SE	886.588	1,09	Total Singapour			
38.973	TotalEnergies SE	2.301.723	2,85		1.245.985	1,54	
	Total France	6.364.649	7,86	SUISSE			
ALLEMAGNE			1.368 Lonza Group AG - Reg			819.707	1,01
3.514	Adidas AG	621.459	0,77	Total Suisse			
	Total Allemagne	621.459	0,77		819.707	1,01	
INDE			TAÏWAN				
237.673	HDFC Bank Limited	4.654.827	5,74	108.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	1.890.574	2,34
54.599	Kotak Mahindra Bank Limited	1.151.237	1,42	Total Taïwan			
	Total Inde	5.806.064	7,16		1.890.574	2,34	
INDONÉSIE			ROYAUME-UNI				
1.759.949	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	555.165	0,69	20.454	Anglo American plc	677.276	0,84
	Total Indonésie	555.165	0,69	22.167	Diageo plc	990.539	1,22
IRLANDE			16.953 Reckitt Benckiser Group plc			1.290.811	1,59
896	CRH plc	45.242	0,06	40.657	Shell plc	1.160.491	1,43
3.920	Linde plc	1.393.325	1,72	42.853	SSE plc	955.330	1,18
	Total Irlande	1.438.567	1,78	Total Royaume-Uni			
					5.074.447	6,26	

Les annexes font partie intégrante de ces comptes.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

État du Portefeuille

(suite)

Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Quantité Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs (suite)			Organismes de placement collectif en valeurs mobilières		
Actions (suite)			Fonds		
ÉTATS-UNIS			IRLANDE		
10.515 Abbott Laboratories	1.064.749	1,31	2.255.696 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.255.696	2,79
1.214 Adobe Inc.	467.839	0,58	Total Irlande	2.255.696	2,79
6.115 Advanced Micro Devices Inc.	599.331	0,74	Total Fonds	2.255.696	2,79
2.041 Alphabet Inc. - A	211.713	0,26	Total Organismes de placement collectif en valeurs mobilières	2.255.696	2,79
38.905 Amazon.com Inc.	4.018.498	4,97	Valeur totale des investissements	73.822.965	91,16
3.305 Cooper Companies Inc.	1.233.954	1,53	(Coût total : 70.911.032 USD)		
4.170 CrowdStrike Holdings Inc. - A	572.374	0,71			
1.856 Deere & Company	766.305	0,95			
13.904 Ecolab Inc.	2.301.529	2,84			
9.143 Electronic Arts Inc.	1.101.274	1,36			
2.808 Elevance Health Inc.	1.291.146	1,59			
4.376 Eli Lilly & Company	1.502.806	1,86			
642 Equinix Inc.	462.908	0,57			
8.077 IntercontinentalExchange Inc.	842.350	1,04			
4.837 Intuit Inc.	2.156.480	2,66			
2.986 JPMorgan Chase & Company	389.106	0,48			
3.192 Mastercard Inc. - A	1.160.005	1,43			
1.403 Mercadolibre Inc.	1.849.238	2,29			
14.375 Micron Technology Inc.	867.388	1,07			
9.829 NextEra Energy Inc.	757.619	0,94			
4.167 NVIDIA Corp.	1.157.468	1,43			
10.277 ON Semiconductor Corp.	846.003	1,04			
9.437 Paypal Holdings Inc.	716.646	0,88			
7.597 PepsiCo Inc.	1.384.933	1,71			
11.171 QUALCOMM Inc.	1.425.196	1,76			
2.395 Thermo Fisher Scientific Inc.	1.380.406	1,70			
22.200 T-Mobile USA Inc.	3.215.448	3,97			
15.502 Trimble Inc.	812.615	1,00			
51.644 Uber Technologies Inc.	1.637.115	2,02			
3.855 Union Pacific Corp.	775.857	0,96			
11.248 Walt Disney Company	1.126.262	1,39			
Total États-Unis	38.094.561	47,04			
Total Actions	71.567.269	88,37			
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs	71.567.269	88,37			

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

État du Portefeuille

au 31 mars 2023

Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*	Valeur nominale Investissement	Valeur de marché en USD	% de la valeur nette d'inventaire*				
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises						
Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance			Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance						
ÉTATS-UNIS			ÉTATS-UNIS						
USD 19.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 07/09/2023	18.613.453	9,33	USD 29.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 11/04/2023	28.970.516	14,52		
	Total États-Unis	18.613.453	9,33	USD 29.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 18/04/2023	28.945.022	14,51		
Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance			18.613.453	9,33	USD 30.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 25/04/2023	29.916.903	15,00	
Instruments structurés - Matières premières				USD 32.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 04/05/2023	31.874.828	15,99		
IRLANDE				USD 32.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 11/05/2023	31.846.141	15,97		
1.563	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	298.689	0,15	USD 17.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 18/05/2023	16.902.570	8,47		
	Total Irlande	298.689	0,15	Total États-Unis			168.455.980	84,46	
Total Instruments structurés - Matières premières			298.689	0,15	Total Émissions Supranationales, d'États et d'autorités publiques locales, titres de créance			168.455.980	84,46
Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs			18.912.142	9,48	Total Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé et valeurs mobilières récemment émises			168.455.980	84,46
				Valeur totale des investissements			187.368.122	93,94	
				(Coût total : 186.671.892 USD)					

*Différences mineures attribuables à l'arrondissement des chiffres.

Annexes aux Comptes

1 GÉNÉRALITÉS

Threadneedle (Lux) (la « SICAV ») est une Société d'Investissement à Capital Variable régie par la partie I de la loi du 17 décembre 2010 relative aux Organismes de Placement Collectif, telle qu'amendée.

La SICAV offre aux investisseurs la possibilité d'investir dans des Portefeuilles distincts (les « Portefeuilles »). Chaque Portefeuille dispose d'un objectif d'investissement différent et constitue un ensemble d'actifs distinct représenté par des Actions distinctes. Chaque Portefeuille peut disposer d'une ou de plusieurs Classes d'actions (les « Classe d'actions ») qui lui sont rattachées. La SICAV, prise dans son ensemble, comprenant tous les Portefeuilles existants et tous les Portefeuilles futurs, constitue une entité juridique unique. Cependant, vis-à-vis des tiers et, en particulier, des créanciers de la SICAV, ainsi qu'au regard des Actionnaires, chaque Portefeuille assumera la responsabilité exclusive de tout le passif qui lui est imputable.

Événements significatifs au cours de l'exercice :

Nouveaux Prospectus

De nouveaux Prospectus ont été publiés en juillet 2022 et janvier 2023.

Réduction des frais et dépenses

Depuis le 1^{er} août 2022, les Commissions de gestion et les Charges d'exploitation ont été réduites pour certaines Classes d'actions de plusieurs Portefeuilles, comme indiqué à l'Annexe 5.

Fermeture de Portefeuille

À compter du 21 mai 2021, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity a été mis en liquidation et le rachat final a eu lieu le 23 janvier 2023.

Lancement de Classes d'actions

Les Classes d'actions suivantes ont été lancées au cours de l'exercice clos le 31 mars 2023 :

Classe d'actions	Portefeuille	Date d'effet
ASH	Threadneedle (Lux) - Global Focus	27 avril 2022
ASH	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	27 avril 2022

Les Classes d'actions suivantes ont été fermées au cours de l'exercice clos le 31 mars 2023 :

AEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23 mars 2023
IE	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	27 mars 2023
IEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23 mars 2023
LE	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	28 mars 2023
LEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23 mars 2023
ZE	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23 mars 2023
ZEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23 mars 2023

Au 31 mars 2023, les Portefeuilles actifs de la SICAV sont les suivants :

Portefeuilles obligataires :

- Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Social Bond
- Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond¹
- Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Portefeuilles d'allocation des actifs :

- Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Annexes aux Comptes

(suite)

1 GÉNÉRALITÉS

(suite)

Portefeuilles d'actions :

- Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities
- Threadneedle (Lux) - Global Focus¹
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) - Global Select
- Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - American¹
- Threadneedle (Lux) - American Select
- Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity¹
- Threadneedle (Lux) - Asia Equities
- Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities¹
- Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - European Select
- Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income¹
- Threadneedle (Lux) - Global Technology¹
- Threadneedle (Lux) - UK Equities
- Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

Portefeuilles à rendement absolu :

- Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

Portefeuilles Extended Alpha :

- Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Portefeuille spécialiste :

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

¹Au 31 mars 2023, ces Portefeuilles ont été approuvés par la « Securities and Futures Commission » de Hong Kong et sont disponibles au public à Hong Kong.

2 RÉSUMÉ DES PRINCIPAUX PRINCIPES COMPTABLES

Les comptes sont préparés et présentés conformément aux principes comptables généralement admis applicables aux fonds de placement luxembourgeois de forme OPCVM (Organismes de Placement Collectif en Valeurs Mobilières) et qui imposent à la direction d'effectuer des estimations et hypothèses quant aux montants reportés dans les comptes et les annexes y afférentes. Les résultats réels peuvent différer de ces estimations.

Les comptes sont présentés sur la base de la Valeur nette d'inventaire des Portefeuilles calculée au 31 mars 2023. La dernière Valeur nette d'inventaire officielle des Portefeuilles correspondants a été calculée au 31 mars 2023.

Les comptes sont préparés conformément aux dispositions légales et réglementaires luxembourgeoises relatives aux fonds d'investissement en vertu de règles comptables de continuité des activités à l'exception du Portefeuille Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity, qui a été mis en liquidation le 21 mai 2021 et pour lequel le rachat final a eu lieu le 23 janvier 2023, du Portefeuille Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return, qui a été mis en liquidation le 28 avril 2023 et des Portefeuilles Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities et Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha, qui ont été mis en liquidation le 13 juillet 2023. Ainsi, les comptes relatifs à ces Portefeuilles ont été préparés par rapport au principe comptable de la non-continuité des activités et les éventuels frais de liquidation supplémentaires liés à ces Portefeuilles seront à la charge de la Société de gestion.

Annexes aux Comptes

(suite)

2 RÉSUMÉ DES PRINCIPAUX PRINCIPES COMPTABLES

(suite)

I) Valorisation des titres

Les valeurs mobilières, les instruments du marché monétaire et tous les actifs financiers cotés ou négociés sur un marché réglementé sont évalués à leur dernier cours sur le marché concerné à la clôture du marché. Si de tels prix ne sont pas représentatifs de leur juste valeur, ces titres sont évalués à la valeur à laquelle ils peuvent être revendus sur le marché, comme déterminé de bonne foi par ou sous la direction du Conseil d'administration.

Les titres à revenu fixe qui ne sont pas négociés sur de tels marchés sont évalués au dernier cours disponible ou à des valeurs de rendement obtenues auprès d'un ou de plusieurs courtiers ou services de fixation de prix approuvés par le Conseil d'administration, ou à tout autre cours jugé approprié par le Conseil d'administration.

Les Instruments du marché monétaire (ou autres instruments conformes à la convention de marché applicable dans le pays au sein duquel l'instrument est détenu) dont l'échéance résiduelle est de 90 jours ou moins seront valorisés selon la méthode du coût amorti, qui fournit une approximation de la valeur de marché. En application de cette méthode de valorisation, les investissements du Portefeuille concerné sont valorisés à leur coût d'acquisition ou à la dernière valeur de marché avant le début de la période de 90 jours (quand un instrument dispose d'une échéance résiduelle supérieure à 90 jours à sa date d'achat initiale) et corrigés de l'amortissement de la prime ou du cumul de l'escompte au lieu de la valeur de marché.

Les parts ou les actions des organismes de placement collectif de type ouvert (« OPC ») sont évaluées à leur dernière valeur nette d'inventaire (« Valeur nette d'inventaire ») déterminée et disponible ou, si un tel prix n'est pas représentatif de la valeur de marché de ces actifs, le prix sera dans ce cas déterminé par la SICAV, sur une base juste et équitable. Les parts ou les actions des OPC de type fermé sont évaluées à la dernière valeur de marché boursière disponible.

Les administrateurs de la SICAV (les « Administrateurs ») peuvent, à leur discrétion, autoriser l'utilisation d'autres méthodes d'évaluation s'ils considèrent que cette évaluation reflète mieux la juste valeur de tout actif de la SICAV.

II) Contrats de change à terme

Dans le but de se couvrir contre le risque de change ou d'investir dans d'autres devises, la SICAV peut conclure des contrats de change à terme. En fin d'exercice, les contrats de change à terme en cours sont évalués aux différents cours à terme applicables pour la période restant à courir jusqu'à leur échéance. La variation nette de la plus-value/(moins-value) latente sur les contrats de change à terme figure dans l'État des opérations et de la variation de l'actif net. Les contrats en cours au 31 mars 2023 sont détaillés à l'annexe 9.

III) Contrats à terme standardisés

La SICAV peut conclure des contrats à terme standardisés. Les contrats à terme standardisés en cours sont évalués au cours de la Bourse de valeurs sur laquelle les contrats sont négociés. La variation nette de la plus-value/(moins-value) latente sur les contrats à terme standardisés figure dans l'État des opérations et de la variation de l'actif net. Les contrats en cours au 31 mars 2023 sont détaillés à l'annexe 11.

IV) Swaps

La SICAV peut conclure des Swaps de taux d'intérêt (« IRS »), des Swaps sur défaut de crédit (« CDS ») et des Swaps de Rendement Total (« TRS »). Les IRS sont évalués à leur valeur de marché établie par rapport à la courbe de taux d'intérêt applicable. Les CDS sont évalués en fonction de la valeur actuelle nette des flux de trésorerie prévisionnels, sur la base des taux d'intérêt de marché et du taux de défaut et de recouvrement prévisionnel des marchés de l'actif sous-jacent. Tout paiement anticipé (le cas échéant) réalisé par la SICAV est comptabilisé comme actif dans l'État de l'actif net. Tout paiement anticipé (le cas échéant) reçu par la SICAV est comptabilisé comme passif dans l'État de l'actif net. Les TRS sont évalués en fonction de la valeur de marché, sur la base de la valeur de marché de l'actif sous-jacent. La variation nette de la plus-value ou moins-value latente sur swaps figure dans l'État des opérations et de la variation de l'actif net. Les contrats en cours au 31 mars 2023 sont détaillés à l'annexe 10. Les dividendes payables sur les positions courtes sur swaps (le cas échéant) sont comptabilisés comme passif dans l'État de l'actif net.

V) Options

Les options négociées sur un marché réglementé sont valorisées au prix de marché à la date d'évaluation. Ces options en cours au 31 mars 2023 sont présentées dans le Tableau des Investissements. Les options de gré à gré sont évaluées sur la base des cours reçus des agents/modèles de valorisations de tierces parties. Ces options en cours au 31 mars 2023 sont présentées à l'annexe 12. Les plus-values ou moins-values latentes liées, à la date de publication, à la valorisation des opérations sur options figurent dans l'État des opérations et de la variation de l'actif net.

VI) Conversion des devises

Les comptes de chacun des Portefeuilles sont exprimés dans la devise dans laquelle leurs actifs nets sont libellés. Leur(s) État de l'actif net, État des opérations et de la variation de l'actif net et Tableau des Investissements associés sont libellés dans cette devise (la « devise de référence »).

Au cours de l'exercice, les opérations, les revenus et les charges exprimés dans une devise autre que la devise de référence sont comptabilisés sur la base des taux de change en vigueur à leur date de réalisation ou à la date à laquelle ils sont provisionnés dans le Portefeuille.

À la date de l'État de l'actif net, les actifs et passifs monétaires libellés dans une autre devise que la devise de référence sont convertis dans la devise de référence sur la base des taux de change en vigueur à cette date. Les écarts de change sont portés dans l'État des opérations et de la variation de l'actif net.

Annexes aux Comptes

(suite)

2 RÉSUMÉ DES PRINCIPAUX PRINCIPES COMPTABLES

(suite)

L'État de l'actif net et l'État des opérations et de la variation de l'actif net consolidés sont présentés en USD sur la base des taux de change en vigueur à la date de l'État de l'actif net. Les taux de change utilisés au 31 mars 2023 sont : 1 USD = 1,493094 AUD, 1 USD = 0,920429 EUR, 1 USD = 0,808767 GBP, 1 USD = 0,913550 CHF, 1 USD = 10,369572 SEK, 1 USD = 6,856547 DKK, 1 USD = 10,473069 NOK, 1 USD = 7,849971 HKD, 1 USD = 1,329550 SGD.

La différence entre l'actif net en début d'exercice, calculé aux taux de change applicables en début d'exercice, et sa valeur en fin d'exercice est portée en ajustement de la conversion des devises dans l'État consolidé des opérations et de la variation de l'actif net, au poste Écarts de change.

VII) Avoirs en banque et liquidités

Les avoirs en banque et liquidités figurant dans les États de l'actif net incluent également les marges sur contrats à terme standardisés et les garanties en espèces payées par les Portefeuilles au titre des opérations sur swaps et des contrats de change à terme.

Les liquidités et marges sur contrats à terme standardisés sont évaluées à leur coût d'acquisition, soit approximativement leur valeur de marché.

VIII) Dépôts à terme

Les dépôts à terme sont évalués à leur coût d'acquisition, soit approximativement leur valeur de marché.

IX) Transactions financières et produits financiers

Les valeurs mobilières sont comptabilisées au prix d'acquisition, et le cas échéant, sur la base des taux de change en vigueur à leur date d'acquisition.

Les produits de la vente de valeurs mobilières sont déterminés sur la base de la méthode du coût moyen. Les transactions financières sont comptabilisées à la date de la transaction. Les dividendes sont comptabilisés à la date hors-dividende. Les produits d'intérêts sont comptabilisés sur une base cumulée. Les décotes/prime des obligations à zéro coupon sont cumulées en tant qu'ajustements des produits d'intérêts.

Les intérêts, dividendes et plus-values des titres peuvent être assujettis à une retenue à la source ou à un impôt sur les plus-values dans certains pays.

X) Politique de distribution

La politique de la SICAV applicable à toutes les Classes d'actions des Portefeuilles, à l'exception des Classes dont la dénomination se termine par un « C », un « M », un « P » ou un « T », est de ne procéder à aucune distribution, de cumuler dans ces Portefeuilles tous les bénéfices nets et de les réinvestir dans le même Portefeuille et la même Classe. S'agissant des Classes dont la dénomination se termine par un « C », un « M », un « P » ou un « T », la SICAV prévoit de procéder à des distributions, à fréquence au moins annuelle, d'un montant déterminé par les Administrateurs. Les Actionnaires de ces Classes d'actions disposent de l'option de percevoir les dividendes ou de les réinvestir dans la même Classe d'actions.

XI) Réductions sur les commissions de gestion

Des investissements croisés et des investissements dans d'autres fonds Columbia Threadneedle sont réalisés soit sur des Classes d'actions ne demandant pas de frais ou si la commission de gestion versée est entièrement remboursée. Veuillez également vous référer à l'annexe 18 pour plus d'informations sur les investissements croisés.

3 FISCALITÉ

En vertu des lois et pratiques actuelles, la SICAV n'est assujettie à aucun impôt sur le revenu au Luxembourg, ni à aucun impôt sur les plus-values au Luxembourg sur l'appréciation réalisée des actifs de la SICAV, ni à une retenue à la source au Luxembourg sur les dividendes versés par la SICAV.

En vertu de la loi et des réglementations en vigueur, la SICAV est assujettie au Grand-Duché de Luxembourg à une taxe d'abonnement annuelle de 0,05 %, payable par trimestre et évaluée sur la base de la Valeur nette d'inventaire à la fin de chaque trimestre. La taxe d'abonnement n'est pas levée sur les actifs détenus par la SICAV dans d'autres OPCVM déjà assujettis à cette taxe au Luxembourg.

Concernant les Classes d'actions Institutionnelles, une taxe d'abonnement annuelle réduite de 0,01 % est prélevée sur la Valeur nette d'inventaire au dernier jour de chaque trimestre civil, conformément aux dispositions de la loi du 17 décembre 2010, telle qu'amendée.

En outre, les portefeuilles dont le seul objectif est le placement collectif en instruments du marché monétaire et le placement de dépôts auprès d'établissements de crédit sont également soumis à une taxe réduite de 0,01 %. Là encore, aucune taxe n'est imputable à la part des actifs de la SICAV éventuellement investis dans d'autres OPCVM luxembourgeois.

Afin d'éviter toute ambiguïté, cette *taxe d'abonnement* fait partie des charges d'exploitation des SICAV.

Bien que les plus-values réalisées de la SICAV ne soient pas imposables au Luxembourg, que ce soit à court ou à long terme, ces plus-values réalisées peuvent être assujetties à l'impôt dans les pays d'origine.

4 FRAIS DIVERS

Les frais divers sont principalement composés de pénalités dues en vertu du Règlement sur les dépositaires centraux de titres et d'une rémunération aux investisseurs impactés négativement par une erreur de VNI.

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

La SICAV peut, pour le compte des différents Portefeuilles, conclure des contrats d'emprunt (conformément aux restrictions détaillées dans la rubrique « Restrictions d'Investissement » de l'Annexe A du Prospectus) et acheter ou vendre des valeurs mobilières, devises étrangères ou autres instruments financiers à travers Threadneedle Asset Management Limited (« TAML »), une société apparentée et ses filiales, à condition que de telles transactions soient effectuées dans des conditions commerciales normales et dans l'intérêt du Portefeuille concerné et de ses Actionnaires.

Pour l'exercice clos le 31 mars 2023, la SICAV n'a participé à aucune transaction avec des personnes liées.

La SICAV a nommé Threadneedle Management Luxembourg S.A. (la « Société de gestion ») en qualité de Société de gestion conformément au Chapitre 15 de la loi du 17 décembre 2010, telle qu'amendée. En vertu de l'accord de prestation de services de la Société de gestion, la Société de gestion fournit des services de gestion, administratifs et de marketing à la SICAV sous le contrôle et la supervision générale du Conseil d'administration.

Ni la Société de gestion ni TAML n'ont encaissé de commissions sur les opérations de courtage.

Certains dirigeants et/ou administrateurs de la Société de gestion, de la SICAV et d'autres entités du Groupe Columbia Threadneedle sont également dirigeants et/ou administrateurs de TAML.

La Société de gestion (agissant pour le compte de la SICAV) a délégué certaines fonctions de marketing et/ou de distribution à d'autres entités du Groupe Columbia Threadneedle. La Société de gestion perçoit une commission mensuelle au titre des services de gestion au taux annuel détaillé dans cette annexe et exprimée en pourcentage de la moyenne des actifs nets quotidiens pour chacun des Portefeuilles. La Société de gestion est responsable du versement, à partir de cette commission, des commissions de sous-distribution. Certains des conseillers par délégation sont des sociétés apparentées.

Comme décrit à l'Annexe 8, la Société de gestion peut également percevoir une commission de performance eu égard à toutes les Classes d'actions A, D, I et Z du Portefeuille Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha, à toutes les Classes d'actions J et Y du Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities et à toutes les Classes d'actions A, D, I, L et Z du Portefeuille Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha.

Toutes les dépenses engagées dans le cadre du fonctionnement de la SICAV et définies ci-dessous (ci-après les « Charges d'exploitation », la « Commission de gestion » ou les « Commissions des Portefeuilles », ensemble, les « Frais ») sont fixées aux taux présentés dans les tableaux à partir de la page 233. Toutes les dépenses sont cumulées quotidiennement sur la base de la Valeur nette d'inventaire de la Classe d'actions concernée dans le Portefeuille concerné.

Les Charges d'exploitation incluent notamment les impôts, les frais de services juridiques et d'audit, les frais d'impression de procurations, certificats d'actions, rapports et avis aux Actionnaires, Prospectus et Document d'Informations Clés pour l'Investisseur et autres dépenses de promotion, les honoraires et frais du Dépositaire et de ses correspondants, ainsi que du Domiciliaire, de l'Agent administratif, de l'Agent de transfert et teneur de registres et de tout Agent payeur, les dépenses liées à l'émission et au rachat des Actions, les frais d'enregistrement et dépenses de juridictions diverses, les frais de cotation, les honoraires des Administrateurs non affiliés de la SICAV, les dépenses des Administrateurs et des mandataires sociaux de la SICAV, ainsi que des Conseillers par délégation relatives à leur présence aux réunions du Conseil d'administration et aux assemblées générales des Actionnaires de la SICAV, les frais de traduction, de comptabilité et d'évaluation (y compris le calcul de la Valeur nette d'inventaire par action), les frais d'assurance, de contentieux et toutes autres dépenses extraordinaires et non récurrentes, ainsi que toutes dépenses normalement payables par la SICAV. Les Charges d'exploitation comprennent également la commission de service payable à la Société de gestion. La Société de gestion supportera l'excédent des Charges d'exploitation qui dépasse le taux annuel. À l'inverse, la Société de gestion sera autorisée à conserver tout écart excédentaire entre le taux annuel des Charges d'exploitation et les dépenses réellement engagées par la SICAV.

En outre, la Société de gestion est en droit de percevoir une commission de gestion (la « Commission de gestion »), telle que plus amplement décrite dans les tableaux à partir de la page 233, laquelle est comptabilisée quotidiennement et payée mensuellement. Aucune Commission de gestion n'est due pour les Actions X et 4. Afin d'éviter toute ambiguïté, les Charges d'exploitation n'incluent ni les Commissions de gestion ni les commissions de performance qui sont distinctes et séparées.

La SICAV propose des Actions B dans le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Technology.

Ces Actions B correspondent à une ancienne Classe d'actions uniquement disponible pour de nouvelles souscriptions d'Actionnaires existants et ne supportent pas de droit d'entrée.

ACTIONS A :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Portefeuilles obligataires	Maximum 3,0 %	Maximum 0,75 %
Portefeuilles d'actions et Portefeuilles d'allocation des actifs	Maximum 5,0 %	Maximum 0,75 %
Portefeuilles à rendement absolu	Maximum 5,0 %	Maximum 0,75 %
Portefeuilles Extended Alpha	Maximum 5,0 %	Maximum 0,75 %
Portefeuille spécialiste	Maximum 5,0 %	Maximum 0,75 %

Les commissions de vente indiquées représentent un montant maximum auquel les distributeurs ou les sous-distributeurs sont autorisés à renoncer en totalité ou en partie, selon l'importance de la souscription ou les particularités du marché local.

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

(suite)

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,60 %	0,20 % ¹	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,60 % ²	0,20 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,25 %	0,20 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,75 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,90 %	0,20 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,35 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,25 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,90 %	0,20 % ¹	USD
Portefeuilles d'allocation des actifs				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	1,25 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	1,25 %	0,30 %	USD
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	1,50 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,55 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,30 %	0,20 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,50 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	1,65 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	1,50 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50 %	0,30 %	GBP
Portefeuilles à rendement absolu				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,90 %	0,20 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	1,50 %	0,35 %	EUR
Portefeuilles Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
Portefeuille spécialiste				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,00 %	0,20 % ¹	USD

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

(suite)

ACTIONS B :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	S.O.	Néant

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuille d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	0,35 %	USD

ACTIONS D :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	Maximum 1,00 %	Maximum 0,75 %

Les commissions de vente indiquées représentent un montant maximum auquel les distributeurs ou les sous-distributeurs sont autorisés à renoncer en totalité ou en partie, selon l'importance de la souscription ou les particularités du marché local.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	1,35 %	0,20 % ¹	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45 %	0,20 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,45 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,45 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,45 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,45 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,20 %	0,20 % ¹	USD
Portefeuilles d'allocation des actifs				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	2,00 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	2,00 %	0,30 %	USD
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	2,25 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,25 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	2,00 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,85 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	2,00 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,50 %	0,20 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,85 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	2,40 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	2,00 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	2,25 %	0,35 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	2,25 %	0,30 %	GBP

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

(suite)

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles à rendement absolu				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	1,45 %	0,20 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	2,00 %	0,35 %	EUR
Portefeuilles Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
Portefeuille spécialiste				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,25 %	0,20 % ¹	USD

ACTIONS I :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	S.O.	Maximum 0,75 %

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40 % ⁴	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40 %	0,10 % ⁶	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,55 % ⁷	0,10 % ⁶	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40 %	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,65 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,65 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,65 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40 %	0,10 % ⁵	USD
Portefeuilles d'allocation des actifs				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,65 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75 %	0,20 %	USD
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,65 %	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,70 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,80 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,80 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,25 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,65 %	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,50 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,85 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,20 %	EUR

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

(suite)

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles d'actions				
<i>(suite)</i>				
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	1,25 %	0,35 %	USD
Portefeuilles à rendement absolu				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35 %	0,10 % ⁶	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	EUR
Portefeuilles Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD
Portefeuille spécialiste				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,80 %	0,10 % ⁵	USD

ACTIONS J :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	S.O.	Maximum 0,75 %

Une commission de performance est également exigible pour les Actions J, telle que décrite dans la section intitulée « Commission de performance » dans le corps du Prospectus.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuille à rendement absolu				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,25 %	0,10 % ⁶	EUR

ACTIONS L :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	S.O.	Maximum 0,75 %

Les commissions de vente indiquées représentent un montant maximum auquel les distributeurs ou les sous-distributeurs sont autorisés à renoncer en totalité ou en partie, selon l'importance de la souscription ou les particularités du marché local.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuille obligataire				
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
Portefeuille d'allocation des actifs				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,50 %	0,20 %	EUR
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,35 %	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,50 %	0,20 %	GBP
Portefeuilles à rendement absolu				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,20 %	0,10 % ⁶	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,375 %	0,20 %	EUR

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

(suite)

ACTIONS N :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	S.O.	0,75 %

Les commissions de vente indiquées représentent un montant maximum auquel les distributeurs ou les sous-distributeurs sont autorisés à renoncer en totalité ou en partie, selon l'importance de la souscription ou les particularités du marché local.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,30 %	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,55 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,60 %	0,08 %	GBP
Portefeuille spécialiste				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,45 %	0,10 % ⁵	USD

ACTIONS S :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	Maximum 5,0 %	Maximum 0,75 %

Les commissions de vente indiquées représentent un montant maximum auquel les distributeurs ou les sous-distributeurs sont autorisés à renoncer en totalité ou en partie, selon l'importance de la souscription ou les particularités du marché local.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuille obligataire				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,50 %	0,20 % ³	USD

ACTIONS T :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	5,00 %	0,75 %

Les commissions de vente indiquées représentent un montant maximum auquel les distributeurs ou les sous-distributeurs sont autorisés à renoncer en totalité ou en partie, selon l'importance de la souscription ou les particularités du marché local.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuille obligataire				
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,90 %	0,19 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,60 %	0,12 %	GBP

ACTIONS W :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	Maximum 5,0 %	Maximum 0,75 %

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

(suite)

Les commissions de vente indiquées représentent un montant maximum auquel les distributeurs ou les sous-distributeurs sont autorisés à renoncer en totalité ou en partie, selon l'importance de la souscription ou les particularités du marché local.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,00 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,00 %	0,20 % ³	USD
Portefeuille d'allocation des actifs				
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,40 %	0,35 %	USD
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40 %	0,20 % ⁸	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,15 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,40 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,40 %	0,20 % ⁸	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,55 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,65 %	0,35 %	USD

ACTIONS X :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	S.O.	Maximum 0,75 %

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires			
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,10 % ⁵	USD
Portefeuilles d'actions			
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,15 %	USD
Portefeuilles à rendement absolu			
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,15 %	EUR
Portefeuille spécialiste			
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,10 % ⁵	USD

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

(suite)

ACTIONS Y :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	5,00 %	Maximum 0,75 %

Les commissions de vente indiquées représentent un montant maximum auquel les distributeurs ou les sous-distributeurs sont autorisés à renoncer en totalité ou en partie, selon l'importance de la souscription ou les particularités du marché local.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuille à rendement absolu				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35 %	0,15 % ¹	EUR

ACTIONS Z :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	5,00 %	Maximum 0,75 %

Les commissions de vente indiquées représentent un montant maximum auquel les distributeurs ou les sous-distributeurs sont autorisés à renoncer en totalité ou en partie, selon l'importance de la souscription ou les particularités du marché local.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40 %	0,15 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40 %	0,15 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,15 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40 %	0,15 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,60 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,60 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,60 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,60 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40 %	0,15 % ¹	USD
Portefeuilles d'allocation des actifs				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	0,75 %	0,30 %	USD
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,75 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,30 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75 %	0,15 % ¹	EUR

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

(suite)

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles d'actions				
<i>(suite)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	1,25 %	0,35 %	USD
Portefeuilles à rendement absolu				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,55 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,45 %	0,15 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	EUR
Portefeuilles Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
Portefeuille spécialiste				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,75 %	0,15 % ¹	USD

ACTIONS 1 :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	Maximum 5,0 %	S.O.

Les commissions de vente indiquées représentent un montant maximum auquel les distributeurs ou les sous-distributeurs sont autorisés à renoncer en totalité ou en partie, selon l'importance de la souscription ou les particularités du marché local.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	1,00 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,20 %	0,18 %	EUR
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50 %	0,21 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	0,17 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50 %	0,17 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,50 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,30 %	0,23 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,50 %	0,22 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,50 %	0,22 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50 %	0,14 %	GBP
Portefeuille à rendement absolu				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00 %	0,17 %	EUR

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

(suite)

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50 %	0,19 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50 %	0,19 %	USD

ACTIONS 2 :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	S.O.	S.O.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75 %	0,07 %	EUR
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00 %	0,06 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00 %	0,06 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00 %	0,09 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,00 %	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00 %	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00 %	0,06 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	EUR
Portefeuille à rendement absolu				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,06 %	EUR
Portefeuilles Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,08 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,08 %	USD

ACTIONS 3 :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	Maximum 3,0 %	S.O.

Les commissions de vente indiquées représentent un montant maximum auquel les distributeurs ou les sous-distributeurs sont autorisés à renoncer en totalité ou en partie, selon l'importance de la souscription ou les particularités du marché local.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,17 %	EUR
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,13 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,12 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,18 %	USD

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

(suite)

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles d'actions				
<i>(suite)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,16 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,13 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,18 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,12 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,13 %	GBP
Portefeuille Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,19 %	USD

ACTIONS 4 :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	S.O.	S.O.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires			
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,07 %	EUR
Portefeuilles d'actions			
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,07 %	EUR
Portefeuille à rendement absolu			
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,06 %	EUR

ACTIONS 8 :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	S.O.	S.O.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75 %	0,11 %	EUR
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00 %	0,13 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,00 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00 %	0,13 %	EUR

Annexes aux Comptes

(suite)

5 TRANSACTIONS AVEC DES SOCIÉTÉS APPARENTÉES

(suite)

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles d'actions				
<i>(suite)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	EUR
Portefeuille à rendement absolu				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,10 %	EUR
Portefeuilles Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,12 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,12 %	USD

ACTIONS 9 :

Portefeuille(s)	Droit d'entrée en % du montant investi	Frais de change
Chaque Portefeuille indiqué ci-dessous	S.O.	S.O.

Type de Portefeuille	Nom du Portefeuille	Commissions de gestion	Charges d'exploitation	Devise de référence
Portefeuilles obligataires				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,10 % ⁹	EUR
Portefeuilles d'actions				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,10 % ¹⁰	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,09 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,08 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,16 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75 %	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,16 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,14 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,08 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,09 %	GBP
Portefeuille Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD

*Voir annexe 1.

¹0,25 % jusqu'au 31 juillet 2022.²0,90 % jusqu'au 31 juillet 2022.³0,30 % jusqu'au 31 juillet 2022.⁴0,50 % jusqu'au 31 juillet 2022.⁵0,15 % jusqu'au 31 juillet 2022.⁶0,20 % jusqu'au 31 juillet 2022.⁷0,65 % jusqu'au 31 juillet 2022.⁸0,35 % jusqu'au 31 juillet 2022.⁹0,13 % jusqu'au 31 juillet 2022.¹⁰0,11 % jusqu'au 31 juillet 2022.

Annexes aux Comptes

(suite)

6 ACCORDS DE COMMISSIONS PARTAGÉES

La Société de gestion et certains Conseillers par délégation peuvent conclure avec des courtiers des accords de commissions partagées en vertu desquels certaines prestations commerciales sont fournies par lesdits courtiers directement ou par des tiers et sont payées par ces courtiers sur les commissions perçues par eux sur les opérations réalisées pour le compte de la SICAV. Afin d'obtenir la meilleure exécution possible des ordres passés par la SICAV, la Société de gestion ou chaque Conseiller par délégation concerné peuvent attribuer spécifiquement à des courtiers les commissions de courtage générées par les opérations réalisées pour la SICAV, en échange de prestations de recherche ou de prestations fournies dans le cadre de l'exécution des ordres par ces courtiers. Des informations supplémentaires sur les pratiques de chaque Conseiller par délégation concernant les accords de commissions partagées sont reprises en détail dans le Prospectus à la section « Accords de conseil en investissement ».

Tout accord de commissions partagées conclu avec la Société de gestion ou un Conseiller par délégation sera régi selon les conditions suivantes : (i) la Société de gestion ou le Conseiller par délégation agira toujours dans le meilleur intérêt de la SICAV et de ses Actionnaires lors de la conclusion d'accords de commissions partagées ; (ii) les services fournis auront un lien direct avec les activités de la Société de gestion ou du Conseiller par délégation ; (iii) les commissions de courtage générées par les opérations de courtage relatives au portefeuille de la SICAV seront allouées par la Société de gestion ou le Conseiller par délégation à des courtiers exerçant en société et non à des personnes physiques ; (iv) les accords de commissions partagées ne constituent pas un facteur déterminant dans la sélection des courtiers ; (v) la Société de gestion ou le Conseiller par délégation fournira aux Administrateurs des comptes-rendus sur les accords de commissions partagées, en décrivant la nature des services fournis ; (vi) ni la Société de gestion, ni le Conseiller par délégation, ni aucune des personnes liées à ces derniers ne pourront conserver une quelconque remise accordée, sous forme de liquidités ou autre, par des courtiers ; (vii) les biens ou services reçus représentent un avantage démontrable pour les Actionnaires ; et (viii) une publication périodique sera faite dans le rapport annuel de la SICAV sous la forme d'une déclaration décrivant ces accords de commissions partagées, y compris une description des biens et services reçus. Les biens et services reçus peuvent être : des recherches à valeur ajoutée pour les prises de décision d'un Conseiller par délégation et des services d'exécution qui renforcent la capacité du Conseiller par délégation à exécuter des transactions.

Seul le Conseiller par délégation Columbia Management Investment Advisors, LLC peut conclure des accords de commissions partagées.

7 DIVIDENDES

La SICAV a versé les dividendes décrits ci-dessous pour l'exercice clos le 31 mars 2023 :

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Classe AEC	24/06/2022	EUR	0,070	111.727
	Classe AEC	26/09/2022	EUR	0,080	117.303
	Classe AEC	22/12/2022	EUR	0,075	121.935
	Classe AEC	27/03/2023	EUR	0,087	147.580
	Classe AUP	24/06/2022	USD	0,082	9.754
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,086	10.591
	Classe AUP	22/12/2022	USD	0,091	10.285
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,101	11.643
	Classe DEC	24/06/2022	EUR	0,064	6.059
	Classe DEC	26/09/2022	EUR	0,069	6.318
	Classe DEC	22/12/2022	EUR	0,068	6.810
	Classe DEC	27/03/2023	EUR	0,079	7.160
	Classe DUP	24/06/2022	USD	0,074	4.718
	Classe DUP	26/09/2022	USD	0,079	4.845
	Classe DUP	22/12/2022	USD	0,081	4.987
	Classe DUP	27/03/2023	USD	0,091	5.033
	Classe IEC	24/06/2022	EUR	0,071	26.772
	Classe IEC	26/09/2022	EUR	0,079	15.785
	Classe IEC	22/12/2022	EUR	0,073	77.356
	Classe IEC	27/03/2023	EUR	0,086	110.934
	Classe IEP	24/06/2022	EUR	0,083	7
	Classe IEP	26/09/2022	EUR	0,097	7
	Classe IEP	22/12/2022	EUR	0,092	7
	Classe IEP	27/03/2023	EUR	0,103	8
	Classe IGC	24/06/2022	GBP	0,074	98
	Classe IGC	26/09/2022	GBP	0,085	57
	Classe IGC	22/12/2022	GBP	0,078	58
	Classe IGC	27/03/2023	GBP	0,089	67
	Classe IUP	24/06/2022	USD	0,079	43.205
	Classe IUP	26/09/2022	USD	0,085	44.685

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond <i>(suite)</i>	Classe IUP	22/12/2022	USD	0,085	25.156
	Classe IUP	27/03/2023	USD	0,096	26.712
	Classe NEC	24/06/2022	EUR	0,071	9.821
	Classe NEC	26/09/2022	EUR	0,079	15.222
	Classe NEC	22/12/2022	EUR	0,074	27.067
	Classe NEC	27/03/2023	EUR	0,087	42.919
	Classe NGC	24/06/2022	GBP	0,073	1.383.354
	Classe NGC	26/09/2022	GBP	0,083	2.485.421
	Classe NGC	22/12/2022	GBP	0,076	2.998.447
	Classe NGC	27/03/2023	GBP	0,088	4.058.889
	Classe NUP	24/06/2022	USD	0,078	6.297
	Classe NUP	26/09/2022	USD	0,082	7.210
	Classe NUP	22/12/2022	USD	0,086	8265
	Classe NUP	27/03/2023	USD	0,097	11.210
					12.011.784 USD
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	Classe IEP	24/06/2022	EUR	0,034	3
	Classe IEP	26/09/2022	EUR	0,039	3
	Classe IEP	22/12/2022	EUR	0,044	4
	Classe IEP	27/03/2023	EUR	0,048	25.702
					25.712 EUR
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Classe IEP	27/03/2023	EUR	0,351	2.074.526
	Classe ZEP	27/03/2023	EUR	0,350	42.033
	Classe 1EP	27/03/2023	EUR	0,343	359.296
	Classe 1GP	27/03/2023	GBP	0,337	1.333
	Classe 1UT	25/04/2022	USD	0,029	7.694
	Classe 1UT	23/05/2022	USD	0,029	7.800
	Classe 1UT	24/06/2022	USD	0,034	8.798
	Classe 1UT	25/07/2022	USD	0,031	8.309
	Classe 1UT	24/08/2022	USD	0,037	6.635
	Classe 1UT	26/09/2022	USD	0,029	5.351
	Classe 1UT	25/10/2022	USD	0,032	5.798
	Classe 1UT	23/11/2022	USD	0,028	4.876
	Classe 1UT	22/12/2022	USD	0,029	4.893
	Classe 1UT	25/01/2023	USD	0,032	5.269
	Classe 1UT	22/02/2023	USD	0,032	3.569
	Classe 1UT	27/03/2023	USD	0,034	3.765
	Classe 2EP	27/03/2023	EUR	0,351	1.012
	Classe 2GP	27/03/2023	GBP	0,340	29
	Classe 3EP	27/03/2023	EUR	0,355	655.200
	Classe 3FC	27/03/2023	CHF	0,346	2.285
	Classe 3GP	27/03/2023	GBP	0,343	23.117
	Classe 8EP	27/03/2023	EUR	0,352	1.955.544
	Classe 8GP	27/03/2023	GBP	0,344	1.963
	Classe 9EP	27/03/2023	EUR	0,355	2.689
	Classe 9FC	27/03/2023	CHF	0,345	32
	Classe 9GP	27/03/2023	GBP	0,342	29
					5.191.845 EUR

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Classe AEP	27/03/2023	EUR	3,485	1.089
	Classe IEP	27/03/2023	EUR	3,538	331.231
	Classe IGC	27/03/2023	GBP	3,616	33
	Classe XGC	27/03/2023	GBP	3,742	215.386
					547.739 EUR
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	Classe AEP	24/06/2022	EUR	0,026	1.170
	Classe AEP	26/09/2022	EUR	0,028	1.269
	Classe AEP	22/12/2022	EUR	0,030	1.360
	Classe AEP	27/03/2023	EUR	0,034	1.541
	Classe ASC	24/06/2022	SGD	0,028	2
	Classe ASC	26/09/2022	SGD	0,030	2
	Classe ASC	22/12/2022	SGD	0,034	2
	Classe ASC	27/03/2023	SGD	0,037	3
	Classe AUC	24/06/2022	USD	0,027	3
	Classe AUC	26/09/2022	USD	0,027	3
	Classe AUC	22/12/2022	USD	0,032	3
	Classe AUC	27/03/2023	USD	0,035	3
	Classe IEP	24/06/2022	EUR	0,027	77.800
	Classe IEP	26/09/2022	EUR	0,030	81.738
	Classe IEP	22/12/2022	EUR	0,031	84.213
	Classe IEP	27/03/2023	EUR	0,036	93.226
	Classe ISC	24/06/2022	SGD	0,028	2
	Classe ISC	26/09/2022	SGD	0,031	2
	Classe ISC	22/12/2022	SGD	0,034	2
	Classe ISC	27/03/2023	SGD	0,037	3
	Classe IUC	24/06/2022	USD	0,026	2.431
	Classe IUC	26/09/2022	USD	0,031	2.306
	Classe IUC	22/12/2022	USD	0,033	2.699
	Classe IUC	27/03/2023	USD	0,035	2.704
	Classe NEP	24/06/2022	EUR	2,732	267.909
	Classe NEP	26/09/2022	EUR	2,817	290.888
	Classe NEP	22/12/2022	EUR	3,175	309.245
	Classe NEP	27/03/2023	EUR	3,497	389.704
	Classe ZEP	24/06/2022	EUR	0,028	16.537
	Classe ZEP	26/09/2022	EUR	0,029	16.855
	Classe ZEP	22/12/2022	EUR	0,031	18.017
	Classe ZEP	27/03/2023	EUR	0,034	19.761
Classe ZGC	24/06/2022	GBP	0,026	130.082	
Classe ZGC	26/09/2022	GBP	0,030	165.116	
Classe ZGC	22/12/2022	GBP	0,033	200.521	
Classe ZGC	27/03/2023	GBP	0,035	220.183	
					2.397.305 EUR
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Classe AEP	25/04/2022	EUR	0,033	22.417
	Classe AEP	23/05/2022	EUR	0,033	22.344
	Classe AEP	24/06/2022	EUR	0,034	23.102
	Classe AEP	25/07/2022	EUR	0,034	23.342
	Classe AEP	24/08/2022	EUR	0,034	23.523
	Classe AEP	26/09/2022	EUR	0,038	26.906

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond (suite)					
	Classe AEP	25/10/2022	EUR	0,038	27.088
	Classe AEP	23/11/2022	EUR	0,038	27.298
	Classe AEP	22/12/2022	EUR	0,041	30.164
	Classe AEP	25/01/2023	EUR	0,041	30.321
	Classe AEP	22/02/2023	EUR	0,041	31.583
	Classe AEP	27/03/2023	EUR	0,043	32.860
	Classe DEP	25/04/2022	EUR	0,025	39.717
	Classe DEP	23/05/2022	EUR	0,025	38.868
	Classe DEP	24/06/2022	EUR	0,025	38.637
	Classe DEP	25/07/2022	EUR	0,025	38.247
	Classe DEP	24/08/2022	EUR	0,025	38.091
	Classe DEP	26/09/2022	EUR	0,029	44.199
	Classe DEP	25/10/2022	EUR	0,029	43.716
	Classe DEP	23/11/2022	EUR	0,029	43.731
	Classe DEP	22/12/2022	EUR	0,030	45.239
	Classe DEP	25/01/2023	EUR	0,030	42.143
	Classe DEP	22/02/2023	EUR	0,030	40.716
	Classe DEP	27/03/2023	EUR	0,032	42.797
					817.049 EUR
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds					
	Classe AEC	25/04/2022	EUR	0,037	15.705
	Classe AEC	23/05/2022	EUR	0,037	15.595
	Classe AEC	24/06/2022	EUR	0,037	15.700
	Classe AEC	25/07/2022	EUR	0,037	19.546
	Classe AEC	24/08/2022	EUR	0,037	19.302
	Classe AEC	26/09/2022	EUR	0,040	20.385
	Classe AEC	25/10/2022	EUR	0,040	20.547
	Classe AEC	23/11/2022	EUR	0,040	21.591
	Classe AEC	22/12/2022	EUR	0,043	24.320
	Classe AEC	25/01/2023	EUR	0,043	25.232
	Classe AEC	22/02/2023	EUR	0,043	24.599
	Classe AEC	27/03/2023	EUR	0,042	24.282
	Classe AUP	25/04/2022	USD	0,024	17.340
	Classe AUP	23/05/2022	USD	0,024	16.918
	Classe AUP	24/06/2022	USD	0,024	16.852
	Classe AUP	25/07/2022	USD	0,024	16.725
	Classe AUP	24/08/2022	USD	0,024	16.576
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,027	18.566
	Classe AUP	25/10/2022	USD	0,027	18.638
	Classe AUP	23/11/2022	USD	0,027	18.610
	Classe AUP	22/12/2022	USD	0,029	20.155
	Classe AUP	25/01/2023	USD	0,029	20.038
	Classe AUP	22/02/2023	USD	0,029	19.622
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,028	19.561
	Classe DEC	25/04/2022	EUR	0,027	1.275
	Classe DEC	23/05/2022	EUR	0,027	1.214
	Classe DEC	24/06/2022	EUR	0,027	1.218
	Classe DEC	25/07/2022	EUR	0,027	1.156
	Classe DEC	24/08/2022	EUR	0,027	1.100

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds					
<i>(suite)</i>	Classe DEC	26/09/2022	EUR	0,029	1.093
	Classe DEC	25/10/2022	EUR	0,029	1.315
	Classe DEC	23/11/2022	EUR	0,029	1.353
	Classe DEC	22/12/2022	EUR	0,031	1.408
	Classe DEC	25/01/2023	EUR	0,031	1.442
	Classe DEC	22/02/2023	EUR	0,031	1.417
	Classe DEC	27/03/2023	EUR	0,031	1.359
	Classe IEC	25/04/2022	EUR	0,029	6.065
	Classe IEC	23/05/2022	EUR	0,029	5.943
	Classe IEC	24/06/2022	EUR	0,029	5.964
	Classe IEC	25/07/2022	EUR	0,029	5.758
	Classe IEC	24/08/2022	EUR	0,029	5.621
	Classe IEC	26/09/2022	EUR	0,031	6.441
	Classe IEC	25/10/2022	EUR	0,031	6.560
	Classe IEC	23/11/2022	EUR	0,031	8.228
	Classe IEC	22/12/2022	EUR	0,033	9.040
	Classe IEC	25/01/2023	EUR	0,033	9.262
	Classe IEC	22/02/2023	EUR	0,033	9.099
	Classe IEC	27/03/2023	EUR	0,033	9.166
	Classe XUP	24/06/2022	USD	0,115	10
	Classe XUP	26/09/2022	USD	0,120	10
	Classe XUP	22/12/2022	USD	0,129	11
	Classe XUP	27/03/2023	USD	0,144	12
					568.945 USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	Classe AEC	25/04/2022	EUR	0,032	1.686
	Classe AEC	23/05/2022	EUR	0,032	1.653
	Classe AEC	24/06/2022	EUR	0,030	1.526
	Classe AEC	25/07/2022	EUR	0,030	1.474
	Classe AEC	24/08/2022	EUR	0,030	1.440
	Classe AEC	26/09/2022	EUR	0,030	1.400
	Classe AEC	25/10/2022	EUR	0,030	1.411
	Classe AEC	23/11/2022	EUR	0,030	1.469
	Classe AEC	22/12/2022	EUR	0,032	1.618
	Classe AEC	25/01/2023	EUR	0,032	1.659
	Classe AEC	22/02/2023	EUR	0,032	1.631
	Classe AEC	27/03/2023	EUR	0,032	1.603
	Classe AUP	25/04/2022	USD	0,039	106.883
	Classe AUP	23/05/2022	USD	0,039	105.977
	Classe AUP	24/06/2022	USD	0,037	99.530
	Classe AUP	25/07/2022	USD	0,037	98.705
	Classe AUP	24/08/2022	USD	0,037	98.021
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,037	97.393
	Classe AUP	25/10/2022	USD	0,037	96.612
	Classe AUP	23/11/2022	USD	0,037	94.403
	Classe AUP	22/12/2022	USD	0,041	103.601
	Classe AUP	25/01/2023	USD	0,041	102.393
	Classe AUP	22/02/2023	USD	0,041	101.873
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,041	100.793

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt <i>(suite)</i>					
	Classe SUP	25/04/2022	USD	0,038	1.848
	Classe SUP	23/05/2022	USD	0,038	1.801
	Classe SUP	24/06/2022	USD	0,036	1.666
	Classe SUP	25/07/2022	USD	0,036	1.596
	Classe SUP	24/08/2022	USD	0,036	1.596
	Classe SUP	26/09/2022	USD	0,036	1.596
	Classe SUP	25/10/2022	USD	0,036	1.577
	Classe SUP	23/11/2022	USD	0,036	1.557
	Classe SUP	22/12/2022	USD	0,039	1.687
	Classe SUP	25/01/2023	USD	0,039	1.687
	Classe SUP	22/02/2023	USD	0,039	1.632
	Classe SUP	27/03/2023	USD	0,039	1.632
	Classe XUP	24/06/2022	USD	0,119	11
	Classe XUP	26/09/2022	USD	0,110	10
	Classe XUP	22/12/2022	USD	0,115	10
	Classe XUP	27/03/2023	USD	0,129	11
					1.244.671 USD
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds					
	Classe AEC	25/04/2022	EUR	0,018	48.010
	Classe AEC	23/05/2022	EUR	0,018	47.011
	Classe AEC	24/06/2022	EUR	0,018	47.495
	Classe AEC	25/07/2022	EUR	0,018	46.495
	Classe AEC	24/08/2022	EUR	0,018	45.675
	Classe AEC	26/09/2022	EUR	0,017	42.107
	Classe AEC	25/10/2022	EUR	0,017	43.247
	Classe AEC	23/11/2022	EUR	0,017	45.528
	Classe AEC	22/12/2022	EUR	0,018	50.144
	Classe AEC	25/01/2023	EUR	0,018	51.773
	Classe AEC	22/02/2023	EUR	0,018	51.317
	Classe AEC	27/03/2023	EUR	0,017	48.925
	Classe ASC	25/04/2022	SGD	0,025	859
	Classe ASC	23/05/2022	SGD	0,025	860
	Classe ASC	24/06/2022	SGD	0,025	861
	Classe ASC	25/07/2022	SGD	0,025	856
	Classe ASC	24/08/2022	SGD	0,025	856
	Classe ASC	26/09/2022	SGD	0,024	8.990
	Classe ASC	25/10/2022	SGD	0,024	8.943
	Classe ASC	23/11/2022	SGD	0,024	810
	Classe ASC	22/12/2022	SGD	0,025	720
	Classe ASC	25/01/2023	SGD	0,025	739
	Classe ASC	22/02/2023	SGD	0,025	732
	Classe ASC	27/03/2023	SGD	0,024	693
	Classe AUP	25/04/2022	USD	0,019	27.434
	Classe AUP	23/05/2022	USD	0,019	26.923
	Classe AUP	24/06/2022	USD	0,019	26.758
	Classe AUP	25/07/2022	USD	0,019	26.268
	Classe AUP	24/08/2022	USD	0,019	26.190
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,019	25.973
	Classe AUP	25/10/2022	USD	0,019	25.872

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds					
(suite)	Classe AUP	23/11/2022	USD	0,019	25.798
	Classe AUP	22/12/2022	USD	0,019	25.373
	Classe AUP	25/01/2023	USD	0,019	25.295
	Classe AUP	22/02/2023	USD	0,019	25.212
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,019	24.275
	Classe XUP	25/04/2022	USD	0,034	12.704
	Classe XUP	23/05/2022	USD	0,034	12.330
	Classe XUP	24/06/2022	USD	0,034	12.330
	Classe XUP	25/07/2022	USD	0,034	12.330
	Classe XUP	24/08/2022	USD	0,034	12.330
	Classe XUP	26/09/2022	USD	0,033	11.511
	Classe XUP	25/10/2022	USD	0,033	11.511
	Classe XUP	23/11/2022	USD	0,033	11.511
	Classe XUP	22/12/2022	USD	0,034	11.860
	Classe XUP	25/01/2023	USD	0,034	11.860
	Classe XUP	22/02/2023	USD	0,034	11.860
	Classe XUP	27/03/2023	USD	0,034	6.287
					1.043.441 USD
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	Classe AEC	25/04/2022	EUR	0,048	1.057
	Classe AEC	23/05/2022	EUR	0,048	964
	Classe AEC	24/06/2022	EUR	0,046	927
	Classe AEC	25/07/2022	EUR	0,046	895
	Classe AEC	24/08/2022	EUR	0,046	874
	Classe AEC	26/09/2022	EUR	0,049	702
	Classe AEC	25/10/2022	EUR	0,049	690
	Classe AEC	23/11/2022	EUR	0,049	718
	Classe AEC	22/12/2022	EUR	0,050	757
	Classe AEC	25/01/2023	EUR	0,050	775
	Classe AEC	22/02/2023	EUR	0,050	762
	Classe AEC	27/03/2023	EUR	0,049	725
	Classe AUP	25/04/2022	USD	0,052	12.890
	Classe AUP	23/05/2022	USD	0,052	12.725
	Classe AUP	24/06/2022	USD	0,050	12.233
	Classe AUP	25/07/2022	USD	0,050	12.005
	Classe AUP	24/08/2022	USD	0,050	12.015
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,053	11.574
	Classe AUP	25/10/2022	USD	0,053	11.456
	Classe AUP	23/11/2022	USD	0,053	11.462
	Classe AUP	22/12/2022	USD	0,055	11.642
	Classe AUP	25/01/2023	USD	0,055	11.645
	Classe AUP	22/02/2023	USD	0,055	11.581
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,054	11.362
	Classe DEC	25/04/2022	EUR	0,036	968
	Classe DEC	23/05/2022	EUR	0,036	949
	Classe DEC	24/06/2022	EUR	0,034	899
	Classe DEC	25/07/2022	EUR	0,034	868
	Classe DEC	24/08/2022	EUR	0,034	721
	Classe DEC	26/09/2022	EUR	0,037	763

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond					
<i>(suite)</i>	Classe DEC	25/10/2022	EUR	0,037	777
	Classe DEC	23/11/2022	EUR	0,037	437
	Classe DEC	22/12/2022	EUR	0,037	500
	Classe DEC	25/01/2023	EUR	0,037	513
	Classe DEC	22/02/2023	EUR	0,037	504
	Classe DEC	27/03/2023	EUR	0,037	507
	Classe IEC	25/04/2022	EUR	0,036	4
	Classe IEC	23/05/2022	EUR	0,036	4
	Classe IEC	24/06/2022	EUR	0,034	3
	Classe IEC	25/07/2022	EUR	0,034	3
	Classe IEC	24/08/2022	EUR	0,034	3
	Classe IEC	26/09/2022	EUR	0,036	3
	Classe IEC	25/10/2022	EUR	0,036	3
	Classe IEC	23/11/2022	EUR	0,036	3
	Classe IEC	22/12/2022	EUR	0,037	4
	Classe IEC	25/01/2023	EUR	0,037	4
	Classe IEC	22/02/2023	EUR	0,037	4
	Classe IEC	27/03/2023	EUR	0,036	4
	Classe ISC	25/04/2022	SGD	0,039	5.316
	Classe ISC	23/05/2022	SGD	0,039	5.589
	Classe ISC	24/06/2022	SGD	0,037	5.613
	Classe ISC	25/07/2022	SGD	0,037	5.888
	Classe ISC	24/08/2022	SGD	0,037	6.411
	Classe ISC	26/09/2022	SGD	0,040	7.178
	Classe ISC	25/10/2022	SGD	0,040	7.170
	Classe ISC	23/11/2022	SGD	0,040	8.052
	Classe ISC	22/12/2022	SGD	0,041	9.803
	Classe ISC	25/01/2023	SGD	0,041	10.496
	Classe ISC	22/02/2023	SGD	0,041	10.764
	Classe ISC	27/03/2023	SGD	0,040	11.478
	Classe XUP	24/06/2022	USD	0,137	12
	Classe XUP	26/09/2022	USD	0,141	13
	Classe XUP	22/12/2022	USD	0,138	12
	Classe XUP	27/03/2023	USD	0,153	14
					254.693 USD
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond					
	Classe ASC	25/04/2022	SGD	0,031	97
	Classe ASC	23/05/2022	SGD	0,031	96
	Classe ASC	24/06/2022	SGD	0,031	98
	Classe ASC	25/07/2022	SGD	0,031	98
	Classe ASC	24/08/2022	SGD	0,031	101
	Classe ASC	26/09/2022	SGD	0,031	101
	Classe ASC	25/10/2022	SGD	0,031	101
	Classe ASC	23/11/2022	SGD	0,031	109
	Classe ASC	22/12/2022	SGD	0,031	114
	Classe ASC	25/01/2023	SGD	0,031	120
	Classe ASC	22/02/2023	SGD	0,031	121
	Classe ASC	27/03/2023	SGD	0,030	120
	Classe AUP	25/04/2022	USD	0,032	22.341
	Classe AUP	23/05/2022	USD	0,032	21.537

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond <i>(suite)</i>	Classe AUP	24/06/2022	USD	0,032	21.560
	Classe AUP	25/07/2022	USD	0,032	21.630
	Classe AUP	24/08/2022	USD	0,032	20.285
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,033	20.982
	Classe AUP	25/10/2022	USD	0,033	19.486
	Classe AUP	23/11/2022	USD	0,033	19.559
	Classe AUP	22/12/2022	USD	0,033	20.162
	Classe AUP	25/01/2023	USD	0,033	20.230
	Classe AUP	22/02/2023	USD	0,033	19.400
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,031	16.128
	Classe AVC	25/04/2022	AUD	0,029	2
	Classe AVC	23/05/2022	AUD	0,029	2
	Classe AVC	24/06/2022	AUD	0,029	2
	Classe AVC	25/07/2022	AUD	0,029	2
	Classe AVC	24/08/2022	AUD	0,029	2
	Classe AVC	26/09/2022	AUD	0,030	2
	Classe AVC	25/10/2022	AUD	0,030	2
	Classe AVC	23/11/2022	AUD	0,030	2
	Classe AVC	22/12/2022	AUD	0,030	2
	Classe AVC	25/01/2023	AUD	0,030	2
	Classe AVC	22/02/2023	AUD	0,030	2
	Classe AVC	27/03/2023	AUD	0,028	2
	Classe ZUP	25/04/2022	USD	0,031	3
	Classe ZUP	23/05/2022	USD	0,031	3
	Classe ZUP	24/06/2022	USD	0,031	3
	Classe ZUP	25/07/2022	USD	0,031	3
	Classe ZUP	24/08/2022	USD	0,031	3
	Classe ZUP	26/09/2022	USD	0,032	3
	Classe ZUP	25/10/2022	USD	0,032	3
	Classe ZUP	23/11/2022	USD	0,032	3
	Classe ZUP	22/12/2022	USD	0,032	3
	Classe ZUP	25/01/2023	USD	0,032	3
	Classe ZUP	22/02/2023	USD	0,032	3
	Classe ZUP	27/03/2023	USD	0,030	3
					244.636 USD
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	Classe AEP	26/09/2022	EUR	0,006	0*
	Classe IEP	26/09/2022	EUR	0,006	0*
	Classe LEP	26/09/2022	EUR	0,006	1
	Classe ZEP	26/09/2022	EUR	0,006	1
					2 EUR
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Classe AEC	25/04/2022	EUR	0,011	730
	Classe AEC	23/05/2022	EUR	0,011	723
	Classe AEC	24/06/2022	EUR	0,015	990
	Classe AEC	25/07/2022	EUR	0,015	956
	Classe AEC	24/08/2022	EUR	0,015	934
	Classe AEC	26/09/2022	EUR	0,014	848
	Classe AEC	25/10/2022	EUR	0,014	849
	Classe AEC	23/11/2022	EUR	0,014	884

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return					
<i>(suite)</i>	Classe AEC	22/12/2022	EUR	0,017	1.108
	Classe AEC	25/01/2023	EUR	0,017	1.137
	Classe AEC	22/02/2023	EUR	0,017	1.116
	Classe AEC	27/03/2023	EUR	0,019	1.257
	Classe AUP	25/04/2022	USD	0,013	4.142
	Classe AUP	23/05/2022	USD	0,013	4.075
	Classe AUP	24/06/2022	USD	0,018	5.637
	Classe AUP	25/07/2022	USD	0,018	5.620
	Classe AUP	24/08/2022	USD	0,018	5.623
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,017	5.316
	Classe AUP	25/10/2022	USD	0,017	5.189
	Classe AUP	23/11/2022	USD	0,017	5.173
	Classe AUP	22/12/2022	USD	0,020	5.808
	Classe AUP	25/01/2023	USD	0,020	5.790
	Classe AUP	22/02/2023	USD	0,020	5.634
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,024	6.664
					76.203 USD
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Classe AEC	24/06/2022	EUR	0,069	313.033
	Classe AEC	26/09/2022	EUR	0,066	266.392
	Classe AEC	22/12/2022	EUR	0,086	379.727
	Classe AEC	27/03/2023	EUR	0,085	384.430
	Classe AEP	24/06/2022	EUR	0,089	180.810
	Classe AEP	26/09/2022	EUR	0,093	179.618
	Classe AEP	22/12/2022	EUR	0,112	250.815
	Classe AEP	27/03/2023	EUR	0,110	261.451
	Classe ASC	24/06/2022	SGD	0,082	1.139
	Classe ASC	26/09/2022	SGD	0,079	988
	Classe ASC	22/12/2022	SGD	0,103	1.395
	Classe ASC	27/03/2023	SGD	0,102	1.218
	Classe ASP	24/06/2022	SGD	0,084	332
	Classe ASP	26/09/2022	SGD	0,083	309
	Classe ASP	22/12/2022	SGD	0,103	406
	Classe ASP	27/03/2023	SGD	0,102	407
	Classe AUM	25/04/2022	USD	0,032	1.307
	Classe AUM	23/05/2022	USD	0,032	1.307
	Classe AUM	24/06/2022	USD	0,029	1.184
	Classe AUM	25/07/2022	USD	0,029	1.184
	Classe AUM	24/08/2022	USD	0,029	1.184
	Classe AUM	26/09/2022	USD	0,028	1.143
	Classe AUM	25/10/2022	USD	0,028	1.143
	Classe AUM	23/11/2022	USD	0,028	1.143
	Classe AUM	22/12/2022	USD	0,037	1.511
	Classe AUM	25/01/2023	USD	0,037	1.511
	Classe AUM	22/02/2023	USD	0,037	1.511
	Classe AUM	27/03/2023	USD	0,036	1.470
	Classe AUP	24/06/2022	USD	0,083	85.009
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,079	80.027
	Classe AUP	22/12/2022	USD	0,104	101.164
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,104	97.805

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income <i>(suite)</i>	Classe DEC	24/06/2022	EUR	0,066	181.028
	Classe DEC	26/09/2022	EUR	0,062	148.914
	Classe DEC	22/12/2022	EUR	0,081	205.327
	Classe DEC	27/03/2023	EUR	0,080	193.628
	Classe DEP	24/06/2022	EUR	0,083	24.637
	Classe DEP	26/09/2022	EUR	0,087	23.603
	Classe DEP	22/12/2022	EUR	0,104	28.433
	Classe DEP	27/03/2023	EUR	0,102	25.210
	Classe DUP	24/06/2022	USD	0,075	116.300
	Classe DUP	26/09/2022	USD	0,072	99.959
	Classe DUP	22/12/2022	USD	0,094	79.868
	Classe DUP	27/03/2023	USD	0,094	64.141
	Classe ZEC	24/06/2022	EUR	0,077	8
	Classe ZEC	26/09/2022	EUR	0,073	7
	Classe ZEC	22/12/2022	EUR	0,096	9
	Classe ZEC	27/03/2023	EUR	0,095	10
	Classe ZUP	24/06/2022	USD	0,083	8
	Classe ZUP	26/09/2022	USD	0,080	8
	Classe ZUP	22/12/2022	USD	0,105	11
	Classe ZUP	27/03/2023	USD	0,105	11
					3.793.193 USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	Classe AEC	26/09/2022	EUR	0,090	9
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,085	7
	Classe ZEC	26/09/2022	EUR	0,091	9
	Classe ZUP	26/09/2022	USD	0,086	8
	Classe AEC	27/03/2023	EUR	0,061	7
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,065	7
	Classe ZEC	27/03/2023	EUR	0,062	7
	Classe ZUP	27/03/2023	USD	0,066	7
					61 USD
Threadneedle (Lux) - Global Focus	Classe AEP	26/09/2022	EUR	0,136	479.250
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,092	3.669
	Classe IUP	26/09/2022	USD	0,094	4.737
	Classe ZEP	26/09/2022	EUR	0,141	495.188
	Classe AEP	27/03/2023	EUR	0,117	506.043
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,087	2.983
	Classe IUP	27/03/2023	USD	0,090	4.588
	Classe ZEP	27/03/2023	EUR	0,121	487.443
					1.983.901 USD
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	Classe AEC	24/06/2022	EUR	0,099	506
	Classe AEC	26/09/2022	EUR	0,074	347
	Classe AEC	22/12/2022	EUR	0,047	16
	Classe AEC	27/03/2023	EUR	0,068	24
	Classe AUP	24/06/2022	USD	0,106	9
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,075	6
	Classe AUP	22/12/2022	USD	0,053	4
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,076	6

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income (suite)	Classe DEC	24/06/2022	EUR	0,097	8
	Classe DEC	26/09/2022	EUR	0,072	5
	Classe DEC	22/12/2022	EUR	0,046	4
	Classe DEC	27/03/2023	EUR	0,066	5
	Classe DUP	24/06/2022	USD	0,104	5.127
	Classe DUP	26/09/2022	USD	0,075	3.697
	Classe DUP	22/12/2022	USD	0,053	2.613
	Classe DUP	27/03/2023	USD	0,075	3.697
	Classe 1EP	24/06/2022	EUR	0,116	178.563
	Classe 1EP	26/09/2022	EUR	0,090	128.169
	Classe 1EP	22/12/2022	EUR	0,060	91.837
	Classe 1EP	27/03/2023	EUR	0,083	127.226
	Classe 1SC	24/06/2022	SGD	0,104	33.653
	Classe 1SC	26/09/2022	SGD	0,076	24.001
	Classe 1SC	22/12/2022	SGD	0,052	16.975
	Classe 1SC	27/03/2023	SGD	0,074	24.070
	Classe 1ST	25/04/2022	SGD	0,021	888
	Classe 1ST	23/05/2022	SGD	0,038	1.586
	Classe 1ST	24/06/2022	SGD	0,044	1.831
	Classe 1ST	25/07/2022	SGD	0,013	775
	Classe 1ST	24/08/2022	SGD	0,027	1.601
	Classe 1ST	26/09/2022	SGD	0,030	1.725
	Classe 1ST	25/10/2022	SGD	0,014	821
	Classe 1ST	23/11/2022	SGD	0,015	916
	Classe 1ST	22/12/2022	SGD	0,023	1.395
	Classe 1ST	25/01/2023	SGD	0,021	1.274
	Classe 1ST	22/02/2023	SGD	0,017	1.020
	Classe 1ST	27/03/2023	SGD	0,036	2.183
	Classe 1UP	24/06/2022	USD	0,107	43.826
	Classe 1UP	26/09/2022	USD	0,077	31.317
	Classe 1UP	22/12/2022	USD	0,055	22.193
	Classe 1UP	27/03/2023	USD	0,078	30.902
	Classe 1VT	25/04/2022	AUD	0,021	125
	Classe 1VT	23/05/2022	AUD	0,037	213
	Classe 1VT	24/06/2022	AUD	0,043	245
	Classe 1VT	25/07/2022	AUD	0,018	103
	Classe 1VT	24/08/2022	AUD	0,025	154
	Classe 1VT	26/09/2022	AUD	0,029	168
	Classe 1VT	25/10/2022	AUD	0,014	78
	Classe 1VT	23/11/2022	AUD	0,014	83
	Classe 1VT	22/12/2022	AUD	0,022	131
	Classe 1VT	25/01/2023	AUD	0,019	119
	Classe 1VT	22/02/2023	AUD	0,016	98
	Classe 1VT	27/03/2023	AUD	0,035	134
	Classe 2EP	24/06/2022	EUR	0,118	9
	Classe 2EP	26/09/2022	EUR	0,092	6
	Classe 2EP	22/12/2022	EUR	0,060	5
	Classe 2EP	27/03/2023	EUR	0,083	6
	Classe 2UP	24/06/2022	USD	0,109	9

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income <i>(suite)</i>	Classe 2UP	26/09/2022	USD	0,078	6
	Classe 2UP	22/12/2022	USD	0,055	5
	Classe 2UP	27/03/2023	USD	0,079	6
	Classe 3EP	24/06/2022	EUR	0,118	1.044.736
	Classe 3EP	26/09/2022	EUR	0,093	650.582
	Classe 3EP	22/12/2022	EUR	0,061	466.789
	Classe 3EP	27/03/2023	EUR	0,084	651.468
	Classe 3UP	24/06/2022	USD	0,110	4.337
	Classe 3UP	26/09/2022	USD	0,079	1.592
	Classe 3UP	22/12/2022	USD	0,056	1.129
	Classe 3UP	27/03/2023	USD	0,080	1.613
	Classe 8EP	24/06/2022	EUR	0,118	30
	Classe 8EP	26/09/2022	EUR	0,092	21
	Classe 8EP	22/12/2022	EUR	0,060	15
	Classe 8EP	27/03/2023	EUR	0,084	21
	Classe 8UP	24/06/2022	USD	0,109	6.320
	Classe 8UP	26/09/2022	USD	0,078	4.523
	Classe 8UP	22/12/2022	USD	0,056	3.247
	Classe 8UP	27/03/2023	USD	0,079	8.333
	Classe 9EP	24/06/2022	EUR	0,119	9
	Classe 9EP	26/09/2022	EUR	0,093	7
	Classe 9EP	22/12/2022	EUR	0,060	5
	Classe 9EP	27/03/2023	EUR	0,084	7
	Classe 9UP	24/06/2022	USD	0,110	9
	Classe 9UP	26/09/2022	USD	0,079	6
	Classe 9UP	22/12/2022	USD	0,056	5
	Classe 9UP	27/03/2023	USD	0,079	6
					3.631.334 USD
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	Classe AEP	27/03/2023	EUR	0,124	2.831.822
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,113	7.187
	Classe IEP	27/03/2023	EUR	0,106	269.229
					3.108.238 EUR
Threadneedle (Lux) - American	Classe 1EP	27/03/2023	EUR	0,226	75.664
					75.664 USD
Threadneedle (Lux) - American Select	Classe 1EP	27/03/2023	EUR	0,083	34.680
					34.680 USD
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	Classe 1EP	27/03/2023	EUR	0,220	265.086
					265.086 USD
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	Classe XUP	26/09/2022	USD	0,185	473.152
	Classe XUP	27/03/2023	USD	0,106	271.103
					744.255 USD

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	Classe AEC	26/09/2022	EUR	0,123	6
	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,129	1.189
	Classe AEC	27/03/2023	EUR	0,108	6
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,131	1.165
					2.366 USD
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,125	8
	Classe IEC	26/09/2022	EUR	0,121	7
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,135	9
	Classe IEC	27/03/2023	EUR	0,117	7
					31 USD
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	Classe 1EP	27/03/2023	EUR	0,368	24
	Classe 1GP	27/03/2023	GBP	0,360	24
	Classe 3GP	27/03/2023	GBP	0,371	161
	Classe 9GP	27/03/2023	GBP	0,373	24
					233 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	Classe 1EP	26/09/2022	EUR	0,035	371.038
	Classe 1EP	27/03/2023	EUR	0,011	114.499
	Classe 1GP	26/09/2022	GBP	0,031	11.429
	Classe 1GP	27/03/2023	GBP	0,010	3.736
	Classe 2EP	26/09/2022	EUR	0,356	26
	Classe 2EP	27/03/2023	EUR	0,113	8
	Classe 2GP	26/09/2022	GBP	0,359	25
	Classe 2GP	27/03/2023	GBP	0,113	8
	Classe 3EP	26/09/2022	EUR	0,056	3.990
	Classe 3EP	27/03/2023	EUR	0,018	1.283
	Classe 3GP	26/09/2022	GBP	0,050	34.197
	Classe 3GP	27/03/2023	GBP	0,016	11.108
	Classe 4GP	26/09/2022	GBP	0,046	267.760
	Classe 4GP	27/03/2023	GBP	0,014	116.916
	Classe 8EP	26/09/2022	EUR	0,037	31.847
	Classe 8EP	27/03/2023	EUR	0,012	10.329
	Classe 8GP	26/09/2022	GBP	0,033	16.998
	Classe 8GP	27/03/2023	GBP	0,010	5.389
	Classe 9EP	26/09/2022	EUR	0,357	25
	Classe 9EP	27/03/2023	EUR	0,114	8
	Classe 9GP	26/09/2022	GBP	0,362	26
	Classe 9GP	27/03/2023	GBP	0,114	34
	Classe AEP	26/09/2022	EUR	0,346	11.866
	Classe AEP	27/03/2023	EUR	0,109	4.174
Classe AUP	26/09/2022	USD	0,305	25	
Classe AUP	27/03/2023	USD	0,107	8	
Classe DEP	26/09/2022	EUR	0,341	5.875	
Classe DEP	27/03/2023	EUR	0,107	1.863	
Classe IEP	26/09/2022	EUR	0,357	307.207	
Classe IEP	27/03/2023	EUR	0,114	74.498	

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend (suite)	Classe ZEP	26/09/2022	EUR	0,355	8.095
	Classe ZEP	27/03/2023	EUR	0,113	2.577
					1.416.867 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	Classe 1EP	27/03/2023	EUR	0,186	126.015
	Classe 3EP	27/03/2023	EUR	0,192	180.310
	Classe 3GP	27/03/2023	GBP	0,187	30.570
	Classe 9EP	27/03/2023	EUR	0,192	12
	Classe 9GP	27/03/2023	GBP	0,188	12
					336.919 EUR
Threadneedle (Lux) - European Select	Classe 1EP	27/03/2023	EUR	0,213	194.688
	Classe 2EP	27/03/2023	EUR	0,221	13
	Classe 8EP	27/03/2023	EUR	0,221	5.790
					200.491 EUR
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	Classe 1EP	27/03/2023	EUR	0,226	781.099
	Classe 3EP	27/03/2023	EUR	0,233	18.966
	Classe 9EP	27/03/2023	EUR	0,233	129.402
					929.467 EUR
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	Classe AUP	26/09/2022	USD	0,286	45.163
	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,168	31.295
	Classe DUP	26/09/2022	USD	0,278	16.296
	Classe DUP	27/03/2023	USD	0,163	4.483
	Classe IEP	26/09/2022	EUR	0,342	348.469
	Classe IEP	27/03/2023	EUR	0,180	205.943
	Classe XUP	26/09/2022	USD	0,302	75.948
	Classe XUP	27/03/2023	USD	0,178	48.022
	Classe ZGP	26/09/2022	GBP	0,313	19
	Classe ZGP	27/03/2023	GBP	0,163	11
	Classe ZUP	26/09/2022	USD	0,334	1.227
	Classe ZUP	27/03/2023	USD	0,197	743
Threadneedle (Lux) - Global Technology	Classe AUP	27/03/2023	USD	0,145	10.451
					10.451 USD
Threadneedle (Lux) - UK Equities	Classe AGP	26/09/2022	GBP	0,383	16.731
	Classe AGP	27/03/2023	GBP	0,197	5.892
	Classe IGP	26/09/2022	GBP	0,567	338.830
	Classe IGP	27/03/2023	GBP	0,293	65.024
	Classe NGP	26/09/2022	GBP	0,227	13
	Classe NGP	27/03/2023	GBP	0,116	7
	Classe TGP	26/09/2022	GBP	0,227	13
	Classe TGP	27/03/2023	GBP	0,116	7
	Classe ZGP	26/09/2022	GBP	0,204	265.325
Classe ZGP	27/03/2023	GBP	0,105	12.195	

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - UK Equities (suite)	Classe 9EP	26/09/2022	EUR	0,179	412.664
	Classe 9EP	27/03/2023	EUR	0,093	211.997
					1.328.698 GBP
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	Classe AEC	24/06/2022	EUR	0,117	5.839
	Classe AEC	26/09/2022	EUR	0,081	4.000
	Classe AEC	22/12/2022	EUR	0,089	3.617
	Classe AEC	27/03/2023	EUR	0,059	2.346
	Classe ASC	24/06/2022	SGD	0,122	10
	Classe ASC	26/09/2022	SGD	0,080	7
	Classe ASC	22/12/2022	SGD	0,095	8
	Classe ASC	27/03/2023	SGD	0,062	5
	Classe AUC	24/06/2022	USD	0,127	56.110
	Classe AUC	26/09/2022	USD	0,082	39.960
	Classe AUC	22/12/2022	USD	0,105	41.605
	Classe AUC	27/03/2023	USD	0,066	9.790
	Classe DEC	24/06/2022	EUR	0,112	1.228
	Classe DEC	26/09/2022	EUR	0,074	839
	Classe DEC	22/12/2022	EUR	0,084	938
	Classe DEC	27/03/2023	EUR	0,055	617
	Classe DGP	24/06/2022	GBP	0,125	101
	Classe DGP	26/09/2022	GBP	0,085	69
	Classe DGP	22/12/2022	GBP	0,094	76
	Classe DGP	27/03/2023	GBP	0,061	49
	Classe IGP	24/06/2022	GBP	0,133	180.846
	Classe IGP	26/09/2022	GBP	0,089	125.937
	Classe IGP	22/12/2022	GBP	0,100	149.178
Classe IGP	27/03/2023	GBP	0,065	103.841	
Classe LGP	24/06/2022	GBP	0,134	1.576.236	
Classe LGP	26/09/2022	GBP	0,091	1.098.940	
Classe LGP	22/12/2022	GBP	0,102	1.249.139	
Classe LGP	27/03/2023	GBP	0,067	808.633	
Classe ZGP	24/06/2022	GBP	0,138	17.245	
Classe ZGP	26/09/2022	GBP	0,092	15.120	
Classe ZGP	22/12/2022	GBP	0,104	10.586	
Classe ZGP	27/03/2023	GBP	0,069	6.662	
					5.509.577 GBP
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Classe 1EP	27/03/2023	EUR	0,377	20.237
	Classe 2EP	27/03/2023	EUR	0,385	104.683
	Classe 2GC	27/03/2023	GBP	0,397	34
	Classe 8EP	27/03/2023	EUR	0,385	47.983
	Classe 8GC	27/03/2023	GBP	0,407	577
					173.514 EUR
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Classe IEP	24/06/2022	EUR	0,086	8
	Classe IEP	26/09/2022	EUR	0,078	7
	Classe IEP	22/12/2022	EUR	0,081	7
	Classe IEP	27/03/2023	EUR	0,074	7

Annexes aux Comptes

(suite)

7 DIVIDENDES

(suite)

Portefeuille	Classe d'actions	Date de détachement	Devise de la Classe d'actions	Montant par Action (dans la devise de la Classe d'actions)	Montant total (dans la devise du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities					
(suite)	Classe LEP	24/06/2022	EUR	0,087	7
	Classe LEP	26/09/2022	EUR	0,078	7
	Classe LEP	22/12/2022	EUR	0,082	7
	Classe LEP	27/03/2023	EUR	0,075	7
					57 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha					
	Classe AEP	27/03/2023	EUR	0,195	5.516
					5.516 EUR

* Montant infime arrondi à 0.

Annexes aux Comptes

(suite)

8 COMMISSIONS DE PERFORMANCE

La Société de gestion percevra une commission de performance comme indiqué ci-dessous sur les Classes d'actions des Portefeuilles indiqués dans le tableau ci-dessous. Des provisions seront constituées chaque jour pour comptabiliser la commission de performance suivant le solde de ladite commission (tel que décrit ci-dessous) et le montant cumulé sera versé à la Société de gestion à la fin de chaque année civile (c'est-à-dire au 31 décembre). La Société de Gestion est chargée de payer tout ou partie de la Commission de performance aux Conseillers par délégation conformément à leur Convention de Conseiller par délégation. Le montant de la commission de performance est fonction de la performance de la Valeur nette d'inventaire de la Classe d'actions concernée au sein du Portefeuille concerné par rapport à l'indice de performance concerné (l'« Indice de performance » tel que décrit dans le tableau ci-dessous). L'Indice de performance est dépendant d'un taux de rendement minimum, afin de garantir que les Portefeuilles dégagent un taux de rendement positif minimum pour qu'une commission de performance soit versée, dans le cas où le rendement de l'indice de référence sous-jacent est négatif. Des provisions ne seront effectuées que lorsque le montant de la commission de performance est positif et que la High Water Mark de la VNI (voir la définition ci-dessous) est dépassée.

La période de référence de performance pour chaque Classe d'actions correspond à la durée de vie entière de la Classe d'actions, c.-à-d. de la date de lancement jusqu'à la date de clôture.

Afin d'éviter toute ambiguïté, la performance atteinte par les Classes d'actions comprend les dividendes versés.

Portefeuille	Classes d'actions	Indice de performance	Taux de performance
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Actions A Actions D Actions I Actions Z	Valeur la plus élevée du 90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR) plus 1,75 %, sous réserve d'un minimum de 1,50 %	20 %
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Actions J Actions Y	Niveau le plus élevé entre les taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois plus 1,00 %, sous réserve d'un minimum de 1,00 %	10 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Actions A Actions D Actions I Actions L Actions Z	Niveau le plus élevé entre l'Euro Interbank Offered Rate (EURIBOR) ¹ à 3 mois plus 1,50 %, sous réserve d'un minimum de 1,50 %	20 %

¹ L'indice de référence est fourni par l'European Money Markets Institute, un administrateur figurant dans le registre des administrateurs de référence de l'AEMF. La Société de gestion maintient un plan écrit précisant les mesures qui seront prises en cas de changement important ou de suppression de l'indice de référence.

La performance des Portefeuilles Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities et Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha, y compris l'impact de toutes les commissions applicables, est comparée à l'Indice de performance.

High Water Mark de la VNI : pour chaque Classe d'actions, il s'agit de la Valeur nette d'inventaire d'une Action de cette Classe d'actions à la dernière Date d'évaluation de la dernière année civile concernée pour laquelle une quelconque commission de performance cumulée a été payée. Si la commission de performance n'a jamais été payée, la High Water Mark de la VNI sera le prix de départ pour la Classe d'actions concernée. La High Water Mark de la VNI ne peut être qu'augmentée, et ne saurait en aucun cas être diminuée.

Le solde de la commission de performance sera calculé sur la différence entre la performance de l'Indice de performance et la performance de la Classe d'actions concernée (la « Différence journalière ») :

- (i) dans le cas où la Différence journalière est positive, le solde de la commission de performance augmentera d'un montant proportionnel à la Différence journalière, au taux de performance applicable ;
- (ii) si la Différence journalière est négative, le solde de la commission de performance sera réduit d'un montant proportionnel à la Différence journalière, au taux de performance applicable.

Si le solde de la commission de performance est positif à la fin de l'année civile, à savoir au 31 décembre, et que la High Water Mark de la VNI est dépassée, le montant cumulé de la commission de performance sera payé à la Société de gestion au cours du premier trimestre de l'année civile suivante. La commission de performance sera payée à la Société de gestion uniquement si la Valeur nette d'inventaire de la Classe d'actions concernée dépasse la High Water Mark de la VNI et si le solde de la commission de performance est positif.

Si le solde de la commission de performance est négatif à la fin de l'année civile et que la High Water Mark de la VNI n'a pas été dépassée, ce montant sera reporté et la Société de gestion ne percevra pas de commission de performance jusqu'à ce que le solde de la commission de performance cumulée soit positif et que la High Water Mark de la VNI soit dépassée, à la fin d'une année civile suivante.

Si le solde de la commission de performance est négatif à la fin de l'année civile et que la High Water Mark de la VNI a été dépassée, ce montant sera reporté et la Société de gestion ne percevra pas de commission de performance jusqu'à ce que le solde de la commission de performance cumulée soit positif et que la High Water Mark de la VNI soit dépassée, à la fin d'une année civile ultérieure.

Annexes aux Comptes

(suite)

8 COMMISSIONS DE PERFORMANCE

(suite)

Dans le cas où un Portefeuille ou une Classe d'actions serait liquidé(e) ou si un Portefeuille ou une Classe d'actions en question se trouvait inactif(ve), toute commission de performance cumulée sera liquidée et payable à la Société de gestion. Par la suite, lorsque de nouveaux Actionnaires auront investi dans un tel Portefeuille ou une telle Classe d'actions, la comptabilisation du solde de la commission de performance reprendra à zéro.

La commission de performance pouvant être prélevée ne fait l'objet d'aucune valeur maximale.

Pour l'exercice clos le 31 mars 2023, aucune commission de performance n'a été payée.

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

Au 31 mars 2023, la SICAV possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	6.984	USD	7.485	Couverture	JP Morgan Chase New York	111
19/04/2023	GBP	180.185	USD	221.968	Couverture	JP Morgan Chase New York	909
19/04/2023	GBP	287.799	USD	354.537	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.452
19/04/2023	GBP	61	USD	75	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	1.096.517	USD	1.350.791	Couverture	JP Morgan Chase New York	5.530
19/04/2023	GBP	17.712	USD	21.667	Couverture	JP Morgan Chase New York	241
19/04/2023	GBP	795.037	USD	963.534	Couverture	JP Morgan Chase New York	19.876
19/04/2023	GBP	4.239	USD	5.186	Couverture	JP Morgan Chase New York	58
19/04/2023	GBP	316.884	USD	387.646	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.319
19/04/2023	GBP	226.800	USD	279.701	Couverture	JP Morgan Chase New York	836
19/04/2023	GBP	1.005.551	USD	1.233.174	Couverture	JP Morgan Chase New York	10.629
19/04/2023	EUR	13.840	USD	14.955	Couverture	JP Morgan Chase New York	97
19/04/2023	EUR	13.395	USD	14.284	Couverture	JP Morgan Chase New York	285
19/04/2023	EUR	322	USD	343	Couverture	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	12.415	USD	13.305	Couverture	JP Morgan Chase New York	197
19/04/2023	GBP	3.847.317	USD	4.682.045	Couverture	JP Morgan Chase New York	76.840
19/04/2023	EUR	113.222	USD	121.344	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.797
19/04/2023	EUR	44.471	USD	47.661	Couverture	JP Morgan Chase New York	706
19/04/2023	EUR	3.990	USD	4.211	Couverture	JP Morgan Chase New York	129
19/04/2023	GBP	26.080.232	USD	31.734.713	Couverture	JP Morgan Chase New York	524.865
19/04/2023	EUR	109.434	USD	117.511	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.509
19/04/2023	EUR	8	USD	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	299.600	USD	324.935	Couverture	JP Morgan Chase New York	911
19/04/2023	EUR	27.893	USD	30.252	Couverture	JP Morgan Chase New York	85
19/04/2023	CHF	8	USD	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	8	USD	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	2.990	USD	3.181	Couverture	JP Morgan Chase New York	71
19/04/2023	EUR	135.774	USD	145.514	Couverture	JP Morgan Chase New York	2.155
19/04/2023	EUR	151.422	USD	162.284	Couverture	JP Morgan Chase New York	2.403
19/04/2023	EUR	22.675	USD	24.301	Couverture	JP Morgan Chase New York	360
19/04/2023	EUR	22.179	USD	24.044	Couverture	JP Morgan Chase New York	78
19/04/2023	EUR	186.881	USD	200.287	Couverture	JP Morgan Chase New York	2.966
19/04/2023	EUR	16.832.911	USD	18.107.216	Couverture	JP Morgan Chase New York	200.291
19/04/2023	EUR	458.158	USD	491.024	Couverture	JP Morgan Chase New York	7.271
19/04/2023	EUR	40.630.500	USD	43.706.359	Couverture	JP Morgan Chase New York	483.454
19/04/2023	EUR	26.015	USD	27.454	Couverture	JP Morgan Chase New York	840
19/04/2023	EUR	1.100.118	USD	1.183.401	Couverture	JP Morgan Chase New York	13.090
19/04/2023	EUR	75.000.000	USD	80.953.905	Couverture	JP Morgan Chase New York	616.245
19/04/2023	EUR	87	USD	94	Couverture	JP Morgan Chase New York	1

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	105.903	USD	115.483	Couverture	JP Morgan Chase New York	(303)
19/04/2023	EUR	15	USD	16	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14.897	USD	15.847	Couverture	JP Morgan Chase New York	354
19/04/2023	EUR	40.446	USD	43.584	Couverture	JP Morgan Chase New York	405
19/04/2023	EUR	4.380	USD	4.751	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	CHF	768	USD	845	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	10.086.292	USD	10.849.856	Couverture	JP Morgan Chase New York	120.015
19/04/2023	EUR	1.281	USD	1.399	Couverture	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	NOK	82	USD	8	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	82	USD	8	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14.339	USD	15.398	Couverture	JP Morgan Chase New York	198
19/04/2023	SEK	96.500	USD	9.089	Couverture	JP Morgan Chase New York	227
19/04/2023	GBP	3.595	USD	4.375	Couverture	JP Morgan Chase New York	72
19/04/2023	EUR	12.273.737	USD	13.202.898	Couverture	JP Morgan Chase New York	146.043
19/04/2023	EUR	13.694.081	USD	14.730.767	Couverture	JP Morgan Chase New York	162.943
19/04/2023	SEK	7.163	USD	679	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	2.129.877	USD	2.291.116	Couverture	JP Morgan Chase New York	25.343
19/04/2023	GBP	320.401	USD	395.134	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.182
19/04/2023	EUR	4.990	USD	5.392	Couverture	JP Morgan Chase New York	35
19/04/2023	EUR	24.406	USD	26.372	Couverture	JP Morgan Chase New York	172
19/04/2023	GBP	31.606	USD	38.675	Couverture	JP Morgan Chase New York	420
19/04/2023	EUR	501	USD	541	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	1.068.039	USD	1.303.173	Couverture	JP Morgan Chase New York	17.923
19/04/2023	EUR	49.869	USD	54.061	Couverture	JP Morgan Chase New York	176
19/04/2023	EUR	209.287	USD	226.881	Couverture	JP Morgan Chase New York	741
19/04/2023	EUR	2.990	USD	3.213	Couverture	JP Morgan Chase New York	39
19/04/2023	GBP	731.745	USD	889.436	Couverture	JP Morgan Chase New York	15.686
19/04/2023	GBP	321.159.349	USD	390.790.228	Couverture	JP Morgan Chase New York	6.463.333
19/04/2023	GBP	538.066	USD	660.644	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.909
19/04/2023	USD	25.864	EUR	24.313	Couverture	JP Morgan Chase New York	(577)
19/04/2023	GBP	1.181.631	USD	1.456.680	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.922
19/04/2023	GBP	1.179	USD	1.460	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	GBP	5.528	USD	6.727	Couverture	JP Morgan Chase New York	111
19/04/2023	EUR	3.934.074	USD	4.231.895	Couverture	JP Morgan Chase New York	46.811
19/04/2023	EUR	707	USD	761	Couverture	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	GBP	751.955	USD	914.980	Couverture	JP Morgan Chase New York	15.139
19/04/2023	GBP	98.663.213	USD	120.054.483	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.985.597
19/04/2023	NOK	7.248	USD	690	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	NOK	7.291	USD	694	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	GBP	64.847	USD	79.854	Couverture	JP Morgan Chase New York	358
19/04/2023	GBP	298.090	USD	369.179	Couverture	JP Morgan Chase New York	(460)
19/04/2023	GBP	983.139	USD	1.203.025	Couverture	JP Morgan Chase New York	13.055
19/04/2023	GBP	16.432.095	USD	19.994.754	Couverture	JP Morgan Chase New York	330.696
19/04/2023	SEK	8.468.579	USD	802.214	Couverture	JP Morgan Chase New York	15.351
19/04/2023	GBP	302.464	USD	368.041	Couverture	JP Morgan Chase New York	6.087
19/04/2023	GBP	118.283	USD	142.399	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.910
19/04/2023	GBP	870.282	USD	1.047.719	Couverture	JP Morgan Chase New York	28.765
19/04/2023	GBP	791.575	USD	961.547	Couverture	JP Morgan Chase New York	17.580
19/04/2023	SEK	81	USD	8	Couverture	JP Morgan Chase New York	0

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	657.237	USD	706.992	Couverture	JP Morgan Chase New York	7.820
19/04/2023	USD	7.391	EUR	6.821	Couverture	JP Morgan Chase New York	(28)
19/04/2023	CHF	766	USD	844	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	2.304.000	USD	2.486.904	Couverture	JP Morgan Chase New York	18.931
19/04/2023	USD	4.058	GBP	3.316	Couverture	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	USD	24.845	EUR	22.784	Couverture	JP Morgan Chase New York	65
19/04/2023	USD	27.869	EUR	25.837	Couverture	JP Morgan Chase New York	(231)
19/04/2023	USD	11.486	GBP	9.413	Couverture	JP Morgan Chase New York	(158)
19/04/2023	USD	172	EUR	159	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	30.067	EUR	28.000	Couverture	JP Morgan Chase New York	(386)
19/04/2023	USD	41.054	GBP	33.289	Couverture	JP Morgan Chase New York	(123)
19/04/2023	USD	41.770	EUR	39.580	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.276)
19/04/2023	USD	9.942	GBP	8.064	Couverture	JP Morgan Chase New York	(34)
19/04/2023	USD	87	GBP	71	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	44.986	GBP	37.367	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.235)
19/04/2023	USD	33.968	GBP	27.963	Couverture	JP Morgan Chase New York	(621)
19/04/2023	USD	622	EUR	578	Couverture	JP Morgan Chase New York	(7)
19/04/2023	USD	58.087	EUR	54.000	Couverture	JP Morgan Chase New York	(643)
19/04/2023	USD	485	EUR	451	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	USD	15.839	GBP	13.069	Couverture	JP Morgan Chase New York	(327)
19/04/2023	USD	257	EUR	238	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	147.868	EUR	136.472	Couverture	JP Morgan Chase New York	(558)
19/04/2023	USD	15.098	EUR	13.824	Couverture	JP Morgan Chase New York	64
19/04/2023	USD	111	EUR	103	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	236.247	GBP	191.565	Couverture	JP Morgan Chase New York	(706)
19/04/2023	USD	240.327	EUR	225.377	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4.788)
19/04/2023	USD	1.218	EUR	1.154	Couverture	JP Morgan Chase New York	(37)
19/04/2023	USD	3.261	EUR	3.037	Couverture	JP Morgan Chase New York	(42)
19/04/2023	USD	274.992	GBP	223.312	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.231)
19/04/2023	USD	320.918	GBP	260.607	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.436)
19/04/2023	USD	86.659	GBP	70.296	Couverture	JP Morgan Chase New York	(293)
19/04/2023	USD	130	EUR	121	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	2.506	GBP	2.061	Couverture	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	USD	24.153	GBP	19.672	Couverture	JP Morgan Chase New York	(179)
05/04/2023	USD	52.168	JPY	6.881.139	Négociation	JP Morgan	430
05/04/2023	USD	9.811	AUD	14.627	Négociation	JP Morgan	13
05/04/2023	USD	30.798	JPY	4.036.927	Négociation	Goldman Sachs	445
05/04/2023	USD	221.637	CAD	303.145	Négociation	JP Morgan	(2.373)
05/04/2023	USD	7.177	AUD	10.792	Négociation	JP Morgan	(52)
05/04/2023	USD	1.394.010	GBP	1.135.120	Négociation	Citigroup Global Markets	(9.643)
05/04/2023	USD	764.112	EUR	710.310	Négociation	JP Morgan	(7.799)
05/04/2023	JPY	4.572.392	USD	34.097	Négociation	JP Morgan	282
05/04/2023	JPY	4.040.268	USD	31.190	Négociation	Goldman Sachs	(813)
05/04/2023	USD	593.192	GBP	485.420	Négociation	JP Morgan	(7.062)
05/04/2023	USD	1.461.904	EUR	1.356.779	Négociation	Goldman Sachs	(12.540)
05/04/2023	GBP	1.129.280	USD	1.394.500	Négociation	Citigroup Global Markets	1.933
05/04/2023	USD	2.432	AUD	3.644	Négociation	JP Morgan	(9)
05/04/2023	USD	2.141.312	EUR	1.975.420	Négociation	Barclays	(5.427)
05/04/2023	USD	216.795	EUR	200.000	Négociation	Citigroup Global Markets	(550)

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
05/04/2023	USD	593.525	EUR	554.410	Négociation	JP Morgan	(8.964)
05/04/2023	JPY	4.263.392	USD	32.317	Négociation	JP Morgan	(261)
05/04/2023	USD	173.923	CAD	238.261	Négociation	JP Morgan	(2.141)
05/04/2023	USD	5.509.708	EUR	5.209.140	Négociation	JP Morgan	(151.161)
05/04/2023	USD	233.462	CAD	320.853	Négociation	JP Morgan	(3.634)
05/04/2023	USD	21.347.734	EUR	19.720.000	Négociation	Barclays	(82.482)
05/04/2023	USD	11.706	AUD	17.624	Négociation	JP Morgan	(100)
05/04/2023	USD	14.835	AUD	22.196	Négociation	JP Morgan	(33)
05/04/2023	USD	163.792	EUR	150.000	Négociation	Barclays	783
05/04/2023	USD	179.319.822	EUR	168.916.094	Négociation	JP Morgan	(4.244.610)
05/04/2023	USD	248.700	EUR	235.190	Négociation	JP Morgan	(6.886)
05/04/2023	USD	676.171	EUR	628.750	Négociation	Barclays	(7.107)
05/04/2023	USD	7.129	AUD	10.708	Négociation	JP Morgan	(44)
05/04/2023	USD	6.577	AUD	9.856	Négociation	JP Morgan	(25)
05/04/2023	USD	65.227.254	GBP	54.637.542	Négociation	JP Morgan	(2.335.612)
05/04/2023	USD	8.019.588	CAD	10.922.399	Négociation	JP Morgan	(51.570)
05/04/2023	USD	1.444	AUD	2.156	Négociation	Citigroup Global Markets	0
05/04/2023	JPY	2.764.716	USD	21.079	Négociation	JP Morgan	(292)
05/04/2023	JPY	8.265.002	USD	62.237	Négociation	JP Morgan	(95)
05/04/2023	USD	12.174	AUD	18.222	Négociation	JP Morgan	(32)
05/04/2023	CAD	122.598	USD	89.488	Négociation	Citigroup Global Markets	1.107
05/04/2023	USD	7.287	AUD	11.031	Négociation	JP Morgan	(102)
05/04/2023	USD	720.863	CAD	985.000	Négociation	JP Morgan	(7.008)
05/04/2023	EUR	1.806.260	USD	1.914.370	Négociation	Citigroup Global Markets	48.539
05/04/2023	USD	18.981	JPY	2.588.984	Négociation	Goldman Sachs	(484)
05/04/2023	AUD	25.093	USD	16.870	Négociation	Goldman Sachs	(61)
05/04/2023	AUD	171.397	USD	115.305	Négociation	JP Morgan	(493)
05/04/2023	AUD	8.526	USD	5.709	Négociation	JP Morgan	2
05/04/2023	EUR	1.275.745	USD	1.370.985	Négociation	JP Morgan	15.401
05/04/2023	EUR	1.057.617	USD	1.144.877	Négociation	Citigroup Global Markets	4.464
05/04/2023	AUD	15.094	USD	10.063	Négociation	JP Morgan	48
05/04/2023	AUD	5.413	USD	3.650	Négociation	Citigroup Global Markets	(25)
05/04/2023	USD	45.873	JPY	6.086.880	Négociation	JP Morgan	107
05/04/2023	AUD	10.707	USD	7.250	Négociation	JP Morgan	(78)
05/04/2023	USD	242.476	EUR	228.580	Négociation	Barclays	(5.926)
05/04/2023	CAD	208.089	USD	151.981	Négociation	JP Morgan	1.788
05/04/2023	CAD	69.337	USD	50.893	Négociation	JP Morgan	344
05/04/2023	EUR	1.300.000	USD	1.412.683	Négociation	JP Morgan	61
05/04/2023	CAD	100.662	USD	73.644	Négociation	JP Morgan	741
05/04/2023	EUR	1.656.590	USD	1.778.020	Négociation	JP Morgan	22.240
05/04/2023	CAD	97.076	USD	71.353	Négociation	JP Morgan	381
05/04/2023	CAD	232.274	USD	169.577	Négociation	JP Morgan	2.063
05/04/2023	CAD	317.889	USD	232.638	Négociation	JP Morgan	2.268
05/04/2023	AUD	8.255	USD	5.466	Négociation	JP Morgan	63
05/04/2023	USD	6.648.320	GBP	5.400.000	Négociation	Barclays	(29.150)
05/04/2023	USD	3.137.320	GBP	2.534.230	Négociation	Barclays	3.570
05/04/2023	USD	2.875.127	JPY	391.796.323	Négociation	Citigroup Global Markets	(70.625)
05/04/2023	USD	348.467	JPY	45.600.000	Négociation	Goldman Sachs	5.610
05/04/2023	JPY	5.625.897	USD	41.535	Négociation	JP Morgan	764

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
05/04/2023	USD	182.408	CAD	247.967	Négociation	Goldman Sachs	(828)
05/04/2023	CAD	68.427	USD	50.463	Négociation	JP Morgan	101
05/04/2023	USD	46.329	CAD	63.727	Négociation	JP Morgan	(762)
05/04/2023	USD	761.372	EUR	721.010	Négociation	JP Morgan	(22.162)
05/04/2023	USD	716.123	GBP	581.390	Négociation	Citigroup Global Markets	(2.806)
05/04/2023	USD	6.084	AUD	9.146	Négociation	JP Morgan	(42)
05/04/2023	JPY	5.362.561	USD	40.436	Négociation	JP Morgan	(117)
05/04/2023	USD	78.240	CAD	107.897	Négociation	JP Morgan	(1.491)
05/04/2023	JPY	11.556.083	USD	87.088	Négociation	JP Morgan	(201)
05/04/2023	USD	301.581	CAD	414.173	Négociation	JP Morgan	(4.473)
05/04/2023	USD	4.840	AUD	7.226	Négociation	JP Morgan	0
05/04/2023	USD	1.417	AUD	2.133	Négociation	JP Morgan	(11)
05/04/2023	USD	1.549.865	EUR	1.458.348	Négociation	JP Morgan	(34.950)
05/04/2023	USD	84.263	CAD	115.881	Négociation	JP Morgan	(1.368)
05/04/2023	USD	2.929	AUD	4.442	Négociation	JP Morgan	(47)
05/04/2023	USD	113.441	CAD	156.902	Négociation	JP Morgan	(2.503)
05/04/2023	USD	1.416.321	EUR	1.320.703	Négociation	Citigroup Global Markets	(18.917)
05/04/2023	USD	246.037	EUR	231.840	Négociation	JP Morgan	(5.908)
04/04/2023	GBP	581.390	USD	716.110	Négociation	Citigroup Global Markets	2.801
03/04/2023	EUR	1.975.420	USD	2.141.089	Négociation	Barclays	5.379
							4.390.217 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
04/05/2023	EUR	4.022.426	GBP	3.537.901	Négociation	Lloyds	980
04/05/2023	EUR	8.588.282	USD	9.362.361	Négociation	Lloyds	(12.537)
04/05/2023	EUR	198.777	GBP	175.000	Négociation	NatWest Markets	(141)
19/04/2023	CHF	785	EUR	803	Couverture	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	NOK	85	EUR	8	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	84	EUR	7	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	643	EUR	727	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	USD	903	EUR	839	Couverture	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	NOK	7.532	EUR	667	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	USD	14	EUR	13	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	7.464	EUR	661	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	CHF	10	EUR	10	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	10	EUR	10	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	795	EUR	814	Couverture	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	GBP	9	EUR	11	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
04/04/2023	EUR	48.432	USD	51.503	Négociation	JP Morgan	1.036
04/04/2023	EUR	4.103.796	GBP	3.637.901	Négociation	Lloyds	(35.880)
04/04/2023	EUR	9.057.564	USD	9.693.260	Négociation	NatWest Markets	137.333
04/04/2023	USD	47.052	EUR	43.783	Négociation	JP Morgan	(483)
04/04/2023	USD	300.000	EUR	282.624	Négociation	JP Morgan	(6.548)
04/04/2023	USD	51.790	EUR	48.266	Négociation	Lloyds	(606)
04/04/2023	GBP	100.000	EUR	113.868	Négociation	Barclays	(75)

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
04/04/2023	USD	48.802	EUR	45.323	Négociation	Lloyds	(413)
04/04/2023	EUR	59.896	USD	65.242	Négociation	JP Morgan	(143)
							82.484 EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	USD	1.088.802	EUR	1.012.177	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11.074)
19/04/2023	EUR	3.040	CHF	2.995	Couverture	JP Morgan Chase New York	19
19/04/2023	EUR	614	CHF	604	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	EUR	3.532	CHF	3.479	Couverture	JP Morgan Chase New York	23
19/04/2023	CHF	56.611	EUR	57.947	Couverture	JP Morgan Chase New York	(854)
19/04/2023	CHF	280.555	EUR	287.176	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4.231)
19/04/2023	CHF	68.503	EUR	70.120	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.033)
19/04/2023	EUR	744	CHF	733	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	CHF	813	EUR	832	Couverture	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	EUR	8	NOK	96	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	NOK	120	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	7	SEK	79	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	SEK	112	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	31	CHF	31	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	2.198	CHF	2.178	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	CHF	837	EUR	857	Couverture	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	EUR	9	CHF	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	324.296	EUR	331.950	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4.891)
19/04/2023	EUR	11.928	USD	12.783	Couverture	JP Morgan Chase New York	174
19/04/2023	SEK	7.700	EUR	678	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	SEK	7.776	EUR	685	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	SEK	88	EUR	8	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	12.473	EUR	11.423	Couverture	JP Morgan Chase New York	46
19/04/2023	EUR	11.537	USD	12.387	Couverture	JP Morgan Chase New York	148
19/04/2023	EUR	9	NOK	102	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9	CHF	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	7.799	EUR	690	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	NOK	88	EUR	8	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	86	EUR	8	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	7.985	EUR	707	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
05/04/2023	USD	26.534	EUR	24.739	Négociation	NatWest Markets	(323)
05/04/2023	USD	41.630	EUR	38.880	Négociation	NatWest Markets	(572)
05/04/2023	USD	21.851	EUR	20.647	Négociation	Goldman Sachs	(539)
05/04/2023	USD	24.692	EUR	23.279	Négociation	JP Morgan	(558)
05/04/2023	USD	18.709	EUR	17.374	Négociation	Lloyds	(158)
05/04/2023	USD	26.850	EUR	24.934	Négociation	JP Morgan	(226)
05/04/2023	EUR	402.553	GBP	353.677	Négociation	JP Morgan	109
05/04/2023	USD	67.490	EUR	63.522	Négociation	Lloyds	(1.418)
05/04/2023	EUR	34.286	USD	37.115	Négociation	JP Morgan	133
05/04/2023	EUR	34.145	USD	36.640	Négociation	Lloyds	429

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
05/04/2023	EUR	42.357	USD	46.017	Négociation	Citigroup Global Markets	13
05/04/2023	EUR	27.342	USD	29.202	Négociation	Barclays	471
05/04/2023	EUR	53.399	USD	57.634	Négociation	JP Morgan	364
05/04/2023	EUR	6.342.132	USD	6.732.321	Négociation	JP Morgan	147.120
05/04/2023	GBP	462.384	EUR	527.095	Négociation	NatWest Markets	(955)
05/04/2023	GBP	162.898	EUR	184.746	Négociation	JP Morgan	614
05/04/2023	GBP	213.781	EUR	243.350	Négociation	Lloyds	(92)
05/04/2023	GBP	140.079	EUR	159.157	Négociation	JP Morgan	237
05/04/2023	GBP	146.053	EUR	165.133	Négociation	NatWest Markets	1.058
05/04/2023	EUR	16.859	USD	17.962	Négociation	NatWest Markets	330
05/04/2023	EUR	2.275.864	GBP	2.000.000	Négociation	Barclays	96
05/04/2023	EUR	160.800	GBP	142.953	Négociation	JP Morgan	(1.864)
05/04/2023	EUR	49.791.028	GBP	44.270.288	Négociation	JP Morgan	(583.518)
05/04/2023	EUR	1.969.780	GBP	1.750.000	Négociation	NatWest Markets	(21.520)
05/04/2023	EUR	31.942	USD	33.969	Négociation	JP Morgan	684
							(481.773) EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	29	GBP	26	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	SEK	109	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	NOK	113	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	70.440	GBP	61.973	Couverture	JP Morgan Chase New York	(42)
19/04/2023	GBP	4.960.998	EUR	5.612.029	Couverture	JP Morgan Chase New York	30.139
19/04/2023	NOK	8.608	EUR	762	Couverture	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	EUR	163.134	GBP	143.255	Couverture	JP Morgan Chase New York	209
19/04/2023	SEK	8.475	EUR	746	Couverture	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	GBP	21.270.535	EUR	24.061.865	Couverture	JP Morgan Chase New York	129.221
19/04/2023	GBP	767	EUR	868	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	GBP	737	EUR	834	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	NOK	8.616	EUR	763	Couverture	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	EUR	10	SEK	109	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	1.291.096	GBP	1.140.110	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5.560)
19/04/2023	EUR	38.255	GBP	33.642	Couverture	JP Morgan Chase New York	(7)
19/04/2023	NOK	101	EUR	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SEK	103	EUR	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	102	EUR	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SEK	8.402	EUR	740	Couverture	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	GBP	8	EUR	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	235.224	EUR	267.187	Couverture	JP Morgan Chase New York	334
19/04/2023	SEK	100	EUR	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	NOK	115	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
05/04/2023	GBP	32.746	EUR	37.276	Négociation	Barclays	(15)
05/04/2023	USD	1.177	EUR	1.093	Négociation	JP Morgan	(10)
05/04/2023	USD	1.490	EUR	1.408	Négociation	Goldman Sachs	(37)
05/04/2023	EUR	988	USD	1.074	Négociation	Citigroup Global Markets	0

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
05/04/2023	EUR	1.789	USD	1.903	Négociation	JP Morgan	38
05/04/2023	USD	1.932	EUR	1.819	Négociation	JP Morgan	(41)
05/04/2023	GBP	25.040	EUR	28.450	Négociation	JP Morgan	42
05/04/2023	GBP	48.514	EUR	55.020	Négociation	JP Morgan	183
05/04/2023	GBP	61.270	EUR	69.844	Négociation	JP Morgan	(125)
05/04/2023	EUR	2.855	USD	3.062	Négociation	Barclays	37
05/04/2023	EUR	1.298	USD	1.401	Négociation	JP Morgan	9
05/04/2023	EUR	29.766	GBP	26.384	Négociation	Barclays	(257)
05/04/2023	EUR	42.946	GBP	37.732	Négociation	JP Morgan	12
05/04/2023	EUR	383.654	USD	407.292	Négociation	JP Morgan	8.868
05/04/2023	EUR	1.811	USD	1.934	Négociation	Barclays	31
05/04/2023	EUR	29.647	GBP	26.357	Négociation	JP Morgan	(344)
05/04/2023	USD	1.369	EUR	1.276	Négociation	JP Morgan	(16)
05/04/2023	EUR	31.248	GBP	27.500	Négociation	Barclays	(44)
05/04/2023	EUR	1.967	USD	2.132	Négociation	JP Morgan	6
05/04/2023	EUR	11.009.697	GBP	9.788.741	Négociation	JP Morgan	(128.776)
05/04/2023	GBP	311.990	EUR	354.398	Négociation	JP Morgan	611
							34.475 EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European Social Bond possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	SGD	869	EUR	600	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	CHF	30.491	EUR	31.211	Couverture	JP Morgan Chase New York	(460)
19/04/2023	GBP	7.403.441	EUR	8.374.994	Couverture	JP Morgan Chase New York	44.977
19/04/2023	CHF	20.126	EUR	20.603	Couverture	JP Morgan Chase New York	(305)
19/04/2023	CHF	352.210	EUR	361.503	Couverture	JP Morgan Chase New York	(6.291)
19/04/2023	CHF	454	EUR	466	Couverture	JP Morgan Chase New York	(8)
19/04/2023	GBP	23.967	EUR	27.141	Couverture	JP Morgan Chase New York	117
19/04/2023	GBP	423.728	EUR	482.702	Couverture	JP Morgan Chase New York	(794)
19/04/2023	GBP	8.191	EUR	9.265	Couverture	JP Morgan Chase New York	50
19/04/2023	CHF	4.567	EUR	4.590	Couverture	JP Morgan Chase New York	15
19/04/2023	GBP	7.333	EUR	8.374	Couverture	JP Morgan Chase New York	(35)
19/04/2023	GBP	5.836	EUR	6.657	Couverture	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	EUR	3.869	GBP	3.420	Couverture	JP Morgan Chase New York	(21)
19/04/2023	EUR	233.627	GBP	206.534	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.266)
19/04/2023	EUR	20.983	GBP	18.446	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	11.941	EUR	13.621	Couverture	JP Morgan Chase New York	(41)
19/04/2023	GBP	3.460	EUR	3.914	Couverture	JP Morgan Chase New York	21
19/04/2023	SEK	7.339	EUR	646	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	NOK	7.464	EUR	661	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	GBP	48.314.537	EUR	54.654.849	Couverture	JP Morgan Chase New York	293.515
19/04/2023	SGD	852	EUR	589	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	GBP	633	EUR	716	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	1.079	EUR	1.225	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	GBP	1.004	EUR	1.137	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	CHF	23.625.309	EUR	24.182.924	Couverture	JP Morgan Chase New York	(356.302)

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	GBP	15.125	EUR	17.182	Couverture	JP Morgan Chase New York	21
19/04/2023	GBP	778.736	EUR	887.142	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.482)
19/04/2023	CHF	73.838	EUR	74.335	Couverture	JP Morgan Chase New York	132
19/04/2023	USD	14.242	EUR	13.240	Couverture	JP Morgan Chase New York	(145)
19/04/2023	USD	876	EUR	814	Couverture	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	USD	711.340	EUR	661.279	Couverture	JP Morgan Chase New York	(7.235)
19/04/2023	USD	144	EUR	135	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	874	EUR	813	Couverture	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	SGD	871	EUR	602	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	CHF	773	EUR	791	Couverture	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	SEK	7.328	EUR	645	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	CHF	11	EUR	12	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	927	GBP	816	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	117	GBP	103	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	4.778	GBP	4.194	Couverture	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	EUR	14.874	GBP	13.103	Couverture	JP Morgan Chase New York	(27)
19/04/2023	SGD	841	EUR	581	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	14.904	GBP	13.083	Couverture	JP Morgan Chase New York	25
19/04/2023	EUR	324	GBP	286	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	GBP	29.425	EUR	33.265	Couverture	JP Morgan Chase New York	200
19/04/2023	GBP	1.134	EUR	1.290	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	7.460	EUR	660	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	USD	855	EUR	794	Couverture	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	SGD	14	EUR	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
17/04/2023	EUR	723.976	CAD	1.054.875	Négociation	HSBC	7.051
17/04/2023	EUR	8.706	CAD	12.729	Négociation	HSBC	55
17/04/2023	GBP	200.000	EUR	228.292	Négociation	HSBC	(815)
17/04/2023	EUR	11.542.489	USD	12.200.972	Négociation	HSBC	323.294
17/04/2023	EUR	478.168	SEK	5.347.693	Négociation	Citigroup Global Markets	3.482
17/04/2023	EUR	22.342.750	GBP	19.586.586	Négociation	HSBC	65.260
17/04/2023	USD	200.000	EUR	188.276	Négociation	HSBC	(4.364)
17/04/2023	CAD	5.832	EUR	3.993	Négociation	HSBC	(29)
							358.560 EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	14	USD	15	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	307	USD	329	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	USD	20.768	EUR	19.306	Couverture	JP Morgan Chase New York	(211)
19/04/2023	EUR	12	SEK	136	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	917	EUR	853	Couverture	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	SEK	7.772	EUR	684	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	NOK	7.886	EUR	698	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	NOK	7.978	EUR	706	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	EUR	12	NOK	140	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	12	NOK	140	Couverture	JP Morgan Chase New York	0

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
18/04/2023	USD	289.873	EUR	271.558	Négociation	Citigroup Global Markets	(5.018)
18/04/2023	EUR	492.473	USD	526.959	Négociation	HSBC	7.940
18/04/2023	EUR	17.655.716	USD	18.994.404	Négociation	Barclays	190.447
18/04/2023	EUR	143.763	USD	155.888	Négociation	JP Morgan	423
18/04/2023	EUR	48.906	USD	52.200	Négociation	HSBC	909
18/04/2023	EUR	49.117	JPY	6.987.374	Négociation	HSBC	702
18/04/2023	EUR	65.125	GBP	57.543	Négociation	Lloyds	(321)
18/04/2023	EUR	21.276.019	GBP	18.924.417	Négociation	HSBC	(247.747)
18/04/2023	JPY	24.803.747	EUR	172.596	Négociation	HSBC	(738)
18/04/2023	EUR	120.155	GBP	105.955	Négociation	NatWest Markets	(353)
18/04/2023	USD	326.448	EUR	303.776	Négociation	HSBC	(3.605)
18/04/2023	USD	215.610	EUR	201.696	Négociation	NatWest Markets	(3.441)
18/04/2023	USD	341.658	EUR	322.783	Négociation	NatWest Markets	(8.626)
18/04/2023	GBP	88.640	EUR	100.532	Négociation	JP Morgan	282
18/04/2023	GBP	2.408.755	EUR	2.744.204	Négociation	NatWest Markets	(4.616)
18/04/2023	JPY	37.821.542	EUR	271.670	Négociation	HSBC	(9.615)
18/04/2023	GBP	125.026	EUR	143.064	Négociation	JP Morgan	(866)
18/04/2023	EUR	165.848	GBP	147.698	Négociation	Lloyds	(2.137)
18/04/2023	EUR	112.969	AUD	175.664	Négociation	NatWest Markets	4.720
							(81.880) EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	USD	6.200	EUR	5.686	Couverture	JP Morgan Chase New York	16
19/04/2023	USD	9.695	EUR	8.939	Couverture	JP Morgan Chase New York	(27)
19/04/2023	USD	3.708	EUR	3.447	Couverture	JP Morgan Chase New York	(41)
19/04/2023	USD	1.077	EUR	999	Couverture	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	USD	10.824	EUR	10.028	Couverture	JP Morgan Chase New York	(82)
19/04/2023	USD	16.004	EUR	15.008	Couverture	JP Morgan Chase New York	(319)
19/04/2023	SEK	7.279	USD	690	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	SGD	100.463	USD	74.638	Couverture	JP Morgan Chase New York	969
19/04/2023	EUR	981	USD	1.063	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	518	USD	559	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	EUR	3.198	USD	3.402	Couverture	JP Morgan Chase New York	76
19/04/2023	EUR	21.865	USD	23.561	Couverture	JP Morgan Chase New York	219
19/04/2023	NOK	7.358	USD	701	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	4.727.870	USD	5.085.785	Couverture	JP Morgan Chase New York	56.256
19/04/2023	EUR	55.000	USD	59.623	Couverture	JP Morgan Chase New York	195
19/04/2023	USD	12.258	EUR	11.522	Couverture	JP Morgan Chase New York	(274)
19/04/2023	EUR	245	USD	263	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	5.477.394	USD	5.892.051	Couverture	JP Morgan Chase New York	65.174
19/04/2023	EUR	137.446	USD	147.851	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.635
19/04/2023	EUR	305.305	USD	328.418	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.633
19/04/2023	EUR	173	USD	182	Couverture	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	EUR	2.039.008	USD	2.193.367	Couverture	JP Morgan Chase New York	24.262
19/04/2023	EUR	11.304.599	USD	12.160.393	Couverture	JP Morgan Chase New York	134.511

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	2.007.745	USD	2.159.737	Couverture	JP Morgan Chase New York	23.890
19/04/2023	EUR	9.000	USD	9.714	Couverture	JP Morgan Chase New York	74
19/04/2023	EUR	7.328	USD	8.004	Couverture	JP Morgan Chase New York	(34)
19/04/2023	EUR	4	USD	4	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.000	USD	9.597	Couverture	JP Morgan Chase New York	191
19/04/2023	USD	12.820	EUR	11.918	Couverture	JP Morgan Chase New York	(142)
19/04/2023	USD	3.081	EUR	2.864	Couverture	JP Morgan Chase New York	(34)
19/04/2023	USD	1.626	EUR	1.500	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	EUR	4.988	USD	5.380	Couverture	JP Morgan Chase New York	45
19/04/2023	USD	4.618	EUR	4.235	Couverture	JP Morgan Chase New York	12
							310.224 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	435.118	USD	468.058	Couverture	JP Morgan Chase New York	5.177
19/04/2023	USD	7.935	EUR	7.364	Couverture	JP Morgan Chase New York	(74)
19/04/2023	USD	4.173	EUR	3.913	Couverture	JP Morgan Chase New York	(83)
19/04/2023	USD	679	EUR	623	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	USD	19.018	EUR	17.680	Couverture	JP Morgan Chase New York	(210)
19/04/2023	USD	4.209	EUR	3.954	Couverture	JP Morgan Chase New York	(92)
19/04/2023	USD	3.338	EUR	3.136	Couverture	JP Morgan Chase New York	(73)
19/04/2023	USD	453.528	MXN	8.654.610	Négociation	Citigroup Global Markets	(24.106)
19/04/2023	USD	8	NOK	83	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	8	SEK	79	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	42.803	SGD	57.627	Couverture	JP Morgan Chase New York	(566)
19/04/2023	USD	262.328	SGD	349.580	Couverture	JP Morgan Chase New York	(761)
19/04/2023	USD	52.781	SGD	69.871	Couverture	JP Morgan Chase New York	197
19/04/2023	USD	1.161.333	SGD	1.568.763	Couverture	JP Morgan Chase New York	(19.284)
19/04/2023	USD	50	SGD	67	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	328.478	USD	353.345	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.909
19/04/2023	SGD	4.936.860	USD	3.667.816	Couverture	JP Morgan Chase New York	47.595
19/04/2023	SGD	466	USD	350	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	3.792	USD	4.110	Couverture	JP Morgan Chase New York	14
19/04/2023	EUR	3.026	USD	3.281	Couverture	JP Morgan Chase New York	11
19/04/2023	EUR	5.068	USD	5.493	Couverture	JP Morgan Chase New York	18
19/04/2023	SGD	37.502	USD	28.263	Couverture	JP Morgan Chase New York	(40)
19/04/2023	SEK	81	USD	8	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	80	USD	8	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	29.840	USD	32.539	Couverture	JP Morgan Chase New York	(85)
19/04/2023	EUR	97	USD	106	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SEK	6.843	USD	648	Couverture	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	NOK	6.970	USD	664	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	333.928	USD	359.207	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.973
19/04/2023	EUR	281.337	USD	302.635	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.348

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	USD	961.665	EUR	888.081	Négociation	Lloyds	(4.209)
19/04/2023	USD	5.366	EUR	5.042	Couverture	JP Morgan Chase New York	(117)
							14.559 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	SGD	199	USD	147	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	NOK	7.406	USD	705	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	864.150	USD	929.569	Couverture	JP Morgan Chase New York	10.282
19/04/2023	EUR	2.834.630	USD	3.049.221	Couverture	JP Morgan Chase New York	33.729
19/04/2023	EUR	9.246.813	USD	9.946.827	Couverture	JP Morgan Chase New York	110.026
19/04/2023	EUR	11.053.763	USD	11.890.568	Couverture	JP Morgan Chase New York	131.528
19/04/2023	EUR	10.000	USD	10.806	Couverture	JP Morgan Chase New York	70
19/04/2023	USD	191.271	EUR	176.635	Négociation	Lloyds	(837)
19/04/2023	USD	63.818	EUR	59.223	Couverture	JP Morgan Chase New York	(593)
19/04/2023	USD	459	EUR	423	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	446	EUR	418	Couverture	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	USD	28	EUR	26	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	159.990	USD	118.864	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.542
19/04/2023	USD	3.523	SGD	4.692	Couverture	JP Morgan Chase New York	(8)
19/04/2023	USD	135	SGD	179	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	2.008	SGD	2.667	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	6.805	SGD	9.032	Couverture	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	USD	3.666	SGD	4.924	Couverture	JP Morgan Chase New York	(40)
19/04/2023	SGD	236	USD	177	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	12	USD	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	99	USD	75	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	229.780	USD	170.714	Couverture	JP Morgan Chase New York	2.215
19/04/2023	EUR	99.990	USD	105.522	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.227
19/04/2023	SEK	7.325	USD	694	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	152.609	USD	164.161	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.816
19/04/2023	USD	1.941	SGD	2.596	Couverture	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	EUR	207	USD	226	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
							292.959 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	USD	2.023	EUR	1.887	Couverture	JP Morgan Chase New York	(30)
19/04/2023	SGD	477.359	USD	354.652	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.602
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	SGD	1.846	USD	1.380	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	14.682	USD	10.974	Couverture	JP Morgan Chase New York	76
19/04/2023	SGD	14.380	USD	10.685	Couverture	JP Morgan Chase New York	137
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	38.088	USD	28.669	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	SGD	3.128.661	USD	2.324.424	Couverture	JP Morgan Chase New York	30.163
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	6.117	USD	4.593	Couverture	JP Morgan Chase New York	11
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	5.445	USD	4.058	Couverture	JP Morgan Chase New York	40
19/04/2023	SGD	14.426	USD	10.717	Couverture	JP Morgan Chase New York	140
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	13.044	USD	9.656	Couverture	JP Morgan Chase New York	160
19/04/2023	SGD	62.385	USD	46.991	Couverture	JP Morgan Chase New York	(41)
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	60	USD	65	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	146.275	USD	157.349	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.741
19/04/2023	EUR	98.361	USD	105.807	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.170
19/04/2023	EUR	298	USD	322	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	57.006.583	USD	61.322.164	Couverture	JP Morgan Chase New York	678.311
19/04/2023	EUR	533.595	USD	573.990	Couverture	JP Morgan Chase New York	6.349
19/04/2023	SGD	8.180	USD	6.089	Couverture	JP Morgan Chase New York	67
19/04/2023	EUR	702	USD	755	Couverture	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	SGD	620	USD	466	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	36.558	USD	27.596	Couverture	JP Morgan Chase New York	(83)
19/04/2023	USD	1.366	EUR	1.274	Couverture	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	USD	28.275	SGD	38.067	Couverture	JP Morgan Chase New York	(374)
19/04/2023	USD	330	SGD	439	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SEK	7.583	USD	718	Couverture	JP Morgan Chase New York	14
19/04/2023	SEK	7.726	USD	732	Couverture	JP Morgan Chase New York	14
19/04/2023	CHF	825	USD	908	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	SGD	247	USD	183	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	GBP	660	USD	803	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	411.184	USD	442.312	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.893
19/04/2023	NOK	7.714	USD	734	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	NOK	7.841	USD	747	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	3.345	USD	2.510	Couverture	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	SGD	37.730	USD	28.502	Couverture	JP Morgan Chase New York	(106)
19/04/2023	EUR	2.566	USD	2.770	Couverture	JP Morgan Chase New York	21
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	10.661	EUR	9.893	Couverture	JP Morgan Chase New York	(99)
19/04/2023	USD	5.401	EUR	5.077	Couverture	JP Morgan Chase New York	(121)
19/04/2023	USD	224	EUR	209	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	10	EUR	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	1	USD	1	Couverture	JP Morgan Chase New York	0

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	SGD	7.113	USD	5.360	Couverture	JP Morgan Chase New York	(7)
19/04/2023	EUR	30	USD	32	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	54.826	USD	58.976	Couverture	JP Morgan Chase New York	652
							727.720 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	USD	18	SGD	24	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	46.126	USD	34.269	Couverture	JP Morgan Chase New York	445
19/04/2023	SGD	488.147	USD	362.667	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.706
19/04/2023	EUR	902.054	USD	970.343	Couverture	JP Morgan Chase New York	10.733
19/04/2023	THB	22.300.000	USD	648.539	Négociation	Citigroup Global Markets	4.985
19/04/2023	EUR	6.229	USD	6.693	Couverture	JP Morgan Chase New York	81
19/04/2023	SGD	1.000	USD	744	Couverture	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	SEK	7.339	USD	695	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	SGD	5.128	USD	3.808	Couverture	JP Morgan Chase New York	52
19/04/2023	EUR	384	USD	416	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	238	USD	178	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	285	USD	213	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	30	USD	23	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.069	USD	9.670	Couverture	JP Morgan Chase New York	193
19/04/2023	SGD	46	USD	35	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	321	USD	348	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	889	USD	670	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	SGD	297	USD	222	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	SGD	226	USD	170	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	3.988	USD	4.243	Couverture	JP Morgan Chase New York	95
19/04/2023	EUR	608.395	USD	654.452	Couverture	JP Morgan Chase New York	7.239
19/04/2023	AUD	838	USD	561	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	14.727.649	USD	15.842.580	Couverture	JP Morgan Chase New York	175.240
19/04/2023	USD	87.133	EUR	82.565	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2.662)
19/04/2023	USD	5.342	EUR	4.952	Couverture	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	USD	5	SGD	7	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	10.976	EUR	10.066	Couverture	JP Morgan Chase New York	29
19/04/2023	USD	54.190	EUR	50.205	Couverture	JP Morgan Chase New York	(412)
19/04/2023	USD	27	SGD	35	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	609	SGD	808	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	123	EUR	112	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	10	SGD	13	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	864.840	PHP	47.134.664	Négociation	Citigroup Global Markets	(3.047)
19/04/2023	USD	391	SGD	519	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	1.185	USD	881	Couverture	JP Morgan Chase New York	11
19/04/2023	SGD	486	USD	361	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	SGD	13	USD	10	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	634	USD	772	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	SGD	1.187	USD	879	Couverture	JP Morgan Chase New York	15

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	AUD	9	USD	6	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	AUD	1.020	USD	683	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	1.451	EUR	1.346	Couverture	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	USD	27.292	EUR	25.371	Couverture	JP Morgan Chase New York	(302)
19/04/2023	USD	6	AUD	9	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	274	USD	204	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
							197.394 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
02/06/2023	GBP	1.600.000	EUR	1.821.342	Négociation	Barclays	(4.745)
02/06/2023	USD	1.900.000	EUR	1.794.571	Négociation	Barclays	(52.190)
02/06/2023	USD	1.990.000	EUR	1.866.655	Négociation	Barclays	(41.740)
02/06/2023	JPY	89.300.003	EUR	628.585	Négociation	Barclays	(7.426)
02/06/2023	JPY	69.500.000	EUR	499.983	Négociation	Barclays	(16.550)
02/06/2023	JPY	15.750.000	EUR	111.746	Négociation	Citigroup Global Markets	(2.191)
02/06/2023	GBP	32.049	EUR	36.093	Négociation	Barclays	295
02/06/2023	USD	199.086	EUR	182.350	Négociation	Barclays	220
02/06/2023	USD	15.000	EUR	13.861	Négociation	Citigroup Global Markets	(105)
02/06/2023	EUR	2.583.159	GBP	2.300.000	Négociation	Citigroup Global Markets	(28.266)
02/06/2023	EUR	690.322	JPY	99.200.000	Négociation	Citigroup Global Markets	298
02/06/2023	EUR	2.567.231	USD	2.750.000	Négociation	Barclays	45.532
02/06/2023	EUR	534.025	JPY	76.000.000	Négociation	Barclays	5.348
02/06/2023	EUR	742.389	USD	805.000	Négociation	Citigroup Global Markets	4.186
02/06/2023	EUR	508.349	USD	550.000	Négociation	Barclays	3.990
02/06/2023	GBP	640.000	EUR	726.720	Négociation	Citigroup Global Markets	(81)
24/04/2023	EUR	63.000	USD	68.651	Négociation	Barclays	(103)
							(93.528) EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
02/06/2023	EUR	240.000	USD	257.092	Négociation	Lloyds	4.619
02/06/2023	GBP	1.620.000	USD	1.948.850	Négociation	Lloyds	56.839
02/06/2023	JPY	82.755.000	USD	616.908	Négociation	Lloyds	10.798
19/04/2023	USD	10.748	EUR	9.857	Couverture	JP Morgan Chase New York	28
19/04/2023	USD	25	EUR	24	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	6.415	EUR	5.937	Couverture	JP Morgan Chase New York	(42)
19/04/2023	USD	2.895	EUR	2.669	Couverture	JP Morgan Chase New York	(8)
19/04/2023	USD	10.312	EUR	9.570	Couverture	JP Morgan Chase New York	(96)
19/04/2023	USD	16	GBP	13	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SEK	7.069	USD	670	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	GBP	626	USD	762	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	80	USD	87	Couverture	JP Morgan Chase New York	0

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	6.855.916	USD	7.374.930	Couverture	JP Morgan Chase New York	81.576
19/04/2023	EUR	107.150	USD	115.262	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.275
19/04/2023	EUR	148	USD	161	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	1.650.806	USD	1.775.777	Couverture	JP Morgan Chase New York	19.643
19/04/2023	GBP	13	USD	16	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	716.351	USD	770.581	Couverture	JP Morgan Chase New York	8.524
							183.181 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
02/06/2023	EUR	9.300.000	USD	9.957.685	Négociation	JP Morgan	183.612
09/05/2023	USD	4.937	JPY	654.242	Négociation	Lloyds	(9)
04/05/2023	USD	4.544.957	EUR	4.168.982	Négociation	JP Morgan	6.815
04/05/2023	USD	1.393.312	GBP	1.124.130	Négociation	Lloyds	2.397
04/05/2023	USD	53.942	CAD	73.029	Négociation	NatWest Markets	(47)
19/04/2023	CHF	831	USD	915	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	SGD	131.402	USD	97.625	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.267
19/04/2023	USD	48.068	EUR	45.161	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.049)
19/04/2023	USD	157.536	EUR	145.320	Couverture	JP Morgan Chase New York	(514)
19/04/2023	USD	2.158	SGD	2.865	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	USD	32.165	EUR	29.657	Couverture	JP Morgan Chase New York	(90)
19/04/2023	USD	16.955	EUR	15.633	Couverture	JP Morgan Chase New York	(47)
19/04/2023	USD	4.350	EUR	4.030	Couverture	JP Morgan Chase New York	(33)
19/04/2023	USD	24.956	EUR	23.121	Couverture	JP Morgan Chase New York	(190)
19/04/2023	USD	23.050	EUR	21.452	Couverture	JP Morgan Chase New York	(280)
19/04/2023	USD	15.570	EUR	14.628	Couverture	JP Morgan Chase New York	(340)
19/04/2023	USD	214.677	EUR	201.696	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4.683)
19/04/2023	USD	15	EUR	14	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	19.558	EUR	18.202	Couverture	JP Morgan Chase New York	(238)
19/04/2023	USD	28.851	EUR	26.415	Couverture	JP Morgan Chase New York	122
19/04/2023	USD	25.302	EUR	23.415	Couverture	JP Morgan Chase New York	(164)
19/04/2023	USD	16.269	EUR	15.056	Couverture	JP Morgan Chase New York	(106)
19/04/2023	USD	20.324	EUR	19.060	Couverture	JP Morgan Chase New York	(405)
19/04/2023	USD	7.271	EUR	6.819	Couverture	JP Morgan Chase New York	(145)
19/04/2023	USD	9.395	EUR	8.749	Couverture	JP Morgan Chase New York	(121)
19/04/2023	USD	57.841	EUR	53.865	Couverture	JP Morgan Chase New York	(742)
19/04/2023	USD	9.542	EUR	8.870	Couverture	JP Morgan Chase New York	(106)
19/04/2023	USD	616.352	EUR	579.083	Couverture	JP Morgan Chase New York	(13.447)
19/04/2023	USD	318.739	EUR	299.466	Couverture	JP Morgan Chase New York	(6.954)
19/04/2023	SGD	93	USD	69	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	12	EUR	11	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	98.814	USD	104.282	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.189
19/04/2023	SGD	1.206	USD	909	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	22.779	USD	24.879	Couverture	JP Morgan Chase New York	(105)
19/04/2023	EUR	747.963	USD	804.586	Couverture	JP Morgan Chase New York	8.900
19/04/2023	EUR	710	USD	764	Couverture	JP Morgan Chase New York	8

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	2.285	USD	2.411	Couverture	JP Morgan Chase New York	74
19/04/2023	USD	5.638	EUR	5.232	Couverture	JP Morgan Chase New York	(52)
19/04/2023	USD	18	CHF	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.985	USD	10.824	Couverture	JP Morgan Chase New York	35
19/04/2023	EUR	48.336	USD	52.759	Couverture	JP Morgan Chase New York	(189)
19/04/2023	EUR	5.584	USD	5.892	Couverture	JP Morgan Chase New York	180
19/04/2023	CHF	18	USD	19	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	225.158	USD	245.762	Couverture	JP Morgan Chase New York	(880)
19/04/2023	SGD	6.612	USD	4.913	Couverture	JP Morgan Chase New York	64
19/04/2023	EUR	10.045.773	USD	10.806.270	Couverture	JP Morgan Chase New York	119.533
19/04/2023	EUR	6.986	USD	7.432	Couverture	JP Morgan Chase New York	166
19/04/2023	EUR	6.108	USD	6.498	Couverture	JP Morgan Chase New York	145
19/04/2023	EUR	14.596.781	USD	15.701.804	Couverture	JP Morgan Chase New York	173.684
19/04/2023	EUR	14.778	USD	15.925	Couverture	JP Morgan Chase New York	148
19/04/2023	EUR	28.832.207	USD	31.014.898	Couverture	JP Morgan Chase New York	343.068
19/04/2023	USD	7.800	EUR	7.153	Couverture	JP Morgan Chase New York	20
19/04/2023	USD	4.952	EUR	4.541	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	16.470	USD	17.977	Couverture	JP Morgan Chase New York	(64)
19/04/2023	EUR	2.181.949	USD	2.347.129	Couverture	JP Morgan Chase New York	25.963
18/04/2023	USD	41.268	EUR	38.436	Négociation	JP Morgan	(532)
18/04/2023	EUR	1.635	USD	1.739	Négociation	Barclays	39
18/04/2023	AUD	46.489	USD	32.162	Négociation	JP Morgan	(1.006)
18/04/2023	CNY	16.829	USD	2.451	Négociation	Barclays	3
18/04/2023	CNY	23.895	USD	3.497	Négociation	UBS	(13)
18/04/2023	EUR	601.223	USD	646.778	Négociation	Barclays	7.077
18/04/2023	USD	12.931	CNY	89.491	Négociation	HSBC	(118)
18/04/2023	USD	134.005	EUR	125.233	Négociation	UBS	(2.189)
18/04/2023	USD	5.447	EUR	4.992	Négociation	NatWest Markets	18
18/04/2023	JPY	730.032	USD	5.514	Négociation	HSBC	(13)
18/04/2023	USD	6.603	GBP	5.414	Négociation	HSBC	(94)
18/04/2023	SGD	16.213	USD	12.235	Négociation	Lloyds	(34)
18/04/2023	JPY	405.512	USD	3.005	Négociation	Goldman Sachs	51
18/04/2023	EUR	5.752	USD	6.140	Négociation	JP Morgan	116
18/04/2023	USD	4.199	JPY	568.484	Négociation	JP Morgan	(84)
18/04/2023	THB	602.030	USD	17.889	Négociation	HSBC	(248)
18/04/2023	EUR	4.004	USD	4.303	Négociation	NatWest Markets	51
18/04/2023	NOK	48.675	USD	4.803	Négociation	HSBC	(151)
18/04/2023	MXN	1.170.185	USD	62.219	Négociation	HSBC	2.361
18/04/2023	JPY	74.378.134	USD	562.598	Négociation	Barclays	(2.139)
18/04/2023	CHF	27.089	USD	29.567	Négociation	NatWest Markets	143
18/04/2023	CAD	18.984	USD	14.176	Négociation	HSBC	(145)
18/04/2023	NZD	14.125	USD	8.881	Négociation	Citigroup Global Markets	(43)
18/04/2023	JPY	639.405	USD	4.857	Négociation	HSBC	(39)
18/04/2023	GBP	131.327	USD	160.099	Négociation	Barclays	2.341
18/04/2023	JPY	5.450.263	USD	40.781	Négociation	HSBC	288
18/04/2023	EUR	59.365	USD	62.632	Négociation	UBS	1.930
18/04/2023	EUR	3.622	USD	3.899	Négociation	UBS	40
18/04/2023	KRW	79.474.929	USD	62.816	Négociation	Citigroup Global Markets	(1.797)
18/04/2023	AUD	3.229	USD	2.136	Négociation	HSBC	28

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
18/04/2023	CNY	592.791	USD	87.374	Négociation	HSBC	(931)
18/04/2023	USD	3.510	EUR	3.316	Négociation	UBS	(96)
18/04/2023	USD	126.232	GBP	105.340	Négociation	HSBC	(4.063)
18/04/2023	USD	4.382	GBP	3.630	Négociation	HSBC	(108)
18/04/2023	GBP	4.654	USD	5.761	Négociation	JP Morgan	(4)
18/04/2023	IDR	355.453.455	USD	23.448	Négociation	HSBC	325
18/04/2023	USD	6.419	GBP	5.239	Négociation	UBS	(61)
18/04/2023	USD	146.620	GBP	121.789	Négociation	HSBC	(4.021)
18/04/2023	GBP	3.599	USD	4.329	Négociation	HSBC	122
18/04/2023	JPY	294.719	USD	2.233	Négociation	HSBC	(12)
18/04/2023	USD	10.732	GBP	8.820	Négociation	UBS	(177)
18/04/2023	USD	72.270	GBP	59.756	Négociation	HSBC	(1.642)
18/04/2023	USD	149.277	GBP	124.933	Négociation	NatWest Markets	(5.252)
18/04/2023	SEK	231.471	USD	22.394	Négociation	UBS	(49)
05/04/2023	GBP	16.386	USD	20.090	Négociation	Lloyds	173
05/04/2023	EUR	300.000	USD	319.540	Négociation	HSBC	6.478
05/04/2023	GBP	8.762	USD	10.583	Négociation	NatWest Markets	252
05/04/2023	GBP	25.919	USD	31.755	Négociation	Lloyds	295
05/04/2023	EUR	68.190	USD	73.499	Négociation	JP Morgan	605
05/04/2023	GBP	13.715	USD	16.687	Négociation	Citigroup Global Markets	273
05/04/2023	EUR	75.811	USD	80.568	Négociation	JP Morgan	1.817
05/04/2023	EUR	140.526	USD	151.017	Négociation	JP Morgan	1.696
05/04/2023	EUR	98.983	USD	106.149	Négociation	Citigroup Global Markets	1.418
05/04/2023	USD	20.618.318	EUR	19.421.671	Négociation	Lloyds	(487.594)
05/04/2023	USD	144.754	GBP	118.540	Négociation	Citigroup Global Markets	(1.829)
05/04/2023	USD	102.602	GBP	86.630	Négociation	Lloyds	(4.522)
05/04/2023	USD	9.802	GBP	8.160	Négociation	JP Morgan	(289)
05/04/2023	USD	119.560	GBP	100.000	Négociation	Lloyds	(4.097)
05/04/2023	USD	3.585.463	GBP	3.003.384	Négociation	Lloyds	(128.415)
05/04/2023	USD	208.081	EUR	194.090	Négociation	HSBC	(2.841)
05/04/2023	USD	53.755	EUR	49.890	Négociation	Goldman Sachs	(461)
05/04/2023	USD	26.978	GBP	21.957	Négociation	NatWest Markets	(173)
05/04/2023	USD	124.923	EUR	116.990	Négociation	Goldman Sachs	(2.213)
05/04/2023	USD	204.999	EUR	189.886	Négociation	UBS	(1.354)
05/04/2023	USD	79.630	EUR	75.000	Négociation	JP Morgan	(1.874)
05/04/2023	GBP	11.554	USD	13.981	Négociation	NatWest Markets	307
05/04/2023	EUR	104.454	USD	111.787	Négociation	NatWest Markets	1.725
04/04/2023	CAD	946	USD	694	Négociation	JP Morgan	5
04/04/2023	USD	155	JPY	20.767	Négociation	JP Morgan	(1)
04/04/2023	CAD	4.743	USD	3.471	Négociation	JP Morgan	34
04/04/2023	USD	62	JPY	8.236	Négociation	JP Morgan	1
04/04/2023	USD	37	JPY	4.938	Négociation	JP Morgan	0
04/04/2023	CAD	1.750	USD	1.291	Négociation	JP Morgan	3
04/04/2023	USD	4.657	JPY	627.673	Négociation	JP Morgan	(62)
04/04/2023	CAD	1.969	USD	1.437	Négociation	Citigroup Global Markets	18
04/04/2023	EUR	125.000	USD	135.484	Négociation	Lloyds	348
04/04/2023	JPY	4.152	USD	32	Négociation	Barclays	(1)
04/04/2023	CAD	1.853	USD	1.361	Négociation	JP Morgan	8
04/04/2023	GBP	8.220	USD	10.071	Négociation	Lloyds	94

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
04/04/2023	CAD	3.130	USD	2.286	Négociation	JP Morgan	27
04/04/2023	JPY	4.609	USD	34	Négociation	JP Morgan	1
04/04/2023	CAD	1.621	USD	1.186	Négociation	JP Morgan	12
04/04/2023	JPY	3.702	USD	27	Négociation	JP Morgan	1
04/04/2023	USD	97	JPY	12.949	Négociation	JP Morgan	(1)
04/04/2023	USD	3.027	CAD	4.115	Négociation	Goldman Sachs	(14)
04/04/2023	USD	1.335.881	GBP	1.106.140	Négociation	Lloyds	(31.902)
04/04/2023	USD	3.064	CAD	4.197	Négociation	JP Morgan	(38)
04/04/2023	USD	1.247	CAD	1.719	Négociation	JP Morgan	(24)
04/04/2023	USD	4.895	CAD	6.722	Négociation	JP Morgan	(73)
04/04/2023	USD	872	CAD	1.199	Négociation	JP Morgan	(14)
04/04/2023	USD	1.731	CAD	2.395	Négociation	JP Morgan	(38)
04/04/2023	USD	3.656	CAD	5.000	Négociation	JP Morgan	(39)
04/04/2023	USD	431	CAD	591	Négociation	NatWest Markets	(6)
04/04/2023	USD	45.929	CAD	62.372	Négociation	JP Morgan	(161)
04/04/2023	JPY	16.768	USD	126	Négociation	JP Morgan	0
04/04/2023	USD	1.068	CAD	1.468	Négociation	JP Morgan	(17)
04/04/2023	CAD	1.458	USD	1.072	Négociation	JP Morgan	6
04/04/2023	USD	4.596.553	EUR	4.293.982	Négociation	Lloyds	(69.519)
04/04/2023	CAD	3.553	USD	2.594	Négociation	JP Morgan	32
04/04/2023	JPY	8.403	USD	64	Négociation	Goldman Sachs	(1)
04/04/2023	CAD	1.067	USD	776	Négociation	JP Morgan	13
04/04/2023	USD	3.885	CAD	5.339	Négociation	JP Morgan	(60)
04/04/2023	USD	121.958	GBP	99.310	Négociation	HSBC	(843)
04/04/2023	USD	48	JPY	6.373	Négociation	JP Morgan	0
04/04/2023	GBP	98.100	USD	120.916	Négociation	Lloyds	389
							105.827 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	67.753	USD	72.882	Couverture	JP Morgan Chase New York	805
19/04/2023	EUR	715	USD	769	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	22	USD	24	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	23	USD	25	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	23	USD	25	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	2.051	USD	2.223	Couverture	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	22	USD	23	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	728	USD	783	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	747	USD	804	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	751	USD	808	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	USD	16	EUR	15	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	16	EUR	15	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	16	EUR	15	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	1.458	EUR	1.370	Couverture	JP Morgan Chase New York	(32)
19/04/2023	USD	15	EUR	14	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
							816 USD

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Focus possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	5.000	USD	5.388	Couverture	JP Morgan Chase New York	50
19/04/2023	EUR	1.845.532	USD	2.003.497	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.707
19/04/2023	EUR	2.398	USD	2.558	Couverture	JP Morgan Chase New York	51
19/04/2023	SGD	52.942	USD	39.850	Couverture	JP Morgan Chase New York	(7)
19/04/2023	SGD	21.428	USD	16.146	Couverture	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	SGD	762.653	USD	566.609	Couverture	JP Morgan Chase New York	7.353
19/04/2023	EUR	54.542.699	USD	58.671.756	Couverture	JP Morgan Chase New York	648.992
19/04/2023	EUR	657.865	USD	714.174	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.321
19/04/2023	EUR	26.548.752	USD	28.558.577	Couverture	JP Morgan Chase New York	315.898
19/04/2023	USD	3.540	EUR	3.295	Couverture	JP Morgan Chase New York	(43)
19/04/2023	USD	80.918	EUR	75.306	Couverture	JP Morgan Chase New York	(984)
19/04/2023	USD	32.023	EUR	30.031	Couverture	JP Morgan Chase New York	(638)
19/04/2023	USD	18.239	EUR	17.104	Couverture	JP Morgan Chase New York	(363)
19/04/2023	USD	16.388	EUR	15.166	Couverture	JP Morgan Chase New York	(107)
19/04/2023	USD	30.224	EUR	27.971	Couverture	JP Morgan Chase New York	(196)
19/04/2023	USD	3.741	SGD	5.004	Couverture	JP Morgan Chase New York	(25)
19/04/2023	USD	48.949	EUR	45.132	Couverture	JP Morgan Chase New York	(137)
19/04/2023	EUR	62.990	USD	68.382	Couverture	JP Morgan Chase New York	127
19/04/2023	SGD	11.077	USD	8.318	Couverture	JP Morgan Chase New York	19
19/04/2023	EUR	33.927	USD	36.092	Couverture	JP Morgan Chase New York	807
19/04/2023	EUR	1.252.045	USD	1.366.618	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4.891)
19/04/2023	SGD	1.000	USD	755	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	1.521.898	USD	1.641.361	Couverture	JP Morgan Chase New York	13.858
19/04/2023	EUR	4.118	USD	4.422	Couverture	JP Morgan Chase New York	57
19/04/2023	EUR	120.342	USD	129.224	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.660
19/04/2023	CHF	18	USD	20	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	53.921	USD	58.798	Couverture	JP Morgan Chase New York	(154)
19/04/2023	EUR	2.298.816	USD	2.472.844	Couverture	JP Morgan Chase New York	27.353
19/04/2023	EUR	22.810	USD	24.072	Couverture	JP Morgan Chase New York	736
19/04/2023	EUR	2.660	USD	2.808	Couverture	JP Morgan Chase New York	86
19/04/2023	EUR	113.634	USD	122.021	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.567
19/04/2023	EUR	606	USD	661	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	EUR	246	USD	265	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	CHF	742	USD	818	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	131.910	EUR	121.625	Couverture	JP Morgan Chase New York	(369)
19/04/2023	USD	309.935	EUR	288.128	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3.429)
19/04/2023	USD	55.412	EUR	51.513	Couverture	JP Morgan Chase New York	(613)
19/04/2023	USD	57.597	EUR	53.130	Couverture	JP Morgan Chase New York	(188)
19/04/2023	EUR	72.915.994	USD	78.435.968	Couverture	JP Morgan Chase New York	867.612
19/04/2023	EUR	11.533	USD	12.392	Couverture	JP Morgan Chase New York	151
19/04/2023	EUR	17.258	USD	18.403	Couverture	JP Morgan Chase New York	367
19/04/2023	EUR	566	USD	611	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	SGD	20.000	USD	15.070	Couverture	JP Morgan Chase New York	(18)
19/04/2023	USD	241	EUR	222	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	24.141	USD	26.086	Couverture	JP Morgan Chase New York	170
19/04/2023	EUR	990	USD	1.065	Couverture	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	SGD	1.583	USD	1.189	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	5.702	USD	6.184	Couverture	JP Morgan Chase New York	17
19/04/2023	SGD	1.000	USD	743	Couverture	JP Morgan Chase New York	10

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	3.392	USD	3.648	Couverture	JP Morgan Chase New York	40
19/04/2023	SGD	1.303	USD	964	Couverture	JP Morgan Chase New York	16
19/04/2023	SGD	480	USD	357	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	USD	40.721	EUR	37.563	Couverture	JP Morgan Chase New York	(133)
19/04/2023	USD	41.105	EUR	38.108	Couverture	JP Morgan Chase New York	(341)
19/04/2023	USD	69.527	EUR	63.759	Couverture	JP Morgan Chase New York	182
19/04/2023	USD	6.478	EUR	6.138	Couverture	JP Morgan Chase New York	(198)
19/04/2023	USD	149.838	EUR	140.848	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3.345)
19/04/2023	USD	201.087	EUR	186.610	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.868)
19/04/2023	USD	17.579	EUR	16.095	Couverture	JP Morgan Chase New York	74
19/04/2023	USD	1.280	EUR	1.172	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	USD	17.129	EUR	16.101	Couverture	JP Morgan Chase New York	(382)
19/04/2023	USD	26.256	EUR	24.039	Couverture	JP Morgan Chase New York	111
19/04/2023	USD	50.273	EUR	46.575	Couverture	JP Morgan Chase New York	(382)
19/04/2023	USD	1.527	EUR	1.414	Couverture	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	USD	53.854	EUR	49.893	Couverture	JP Morgan Chase New York	(410)
19/04/2023	USD	3.642	EUR	3.376	Couverture	JP Morgan Chase New York	(30)
19/04/2023	USD	49.156	EUR	45.572	Couverture	JP Morgan Chase New York	(408)
19/04/2023	USD	170.109	EUR	161.191	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5.197)
19/04/2023	USD	7.719	EUR	7.189	Couverture	JP Morgan Chase New York	(99)
19/04/2023	USD	1.171	EUR	1.074	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	35.500	USD	38.254	Couverture	JP Morgan Chase New York	356
19/04/2023	EUR	66.431	USD	70.671	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.579
							1.869.364 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	491	USD	518	Couverture	JP Morgan Chase New York	16
19/04/2023	EUR	99	USD	106	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	386.493	USD	415.751	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.599
19/04/2023	EUR	794.022	USD	854.132	Couverture	JP Morgan Chase New York	9.448
19/04/2023	EUR	592.902	USD	637.787	Couverture	JP Morgan Chase New York	7.055
19/04/2023	EUR	22.194	USD	24.058	Couverture	JP Morgan Chase New York	80
19/04/2023	EUR	11.002	USD	12.009	Couverture	JP Morgan Chase New York	(43)
19/04/2023	EUR	17.134	USD	18.702	Couverture	JP Morgan Chase New York	(67)
19/04/2023	USD	16.623	EUR	15.618	Couverture	JP Morgan Chase New York	(363)
							20.726 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Equity Income possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	65	USD	70	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	8.629	SGD	11.621	Couverture	JP Morgan Chase New York	(117)

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	USD	16.730	SGD	22.531	Couverture	JP Morgan Chase New York	(227)
19/04/2023	USD	89.808	SGD	120.950	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.217)
19/04/2023	USD	910	AUD	1.365	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	USD	21	EUR	20	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	90	EUR	84	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	2.604	SGD	3.484	Couverture	JP Morgan Chase New York	(18)
19/04/2023	SGD	496	USD	367	Couverture	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	AUD	56.209	USD	37.616	Couverture	JP Morgan Chase New York	55
19/04/2023	AUD	1.191	USD	799	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	AUD	1.555	USD	1.042	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	198	USD	147	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	SGD	1.884	USD	1.395	Couverture	JP Morgan Chase New York	23
19/04/2023	EUR	3.147	USD	3.385	Couverture	JP Morgan Chase New York	37
19/04/2023	SGD	53	USD	40	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	12.423	USD	9.361	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	SGD	21.235	USD	16.001	Couverture	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	SGD	97.422	USD	73.408	Couverture	JP Morgan Chase New York	(90)
19/04/2023	SGD	99	USD	74	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	149	USD	111	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	119	USD	89	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	SGD	433.942	USD	322.395	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.184
19/04/2023	SGD	839.488	USD	623.694	Couverture	JP Morgan Chase New York	8.093
19/04/2023	SGD	4.506.512	USD	3.348.091	Couverture	JP Morgan Chase New York	43.447
19/04/2023	SGD	785	USD	591	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	SGD	134	USD	101	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	99	USD	74	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	15	USD	16	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	8.465	USD	6.356	Couverture	JP Morgan Chase New York	15
19/04/2023	EUR	727	USD	782	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
							54.167 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	GBP	1.340	EUR	1.516	Couverture	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	GBP	635	EUR	718	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	EUR	7.439	GBP	6.580	Couverture	JP Morgan Chase New York	(45)
19/04/2023	EUR	7.363	GBP	6.502	Couverture	JP Morgan Chase New York	(32)
19/04/2023	EUR	18.964	GBP	16.677	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	GBP	215	EUR	245	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	GBP	2.883.833	EUR	3.262.278	Couverture	JP Morgan Chase New York	17.520
19/04/2023	CHF	4.778.686	EUR	4.891.475	Couverture	JP Morgan Chase New York	(72.068)
19/04/2023	GBP	1.179	EUR	1.337	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	60.729	EUR	68.982	Couverture	JP Morgan Chase New York	86
19/04/2023	GBP	635	EUR	722	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	14.675	EUR	16.760	Couverture	JP Morgan Chase New York	(70)
19/04/2023	GBP	799	EUR	907	Couverture	JP Morgan Chase New York	1

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	GBP	5.000	EUR	5.676	Couverture	JP Morgan Chase New York	10
19/04/2023	CHF	787	EUR	805	Couverture	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	GBP	14	EUR	16	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	44.412	CHF	43.430	Couverture	JP Morgan Chase New York	612
							(53.987) EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - American possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	98	USD	106	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	23.305	USD	24.594	Couverture	JP Morgan Chase New York	752
19/04/2023	EUR	623	USD	680	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	3.006.809	USD	3.281.959	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11.747)
19/04/2023	EUR	1.810.668	USD	1.947.741	Couverture	JP Morgan Chase New York	21.545
19/04/2023	EUR	47.802.509	USD	51.511.090	Couverture	JP Morgan Chase New York	479.014
19/04/2023	EUR	772	USD	821	Couverture	JP Morgan Chase New York	18
19/04/2023	EUR	15	USD	16	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.489	USD	10.137	Couverture	JP Morgan Chase New York	183
19/04/2023	EUR	19.759	USD	21.109	Couverture	JP Morgan Chase New York	381
19/04/2023	EUR	1.514	USD	1.633	Couverture	JP Morgan Chase New York	14
19/04/2023	EUR	3.333	USD	3.595	Couverture	JP Morgan Chase New York	30
19/04/2023	EUR	24.190.994	USD	26.022.329	Couverture	JP Morgan Chase New York	287.843
19/04/2023	EUR	47.335	USD	51.093	Couverture	JP Morgan Chase New York	389
19/04/2023	EUR	56	USD	61	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	56.284	USD	61.375	Couverture	JP Morgan Chase New York	(161)
19/04/2023	EUR	67.439	USD	72.743	Couverture	JP Morgan Chase New York	604
19/04/2023	EUR	20.655.667	USD	22.219.367	Couverture	JP Morgan Chase New York	245.778
19/04/2023	EUR	73.725	USD	79.219	Couverture	JP Morgan Chase New York	964
19/04/2023	EUR	15.637	USD	16.803	Couverture	JP Morgan Chase New York	205
19/04/2023	EUR	715	USD	769	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	451.834	USD	486.040	Couverture	JP Morgan Chase New York	5.376
19/04/2023	EUR	949.092	USD	1.020.941	Couverture	JP Morgan Chase New York	11.293
19/04/2023	EUR	3.285.087	USD	3.533.725	Couverture	JP Morgan Chase New York	39.142
19/04/2023	EUR	2.693.718	USD	2.910.752	Couverture	JP Morgan Chase New York	18.942
19/04/2023	EUR	2	USD	2	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	3.098	EUR	2.875	Couverture	JP Morgan Chase New York	(29)
19/04/2023	USD	34.829	EUR	32.322	Couverture	JP Morgan Chase New York	(324)
19/04/2023	USD	9.263	EUR	8.573	Couverture	JP Morgan Chase New York	(60)
19/04/2023	EUR	8.040.978	USD	8.574.373	Couverture	JP Morgan Chase New York	171.011
19/04/2023	EUR	601.030	USD	642.079	Couverture	JP Morgan Chase New York	11.602
19/04/2023	EUR	704.176	USD	752.270	Couverture	JP Morgan Chase New York	13.593
19/04/2023	EUR	37.433	USD	39.989	Couverture	JP Morgan Chase New York	723
19/04/2023	EUR	672.360	USD	718.281	Couverture	JP Morgan Chase New York	12.979
19/04/2023	EUR	208	USD	225	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	207.329	USD	224.758	Couverture	JP Morgan Chase New York	734
19/04/2023	EUR	33.536.915	USD	36.075.767	Couverture	JP Morgan Chase New York	399.048
19/04/2023	EUR	8.380.843	USD	9.015.164	Couverture	JP Morgan Chase New York	99.859

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	100	USD	106	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	36.661.707	USD	39.761.872	Couverture	JP Morgan Chase New York	111.474
19/04/2023	USD	111.181	EUR	105.352	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3.396)
19/04/2023	USD	10.805	EUR	10.238	Couverture	JP Morgan Chase New York	(330)
19/04/2023	USD	14.669	EUR	13.900	Couverture	JP Morgan Chase New York	(448)
19/04/2023	USD	41.575	EUR	38.065	Couverture	JP Morgan Chase New York	175
19/04/2023	USD	6.679	EUR	6.188	Couverture	JP Morgan Chase New York	(51)
19/04/2023	USD	2.195	EUR	2.043	Couverture	JP Morgan Chase New York	(27)
19/04/2023	USD	23.406	EUR	22.002	Couverture	JP Morgan Chase New York	(523)
19/04/2023	USD	3.119	EUR	2.902	Couverture	JP Morgan Chase New York	(38)
19/04/2023	USD	1.206	EUR	1.121	Couverture	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	USD	18.014	EUR	16.747	Couverture	JP Morgan Chase New York	(199)
19/04/2023	USD	131	EUR	121	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	7.436	EUR	6.973	Couverture	JP Morgan Chase New York	(148)
19/04/2023	USD	60.794	EUR	57.012	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.211)
19/04/2023	USD	2.541	EUR	2.352	Couverture	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	EUR	6.667	USD	7.184	Couverture	JP Morgan Chase New York	67
19/04/2023	EUR	62.799	USD	67.434	Couverture	JP Morgan Chase New York	866
							1.915.892 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - American Select possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	206	USD	220	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	USD	7.151	EUR	6.659	Couverture	JP Morgan Chase New York	(92)
19/04/2023	USD	8.519	EUR	7.858	Couverture	JP Morgan Chase New York	(28)
19/04/2023	EUR	175.878	USD	189.193	Couverture	JP Morgan Chase New York	2.093
19/04/2023	EUR	398.745	USD	428.931	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.745
19/04/2023	EUR	519.514	USD	558.843	Couverture	JP Morgan Chase New York	6.183
19/04/2023	EUR	1.686	USD	1.812	Couverture	JP Morgan Chase New York	22
19/04/2023	EUR	14.943	USD	16.056	Couverture	JP Morgan Chase New York	195
19/04/2023	EUR	14.853	USD	15.977	Couverture	JP Morgan Chase New York	177
19/04/2023	USD	346	EUR	320	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	9.234	USD	9.933	Couverture	JP Morgan Chase New York	110
19/04/2023	EUR	664	USD	714	Couverture	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	EUR	69	USD	73	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	331	USD	354	Couverture	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	EUR	11.681	USD	12.479	Couverture	JP Morgan Chase New York	225
19/04/2023	EUR	8.649	USD	9.240	Couverture	JP Morgan Chase New York	167
19/04/2023	EUR	3.941	USD	4.210	Couverture	JP Morgan Chase New York	76
19/04/2023	EUR	15	USD	16	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	5.198	USD	5.554	Couverture	JP Morgan Chase New York	100
19/04/2023	EUR	234.443	USD	252.191	Couverture	JP Morgan Chase New York	2.790
19/04/2023	USD	6.328	EUR	5.996	Couverture	JP Morgan Chase New York	(193)
							16.587 USD

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	USD	9.287	EUR	8.699	Couverture	JP Morgan Chase New York	(174)
19/04/2023	EUR	1.485.596	USD	1.602.209	Couverture	JP Morgan Chase New York	13.528
19/04/2023	EUR	1.568	USD	1.691	Couverture	JP Morgan Chase New York	14
19/04/2023	EUR	7.045	USD	7.598	Couverture	JP Morgan Chase New York	64
19/04/2023	EUR	54.371	USD	58.639	Couverture	JP Morgan Chase New York	495
19/04/2023	EUR	63.438	USD	68.475	Couverture	JP Morgan Chase New York	521
19/04/2023	EUR	721	USD	768	Couverture	JP Morgan Chase New York	15
19/04/2023	EUR	10.000	USD	10.663	Couverture	JP Morgan Chase New York	213
19/04/2023	EUR	5.000	USD	5.277	Couverture	JP Morgan Chase New York	161
19/04/2023	EUR	63.273	USD	68.371	Couverture	JP Morgan Chase New York	445
19/04/2023	USD	1.928.258	EUR	1.806.230	Couverture	JP Morgan Chase New York	(36.163)
19/04/2023	USD	13	SGD	18	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	5.794	EUR	5.368	Couverture	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	USD	16	SGD	21	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	16	SGD	22	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	9.719	EUR	9.035	Couverture	JP Morgan Chase New York	(108)
19/04/2023	USD	449	EUR	411	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	USD	2.038	EUR	1.909	Couverture	JP Morgan Chase New York	(38)
19/04/2023	EUR	90.892	USD	97.943	Couverture	JP Morgan Chase New York	911
19/04/2023	EUR	111.180	USD	117.331	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.588
19/04/2023	EUR	24.858	USD	27.106	Couverture	JP Morgan Chase New York	(71)
19/04/2023	USD	71.017	EUR	66.522	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.332)
19/04/2023	USD	22	SGD	29	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	1.402.583	EUR	1.284.466	Couverture	JP Morgan Chase New York	5.589
19/04/2023	USD	1.480	EUR	1.356	Couverture	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	USD	6.700	EUR	6.136	Couverture	JP Morgan Chase New York	27
19/04/2023	USD	51.573	EUR	47.230	Couverture	JP Morgan Chase New York	206
19/04/2023	SGD	1.299	USD	965	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	2.083.480	USD	2.241.206	Couverture	JP Morgan Chase New York	24.791
19/04/2023	SGD	20	USD	15	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	SGD	34	USD	25	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14.997	USD	16.258	Couverture	JP Morgan Chase New York	53
19/04/2023	EUR	5.988	USD	6.434	Couverture	JP Morgan Chase New York	78
19/04/2023	EUR	56.927.593	USD	61.237.193	Couverture	JP Morgan Chase New York	677.371
19/04/2023	EUR	60.197	USD	64.754	Couverture	JP Morgan Chase New York	716
19/04/2023	EUR	272.142	USD	292.744	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.238
19/04/2023	EUR	15.325	USD	16.711	Couverture	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	SGD	16	USD	12	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	23.037	USD	24.985	Couverture	JP Morgan Chase New York	70
							694.141 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	43.437	USD	46.726	Couverture	JP Morgan Chase New York	517
19/04/2023	EUR	1.073	USD	1.163	Couverture	JP Morgan Chase New York	4

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	SGD	371.850	USD	276.264	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.584
19/04/2023	SGD	886	USD	658	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	SGD	14.652	USD	11.042	Couverture	JP Morgan Chase New York	(15)
19/04/2023	SGD	35	USD	27	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
							4.099 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Asia Equities possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	12	USD	13	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	USD	12	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	530	USD	570	Couverture	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	525	USD	565	Couverture	JP Morgan Chase New York	6
							13 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	CHF	788	USD	867	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	1.485	EUR	1.382	Couverture	JP Morgan Chase New York	(18)
19/04/2023	USD	5.702	EUR	5.301	Couverture	JP Morgan Chase New York	(63)
19/04/2023	USD	2.415	EUR	2.289	Couverture	JP Morgan Chase New York	(74)
19/04/2023	USD	1.964	EUR	1.801	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	USD	16.340	EUR	15.149	Couverture	JP Morgan Chase New York	(136)
19/04/2023	USD	7.780	EUR	7.296	Couverture	JP Morgan Chase New York	(155)
19/04/2023	USD	7.459	EUR	6.903	Couverture	JP Morgan Chase New York	(48)
19/04/2023	USD	4.840	EUR	4.463	Couverture	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	USD	5.111	EUR	4.743	Couverture	JP Morgan Chase New York	(47)
19/04/2023	USD	8.760	EUR	8.234	Couverture	JP Morgan Chase New York	(196)
19/04/2023	SGD	90.831.288	USD	67.482.664	Couverture	JP Morgan Chase New York	875.691
19/04/2023	SGD	2.211.696	USD	1.667.302	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2.810)
19/04/2023	USD	370	EUR	341	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	SGD	3.135.633	USD	2.339.410	Couverture	JP Morgan Chase New York	20.423
19/04/2023	GBP	613	USD	746	Couverture	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	GBP	21	USD	26	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	799	USD	859	Couverture	JP Morgan Chase New York	10
19/04/2023	EUR	130.892	USD	142.870	Couverture	JP Morgan Chase New York	(511)
19/04/2023	EUR	577.962	USD	621.716	Couverture	JP Morgan Chase New York	6.877
19/04/2023	EUR	13.282	USD	14.498	Couverture	JP Morgan Chase New York	(52)
19/04/2023	EUR	19.639	USD	20.981	Couverture	JP Morgan Chase New York	379
19/04/2023	EUR	5.676.068	USD	6.105.765	Couverture	JP Morgan Chase New York	67.538
19/04/2023	EUR	98	USD	106	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	27	USD	29	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	193.345	USD	206.550	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.732
19/04/2023	CHF	23	USD	25	Couverture	JP Morgan Chase New York	0

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	GBP	15	USD	18	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	2.490	EUR	2.280	Couverture	JP Morgan Chase New York	11
							970.551 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	776	USD	835	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	19	USD	21	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	19	USD	21	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	4.990	USD	5.321	Couverture	JP Morgan Chase New York	106
19/04/2023	EUR	506.802	USD	546.120	Couverture	JP Morgan Chase New York	5.080
19/04/2023	EUR	1.490	USD	1.615	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	CHF	21	USD	22	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	763	USD	820	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	CHF	20	USD	22	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	837	USD	922	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	EUR	16	USD	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11.212	USD	12.238	Couverture	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	EUR	19	USD	21	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	749	USD	806	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	EUR	773	USD	831	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	CHF	846	USD	932	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	EUR	20.236	USD	21.768	Couverture	JP Morgan Chase New York	241
							5.416 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	46	USD	49	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	2.241	EUR	2.065	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	USD	9.918	EUR	9.220	Couverture	JP Morgan Chase New York	(101)
19/04/2023	USD	99	EUR	94	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	137.801	EUR	128.103	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.402)
19/04/2023	USD	9.918	EUR	9.189	Couverture	JP Morgan Chase New York	(69)
19/04/2023	USD	10.340	EUR	9.482	Couverture	JP Morgan Chase New York	25
19/04/2023	USD	1.064	EUR	989	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	SGD	17.553	EUR	12.190	Couverture	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	SGD	5.207	EUR	3.618	Couverture	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	SGD	439.402	EUR	303.763	Couverture	JP Morgan Chase New York	289
19/04/2023	SGD	2.694	EUR	1.871	Couverture	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	SGD	2.663	EUR	1.861	Couverture	JP Morgan Chase New York	(18)
19/04/2023	SGD	5.367	EUR	3.742	Couverture	JP Morgan Chase New York	(28)
19/04/2023	SGD	6.984	EUR	4.878	Couverture	JP Morgan Chase New York	(45)
19/04/2023	SGD	21.594.109	EUR	14.915.595	Couverture	JP Morgan Chase New York	26.842

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	SGD	2.824	EUR	1.957	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	SGD	41.715	EUR	28.769	Couverture	JP Morgan Chase New York	97
19/04/2023	SGD	3.202	EUR	2.227	Couverture	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	SGD	33.404	EUR	23.433	Couverture	JP Morgan Chase New York	(319)
19/04/2023	EUR	4.060	SGD	5.858	Couverture	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	13.217	SGD	18.989	Couverture	JP Morgan Chase New York	78
19/04/2023	EUR	581.049	SGD	838.691	Couverture	JP Morgan Chase New York	702
19/04/2023	EUR	21.260	SGD	30.785	Couverture	JP Morgan Chase New York	(43)
19/04/2023	EUR	891	SGD	1.287	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	5.757	USD	6.170	Couverture	JP Morgan Chase New York	84
19/04/2023	USD	90.420	EUR	84.205	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.068)
19/04/2023	USD	3.122	EUR	2.859	Couverture	JP Morgan Chase New York	11
							24.948 EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	CHF	60.425	EUR	61.851	Couverture	JP Morgan Chase New York	(912)
19/04/2023	SGD	314.062	EUR	216.975	Couverture	JP Morgan Chase New York	347
19/04/2023	EUR	4.516	USD	4.840	Couverture	JP Morgan Chase New York	66
19/04/2023	EUR	547	SGD	787	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	6.984	SGD	10.053	Couverture	JP Morgan Chase New York	28
19/04/2023	EUR	13.817	SGD	19.784	Couverture	JP Morgan Chase New York	128
19/04/2023	EUR	292.486	SGD	422.177	Couverture	JP Morgan Chase New York	353
19/04/2023	EUR	26.023	SGD	37.409	Couverture	JP Morgan Chase New York	138
19/04/2023	EUR	23.890	SGD	34.470	Couverture	JP Morgan Chase New York	38
19/04/2023	EUR	3.499	SGD	5.026	Couverture	JP Morgan Chase New York	21
19/04/2023	SGD	504	EUR	349	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	209	SGD	300	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	SGD	1.407	EUR	975	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	SGD	1.575	EUR	1.087	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	USD	3.180	EUR	2.956	Couverture	JP Morgan Chase New York	(32)
19/04/2023	USD	136.057	EUR	126.482	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.385)
19/04/2023	SGD	18.607	EUR	13.053	Couverture	JP Morgan Chase New York	(178)
19/04/2023	USD	88	EUR	81	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	3.835	EUR	3.514	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	108	USD	116	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	CHF	1.548	EUR	1.556	Couverture	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	SGD	11.645.914	EUR	8.044.126	Couverture	JP Morgan Chase New York	14.476
19/04/2023	EUR	2.332	CHF	2.272	Couverture	JP Morgan Chase New York	41
							13.155 EUR

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	CHF	57.377	EUR	58.736	Couverture	JP Morgan Chase New York	(869)
19/04/2023	EUR	267.753	CHF	260.870	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.655
19/04/2023	EUR	80.593	CHF	78.521	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.401
19/04/2023	EUR	44.833	CHF	44.643	Couverture	JP Morgan Chase New York	(190)
19/04/2023	EUR	34.156	CHF	33.978	Couverture	JP Morgan Chase New York	(112)
19/04/2023	USD	8.807.227	EUR	8.187.414	Couverture	JP Morgan Chase New York	(89.574)
19/04/2023	EUR	20.678	CHF	20.540	Couverture	JP Morgan Chase New York	(37)
19/04/2023	CHF	4.881	EUR	4.920	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	CHF	135.008	EUR	136.078	Couverture	JP Morgan Chase New York	80
19/04/2023	CHF	185.764	EUR	190.148	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2.802)
19/04/2023	CHF	6.803.169	EUR	6.963.740	Couverture	JP Morgan Chase New York	(102.601)
19/04/2023	CHF	2.031.801	EUR	2.079.756	Couverture	JP Morgan Chase New York	(30.642)
19/04/2023	EUR	7.289	CHF	7.101	Couverture	JP Morgan Chase New York	127
19/04/2023	USD	1.153.754	EUR	1.072.558	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11.734)
19/04/2023	USD	191.190	EUR	176.375	Couverture	JP Morgan Chase New York	(585)
19/04/2023	USD	370.602	EUR	341.885	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.134)
19/04/2023	EUR	5.558	USD	5.989	Couverture	JP Morgan Chase New York	51
19/04/2023	EUR	92.246	USD	100.000	Couverture	JP Morgan Chase New York	300
19/04/2023	EUR	83.030	USD	89.314	Couverture	JP Morgan Chase New York	911
19/04/2023	EUR	292.571	USD	313.558	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.273
19/04/2023	EUR	582.334	USD	624.106	Couverture	JP Morgan Chase New York	8.506
19/04/2023	EUR	35.530	USD	38.806	Couverture	JP Morgan Chase New York	(151)
19/04/2023	EUR	6.693	USD	7.310	Couverture	JP Morgan Chase New York	(28)
19/04/2023	EUR	38.276	USD	41.022	Couverture	JP Morgan Chase New York	559
19/04/2023	CHF	39.881	EUR	40.197	Couverture	JP Morgan Chase New York	24
19/04/2023	USD	25.060	EUR	23.118	Couverture	JP Morgan Chase New York	(77)
19/04/2023	USD	17.345.031	EUR	16.124.365	Couverture	JP Morgan Chase New York	(176.406)
							(396.052) EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European Select possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	2.664	GBP	2.338	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	1.306.065	EUR	1.477.460	Couverture	JP Morgan Chase New York	7.934
19/04/2023	USD	960	EUR	892	Couverture	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	USD	9.906.542	EUR	9.209.364	Couverture	JP Morgan Chase New York	(100.755)
19/04/2023	SGD	29.700	EUR	20.483	Couverture	JP Morgan Chase New York	69
19/04/2023	GBP	250	EUR	283	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	358.114	EUR	329.879	Couverture	JP Morgan Chase New York	(609)
19/04/2023	USD	225.308	EUR	207.543	Couverture	JP Morgan Chase New York	(383)
19/04/2023	SGD	644.041	EUR	444.945	Couverture	JP Morgan Chase New York	711
19/04/2023	GBP	14.384	EUR	16.339	Couverture	JP Morgan Chase New York	20
19/04/2023	GBP	116.357	EUR	132.344	Couverture	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	GBP	5.200.219	EUR	5.882.643	Couverture	JP Morgan Chase New York	31.592
19/04/2023	USD	27	EUR	25	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	1.103	EUR	1.247	Couverture	JP Morgan Chase New York	8

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	75	GBP	66	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	31.783	SGD	45.689	Couverture	JP Morgan Chase New York	168
19/04/2023	EUR	158.002	SGD	227.517	Couverture	JP Morgan Chase New York	567
19/04/2023	EUR	307.848	SGD	443.371	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.050
19/04/2023	EUR	383.701	USD	408.394	Couverture	JP Morgan Chase New York	8.209
19/04/2023	EUR	242.517	USD	258.125	Couverture	JP Morgan Chase New York	5.189
19/04/2023	EUR	212	USD	228	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	23	USD	25	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	271	SGD	391	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	139	EUR	158	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	204	SGD	296	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	2.500	EUR	2.852	Couverture	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	USD	204.246	EUR	191.188	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3.393)
19/04/2023	EUR	2.513	GBP	2.219	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	EUR	770.283	GBP	680.203	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3.317)
19/04/2023	EUR	1.466	GBP	1.289	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.353	GBP	8.239	Couverture	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	EUR	155.441	GBP	136.757	Couverture	JP Morgan Chase New York	(93)
19/04/2023	EUR	39.187	GBP	34.477	Couverture	JP Morgan Chase New York	(24)
19/04/2023	EUR	8.423	GBP	7.446	Couverture	JP Morgan Chase New York	(45)
19/04/2023	USD	19	EUR	18	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	12.659	EUR	14.458	Couverture	JP Morgan Chase New York	(60)
19/04/2023	GBP	1.152	EUR	1.308	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	SGD	2.877	EUR	2.018	Couverture	JP Morgan Chase New York	(27)
19/04/2023	SGD	451.488	EUR	315.519	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3.104)
19/04/2023	SGD	713.522	EUR	493.266	Couverture	JP Morgan Chase New York	469
19/04/2023	USD	992	EUR	932	Couverture	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	SGD	5.157	EUR	3.602	Couverture	JP Morgan Chase New York	(33)
19/04/2023	GBP	2	EUR	2	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	323.910	EUR	303.201	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5.381)
19/04/2023	GBP	106.908	EUR	121.876	Couverture	JP Morgan Chase New York	(290)
19/04/2023	GBP	26.847	EUR	30.605	Couverture	JP Morgan Chase New York	(73)
19/04/2023	GBP	222	EUR	251	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	15.706.533	EUR	14.601.177	Couverture	JP Morgan Chase New York	(159.744)
19/04/2023	SGD	28.407.605	EUR	19.621.848	Couverture	JP Morgan Chase New York	35.313
19/04/2023	GBP	16.172	EUR	18.287	Couverture	JP Morgan Chase New York	105
19/04/2023	EUR	508.777	SGD	734.373	Couverture	JP Morgan Chase New York	615
							(185.379) EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	347.933	CHF	338.989	Couverture	JP Morgan Chase New York	6.050
19/04/2023	EUR	27	CHF	26	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	63	EUR	63	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	220.729	EUR	222.523	Couverture	JP Morgan Chase New York	87
19/04/2023	CHF	17	EUR	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	CHF	2.886	EUR	2.954	Couverture	JP Morgan Chase New York	(44)
19/04/2023	CHF	10.158.559	EUR	10.398.326	Couverture	JP Morgan Chase New York	(153.205)
19/04/2023	CHF	770	EUR	788	Couverture	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	EUR	99	CHF	96	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
							(147.122) EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	100	USD	106	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	GBP	151.939	USD	184.881	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.058
19/04/2023	USD	7.402	EUR	6.893	Couverture	JP Morgan Chase New York	(95)
19/04/2023	EUR	96	USD	104	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	1.000	USD	1.081	Couverture	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	99	USD	106	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	1.233.313	USD	1.326.679	Couverture	JP Morgan Chase New York	14.675
19/04/2023	EUR	4.285.314	USD	4.609.726	Couverture	JP Morgan Chase New York	50.990
19/04/2023	EUR	10.000	USD	10.745	Couverture	JP Morgan Chase New York	131
							68.771 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Technology possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	USD	22.564	EUR	20.999	Couverture	JP Morgan Chase New York	(274)
19/04/2023	EUR	49.131	USD	53.627	Couverture	JP Morgan Chase New York	(192)
19/04/2023	EUR	648.613	USD	707.967	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2.534)
19/04/2023	EUR	990.785	USD	1.081.451	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3.871)
19/04/2023	EUR	128.597	USD	140.365	Couverture	JP Morgan Chase New York	(502)
19/04/2023	CHF	844.103	USD	929.423	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3.553)
19/04/2023	CHF	26.201	USD	28.421	Couverture	JP Morgan Chase New York	318
19/04/2023	USD	550.640	EUR	513.784	Couverture	JP Morgan Chase New York	(8.145)
19/04/2023	USD	17.161	EUR	15.830	Couverture	JP Morgan Chase New York	(56)
19/04/2023	USD	760	EUR	704	Couverture	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	USD	23.542	EUR	22.130	Couverture	JP Morgan Chase New York	(526)
19/04/2023	USD	35.436	EUR	33.310	Couverture	JP Morgan Chase New York	(791)
19/04/2023	USD	30.163	EUR	28.353	Couverture	JP Morgan Chase New York	(673)
19/04/2023	USD	86.807	EUR	81.599	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.938)
19/04/2023	USD	59	EUR	55	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	82.653	EUR	76.209	Couverture	JP Morgan Chase New York	(231)
19/04/2023	USD	44.555	EUR	41.081	Couverture	JP Morgan Chase New York	(125)
19/04/2023	USD	342.241	EUR	316.722	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2.225)
19/04/2023	USD	187.617	EUR	173.628	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.220)
19/04/2023	USD	18.383	EUR	17.420	Couverture	JP Morgan Chase New York	(562)
19/04/2023	USD	282	EUR	259	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	1.873	EUR	1.736	Couverture	JP Morgan Chase New York	(14)

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	661	USD	722	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	19.604	EUR	18.163	Couverture	JP Morgan Chase New York	(149)
19/04/2023	EUR	2.605	USD	2.846	Couverture	JP Morgan Chase New York	(12)
19/04/2023	EUR	4.754.827	USD	5.114.783	Couverture	JP Morgan Chase New York	56.577
19/04/2023	USD	1.989	EUR	1.851	Couverture	JP Morgan Chase New York	(24)
19/04/2023	USD	41.994	EUR	39.039	Couverture	JP Morgan Chase New York	(465)
19/04/2023	EUR	60.000	USD	64.763	Couverture	JP Morgan Chase New York	493
19/04/2023	EUR	32.209	USD	34.766	Couverture	JP Morgan Chase New York	265
19/04/2023	EUR	31.219	USD	34.043	Couverture	JP Morgan Chase New York	(89)
19/04/2023	EUR	1.815.686	USD	1.953.139	Couverture	JP Morgan Chase New York	21.604
19/04/2023	EUR	391	USD	412	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	1.401	USD	1.511	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	2.927	USD	3.144	Couverture	JP Morgan Chase New York	40
19/04/2023	EUR	20.905	USD	22.292	Couverture	JP Morgan Chase New York	445
19/04/2023	EUR	11.659	USD	12.432	Couverture	JP Morgan Chase New York	248
19/04/2023	EUR	5.075	USD	5.484	Couverture	JP Morgan Chase New York	36
19/04/2023	EUR	1.771	USD	1.920	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	EUR	1.500.000	USD	1.616.372	Couverture	JP Morgan Chase New York	15.031
19/04/2023	EUR	212.886	USD	229.402	Couverture	JP Morgan Chase New York	2.133
19/04/2023	EUR	56.004	USD	59.829	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.081
19/04/2023	EUR	768.115	USD	820.577	Couverture	JP Morgan Chase New York	14.827
19/04/2023	EUR	1.127.730	USD	1.204.752	Couverture	JP Morgan Chase New York	21.769
19/04/2023	EUR	145.919	USD	155.885	Couverture	JP Morgan Chase New York	2.817
19/04/2023	EUR	23.318.799	USD	25.084.107	Couverture	JP Morgan Chase New York	277.465
19/04/2023	EUR	36.786.443	USD	39.571.295	Couverture	JP Morgan Chase New York	437.714
19/04/2023	EUR	5.792	USD	6.230	Couverture	JP Morgan Chase New York	69
19/04/2023	CHF	22.197	USD	24.338	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
							824.792 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - UK Equities possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	1.166	GBP	1.032	Couverture	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	EUR	857	GBP	757	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	EUR	13.777	GBP	12.179	Couverture	JP Morgan Chase New York	(66)
19/04/2023	CHF	933	GBP	844	Couverture	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	EUR	850	GBP	751	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	GBP	50.968	EUR	57.891	Couverture	JP Morgan Chase New York	66
19/04/2023	GBP	2.379	CHF	2.632	Couverture	JP Morgan Chase New York	45
19/04/2023	GBP	93.595	USD	113.901	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.512
19/04/2023	GBP	20	EUR	23	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	23	CHF	25	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	23	USD	28	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	20	EUR	23	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	20	EUR	23	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	23	CHF	25	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	23	USD	28	Couverture	JP Morgan Chase New York	0

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	GBP	14.936	USD	18.177	Couverture	JP Morgan Chase New York	241
19/04/2023	GBP	8.545	EUR	9.677	Couverture	JP Morgan Chase New York	37
19/04/2023	GBP	4.872	EUR	5.550	Couverture	JP Morgan Chase New York	(8)
19/04/2023	GBP	2.569	EUR	2.918	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	GBP	6.800	EUR	7.746	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	EUR	48.448	GBP	42.652	Couverture	JP Morgan Chase New York	(53)
19/04/2023	CHF	942	GBP	853	Couverture	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	EUR	856	GBP	757	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	CHF	943	GBP	854	Couverture	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	EUR	82.304	GBP	72.756	Couverture	JP Morgan Chase New York	(389)
19/04/2023	CHF	41.344	GBP	37.414	Couverture	JP Morgan Chase New York	(752)
19/04/2023	EUR	2.929	GBP	2.586	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	GBP	22.214	EUR	25.231	Couverture	JP Morgan Chase New York	29
19/04/2023	EUR	180	GBP	158	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	95.945	GBP	84.221	Couverture	JP Morgan Chase New York	141
19/04/2023	EUR	105.860	GBP	93.358	Couverture	JP Morgan Chase New York	(278)
19/04/2023	EUR	21.226	GBP	18.687	Couverture	JP Morgan Chase New York	(23)
19/04/2023	EUR	52.333	GBP	46.072	Couverture	JP Morgan Chase New York	(57)
19/04/2023	EUR	116.692	GBP	102.732	Couverture	JP Morgan Chase New York	(128)
19/04/2023	CHF	1.510	GBP	1.336	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	EUR	366	GBP	322	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	1.308	GBP	1.148	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	GBP	1.004	CHF	1.111	Couverture	JP Morgan Chase New York	19
19/04/2023	GBP	1.994	CHF	2.206	Couverture	JP Morgan Chase New York	38
19/04/2023	GBP	202.165	EUR	229.627	Couverture	JP Morgan Chase New York	261
19/04/2023	CHF	20	GBP	18	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	26	GBP	21	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	5.001	GBP	4.411	Couverture	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	EUR	200	GBP	177	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	1.989	GBP	1.758	Couverture	JP Morgan Chase New York	(9)
19/04/2023	EUR	2.162.449	GBP	1.911.591	Couverture	JP Morgan Chase New York	(10.211)
19/04/2023	EUR	92.948	GBP	81.483	Couverture	JP Morgan Chase New York	244
19/04/2023	EUR	19	GBP	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	679.278	GBP	558.245	Couverture	JP Morgan Chase New York	(9.083)
19/04/2023	CHF	72.304	GBP	65.431	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.315)
19/04/2023	EUR	5.061.591	GBP	4.474.414	Couverture	JP Morgan Chase New York	(23.901)
19/04/2023	EUR	2.394.501	GBP	2.116.723	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11.307)
19/04/2023	CHF	98.050	GBP	88.729	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.783)
19/04/2023	EUR	221	GBP	194	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	230	GBP	201	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	2.095	GBP	1.852	Couverture	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	EUR	942.098	GBP	832.809	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4.449)
19/04/2023	EUR	1.591	GBP	1.400	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	26	GBP	21	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	19	GBP	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	56.591	EUR	64.278	Couverture	JP Morgan Chase New York	73
19/04/2023	GBP	8.283	USD	10.135	Couverture	JP Morgan Chase New York	89
19/04/2023	GBP	845	EUR	963	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	GBP	23	CHF	25	Couverture	JP Morgan Chase New York	0

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	GBP	23	USD	28	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	16.509	GBP	13.316	Couverture	JP Morgan Chase New York	31
19/04/2023	USD	1.061	GBP	872	Couverture	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	CHF	20	GBP	18	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	1.061	GBP	872	Couverture	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	USD	1.053	GBP	865	Couverture	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	EUR	1.721	GBP	1.515	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	CHF	2.099	GBP	1.856	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	USD	103.762	GBP	83.695	Couverture	JP Morgan Chase New York	192
19/04/2023	EUR	19	GBP	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	20	GBP	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	26	GBP	21	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	4.258.892	GBP	3.500.044	Couverture	JP Morgan Chase New York	(56.947)
19/04/2023	CHF	882	GBP	780	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
							(117.886) GBP

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - UK Equity Income possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devises achetée	Montant acheté	Devises vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	GBP	67.291	USD	81.890	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.087
19/04/2023	USD	27	GBP	21	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	24.580	GBP	19.826	Couverture	JP Morgan Chase New York	45
19/04/2023	USD	1.052.732	GBP	865.156	Couverture	JP Morgan Chase New York	(14.076)
19/04/2023	USD	3.012.171	GBP	2.475.463	Couverture	JP Morgan Chase New York	(40.275)
19/04/2023	USD	67.571	GBP	54.503	Couverture	JP Morgan Chase New York	125
19/04/2023	USD	695	GBP	561	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	29.287	GBP	24.069	Couverture	JP Morgan Chase New York	(392)
19/04/2023	CHF	2.562	GBP	2.266	Couverture	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	CHF	124.069	GBP	112.276	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2.256)
19/04/2023	CHF	1.567	GBP	1.386	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	CHF	12.718	GBP	11.248	Couverture	JP Morgan Chase New York	30
19/04/2023	CHF	20	GBP	18	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	75.493	GBP	68.317	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.373)
19/04/2023	USD	949.810	GBP	780.573	Couverture	JP Morgan Chase New York	(12.700)
19/04/2023	CHF	613.512	GBP	555.195	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11.155)
19/04/2023	EUR	105.044	GBP	92.087	Couverture	JP Morgan Chase New York	275
19/04/2023	GBP	72.380	EUR	82.212	Couverture	JP Morgan Chase New York	93
19/04/2023	EUR	10.000	GBP	8.803	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	EUR	1.487.061	GBP	1.314.553	Couverture	JP Morgan Chase New York	(7.022)
19/04/2023	EUR	54.719	GBP	48.371	Couverture	JP Morgan Chase New York	(258)
19/04/2023	EUR	259.437	GBP	229.340	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.225)
19/04/2023	EUR	442.546	GBP	391.207	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2.090)
19/04/2023	EUR	115.301	GBP	101.925	Couverture	JP Morgan Chase New York	(544)
19/04/2023	EUR	279.194	GBP	246.806	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.318)
19/04/2023	EUR	40.814	GBP	35.932	Couverture	JP Morgan Chase New York	(45)
19/04/2023	EUR	1.908.854	GBP	1.687.415	Couverture	JP Morgan Chase New York	(9.014)
19/04/2023	EUR	1.548.705	GBP	1.369.045	Couverture	JP Morgan Chase New York	(7.313)

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	33.572	GBP	29.556	Couverture	JP Morgan Chase New York	(37)
19/04/2023	CHF	986	GBP	892	Couverture	JP Morgan Chase New York	(18)
19/04/2023	EUR	20	GBP	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	1.983.784	GBP	1.630.314	Couverture	JP Morgan Chase New York	(26.525)
19/04/2023	USD	1.116	GBP	917	Couverture	JP Morgan Chase New York	(15)
19/04/2023	GBP	36	SGD	58	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	10.429	EUR	11.846	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	GBP	2.723	EUR	3.093	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	9.135	EUR	10.375	Couverture	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	GBP	31.655	USD	38.522	Couverture	JP Morgan Chase New York	511
19/04/2023	GBP	37	USD	45	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	GBP	1.831	CHF	2.026	Couverture	JP Morgan Chase New York	35
19/04/2023	GBP	35.681	USD	43.423	Couverture	JP Morgan Chase New York	576
19/04/2023	GBP	24.074	CHF	26.633	Couverture	JP Morgan Chase New York	456
19/04/2023	GBP	39	CHF	43	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	GBP	98.811	USD	120.250	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.596
19/04/2023	GBP	57.469	EUR	65.275	Couverture	JP Morgan Chase New York	74
19/04/2023	GBP	973	USD	1.184	Couverture	JP Morgan Chase New York	16
19/04/2023	USD	22.452	GBP	18.110	Couverture	JP Morgan Chase New York	41
19/04/2023	GBP	21	EUR	24	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	56.026	EUR	63.637	Couverture	JP Morgan Chase New York	72
19/04/2023	EUR	10.000	GBP	8.840	Couverture	JP Morgan Chase New York	(48)
19/04/2023	EUR	30.255	GBP	26.636	Couverture	JP Morgan Chase New York	(33)
19/04/2023	EUR	1.142	GBP	1.006	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	5.627	GBP	4.954	Couverture	JP Morgan Chase New York	(6)
19/04/2023	GBP	2.115	EUR	2.402	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	GBP	220.882	USD	271.999	Couverture	JP Morgan Chase New York	985
19/04/2023	GBP	140.733	USD	170.559	Couverture	JP Morgan Chase New York	2.846
19/04/2023	GBP	49.596	EUR	56.303	Couverture	JP Morgan Chase New York	90
19/04/2023	GBP	218.380	USD	269.316	Couverture	JP Morgan Chase New York	651
19/04/2023	GBP	9.629	EUR	10.937	Couverture	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	GBP	4.888	CHF	5.407	Couverture	JP Morgan Chase New York	93
19/04/2023	SGD	1.381	GBP	844	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	GBP	9.836	EUR	11.126	Couverture	JP Morgan Chase New York	53
19/04/2023	EUR	885	GBP	783	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)
							(127.950) GBP

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	1.463	USD	1.581	Couverture	JP Morgan Chase New York	10
19/04/2023	GBP	4	USD	5	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	419.854	USD	451.638	Couverture	JP Morgan Chase New York	4.996
19/04/2023	EUR	7.498	USD	7.913	Couverture	JP Morgan Chase New York	242
19/04/2023	EUR	784	USD	844	Couverture	JP Morgan Chase New York	9
19/04/2023	GBP	29.080	USD	35.385	Couverture	JP Morgan Chase New York	585
19/04/2023	GBP	9.636	USD	11.726	Couverture	JP Morgan Chase New York	194

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	100.205	USD	107.791	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.192
19/04/2023	EUR	2.401.859	USD	2.583.688	Couverture	JP Morgan Chase New York	28.580
19/04/2023	GBP	636.371	USD	774.343	Couverture	JP Morgan Chase New York	12.807
19/04/2023	GBP	8.427.539	USD	10.254.722	Couverture	JP Morgan Chase New York	169.605
19/04/2023	USD	1.395.104	GBP	1.140.110	Couverture	JP Morgan Chase New York	(15.133)
19/04/2023	USD	2.751	EUR	2.523	Couverture	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	USD	15.231	GBP	12.515	Couverture	JP Morgan Chase New York	(250)
19/04/2023	USD	233.065	GBP	191.513	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3.823)
19/04/2023	USD	1.387.979	GBP	1.127.135	Couverture	JP Morgan Chase New York	(6.212)
19/04/2023	USD	707	EUR	665	Couverture	JP Morgan Chase New York	(16)
19/04/2023	USD	810	GBP	666	Couverture	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	USD	9.416	EUR	8.922	Couverture	JP Morgan Chase New York	(288)
19/04/2023	USD	2.552	EUR	2.381	Couverture	JP Morgan Chase New York	(38)
19/04/2023	USD	60.053	EUR	55.729	Couverture	JP Morgan Chase New York	(558)
19/04/2023	USD	1.230	GBP	1.011	Couverture	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	USD	274.075	GBP	225.484	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4.832)
19/04/2023	CHF	10.301	USD	11.342	Couverture	JP Morgan Chase New York	(43)
19/04/2023	EUR	1.173	USD	1.260	Couverture	JP Morgan Chase New York	16
19/04/2023	EUR	1.800	USD	1.919	Couverture	JP Morgan Chase New York	38
							187.055 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	18	GBP	16	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	9.805	GBP	8.658	Couverture	JP Morgan Chase New York	(42)
19/04/2023	EUR	181	GBP	158	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	41.179	GBP	36.099	Couverture	JP Morgan Chase New York	124
19/04/2023	USD	1.915.217	EUR	1.780.432	Couverture	JP Morgan Chase New York	(19.479)
19/04/2023	EUR	39.277	GBP	34.431	Couverture	JP Morgan Chase New York	118
19/04/2023	EUR	748	GBP	657	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	369	GBP	324	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	121.261	GBP	106.301	Couverture	JP Morgan Chase New York	365
19/04/2023	GBP	23	EUR	26	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	76.164	EUR	86.159	Couverture	JP Morgan Chase New York	463
19/04/2023	GBP	690	EUR	781	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	GBP	1.512.411	EUR	1.710.884	Couverture	JP Morgan Chase New York	9.188
19/04/2023	GBP	1.743.077	EUR	1.971.821	Couverture	JP Morgan Chase New York	10.589
19/04/2023	GBP	4.598.592	EUR	5.202.065	Couverture	JP Morgan Chase New York	27.937
19/04/2023	EUR	36.458	USD	39.144	Couverture	JP Morgan Chase New York	467
19/04/2023	GBP	11.355	EUR	12.845	Couverture	JP Morgan Chase New York	69
19/04/2023	GBP	228	EUR	260	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	17.168	GBP	15.098	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	EUR	19	GBP	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	29	GBP	25	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	533	GBP	468	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	2.004	GBP	1.757	Couverture	JP Morgan Chase New York	6

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	73.002	GBP	64.177	Couverture	JP Morgan Chase New York	13
19/04/2023	EUR	291	GBP	255	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	4.148	GBP	3.636	Couverture	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	EUR	40	GBP	35	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11.606	GBP	10.260	Couverture	JP Morgan Chase New York	(63)
19/04/2023	EUR	699	GBP	616	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	586	GBP	514	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	35	GBP	31	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	33	GBP	29	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	31.708	GBP	27.963	Couverture	JP Morgan Chase New York	(95)
19/04/2023	EUR	687	GBP	607	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	EUR	838	GBP	741	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	EUR	487	GBP	429	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	134	GBP	118	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	868	GBP	767	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	GBP	477	EUR	542	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
05/04/2023	GBP	558.443	EUR	636.598	Négociation	NatWest Markets	(1.154)
05/04/2023	USD	459.539	EUR	431.317	Négociation	NatWest Markets	(8.451)
05/04/2023	GBP	475.087	EUR	538.804	Négociation	JP Morgan	1.790
05/04/2023	GBP	525.043	EUR	597.664	Négociation	Lloyds	(225)
05/04/2023	GBP	500.000	EUR	569.352	Négociation	Barclays	(410)
05/04/2023	GBP	3.097.510	EUR	3.518.542	Négociation	JP Morgan	6.068
05/04/2023	USD	674.753	EUR	628.802	Négociation	Lloyds	(7.898)
05/04/2023	EUR	323.329	USD	346.198	Négociation	NatWest Markets	4.760
05/04/2023	GBP	500.000	EUR	570.671	Négociation	JP Morgan	(1.729)
05/04/2023	EUR	256.942	GBP	227.755	Négociation	Barclays	(2.218)
05/04/2023	USD	3.766.280	EUR	3.479.198	Négociation	NatWest Markets	(13.485)
05/04/2023	USD	428.278	EUR	395.637	Négociation	NatWest Markets	(1.537)
05/04/2023	USD	221.532	EUR	205.729	Négociation	Lloyds	(1.876)
05/04/2023	USD	2.525.661	EUR	2.350.026	Négociation	JP Morgan	(25.925)
05/04/2023	EUR	640.613	GBP	562.834	Négociation	JP Morgan	174
05/04/2023	EUR	97.330.858	GBP	86.517.536	Négociation	JP Morgan	(1.116.238)
05/04/2023	EUR	1.688.212	GBP	1.500.000	Négociation	NatWest Markets	(18.617)
05/04/2023	GBP	220.795	EUR	251.751	Négociation	Lloyds	(512)
05/04/2023	GBP	1.500.000	EUR	1.702.779	Négociation	JP Morgan	4.049
05/04/2023	EUR	247.518	USD	265.472	Négociation	NatWest Markets	3.233
05/04/2023	EUR	249.556	USD	269.349	Négociation	JP Morgan	1.703
05/04/2023	EUR	72.230.562	USD	76.672.995	Négociation	JP Morgan	1.676.871
05/04/2023	EUR	671.693	USD	719.090	Négociation	Goldman Sachs	9.992
05/04/2023	USD	250.000	EUR	233.513	Négociation	JP Morgan	(3.465)
05/04/2023	USD	286.219	EUR	263.459	Négociation	Citigroup Global Markets	(82)
05/04/2023	GBP	324.233	EUR	368.392	Négociation	JP Morgan	548
05/04/2023	USD	1.415.553	EUR	1.332.336	Négociation	Lloyds	(29.752)
05/04/2023	EUR	592.886	USD	645.838	Négociation	JP Morgan	(1.411)
05/04/2023	GBP	482.993	EUR	546.093	Négociation	NatWest Markets	3.498
							507.363 EUR

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
04/05/2023	EUR	4.288.956	GBP	3.772.347	Négociation	JP Morgan	1.021
04/05/2023	EUR	3.675.473	USD	4.006.616	Négociation	Citigroup Global Markets	(5.241)
19/04/2023	EUR	238.744	GBP	209.290	Couverture	JP Morgan Chase New York	718
19/04/2023	EUR	12	NOK	132	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	NOK	124	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14	GBP	12	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14	GBP	12	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14	GBP	12	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14	GBP	12	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	14	GBP	12	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	167.603	GBP	147.457	Couverture	JP Morgan Chase New York	(101)
19/04/2023	USD	986	EUR	917	Couverture	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	11	GBP	10	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	NOK	8.408	EUR	744	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	NOK	8.292	EUR	734	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	SEK	8.185	EUR	721	Couverture	JP Morgan Chase New York	6
19/04/2023	GBP	716	EUR	810	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	USD	981	EUR	912	Couverture	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	GBP	704	EUR	797	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	CHF	868	EUR	889	Couverture	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	EUR	13	NOK	144	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	12	SEK	133	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	13	NOK	145	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	16	USD	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	710	EUR	803	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	USD	6.039	EUR	5.614	Couverture	JP Morgan Chase New York	(61)
19/04/2023	CHF	872	EUR	892	Couverture	JP Morgan Chase New York	(13)
19/04/2023	GBP	709	EUR	802	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	EUR	15	CHF	15	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	24	CHF	24	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	12	CHF	12	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	13	SEK	140	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	16	USD	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	96	USD	104	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	984	EUR	915	Couverture	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	EUR	25	USD	26	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	USD	11	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	10	USD	11	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	977	EUR	908	Couverture	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	EUR	10	USD	11	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	16	USD	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	977	EUR	908	Couverture	JP Morgan Chase New York	(10)
19/04/2023	GBP	12.396.179	EUR	14.022.928	Couverture	JP Morgan Chase New York	75.309

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	10	USD	11	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	67	USD	72	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	EUR	16	USD	17	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	714	EUR	808	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
04/04/2023	GBP	43.608	EUR	49.712	Négociation	JP Morgan	(89)
04/04/2023	USD	146.655	EUR	138.049	Négociation	JP Morgan	(3.090)
04/04/2023	GBP	150.000	EUR	170.569	Négociation	Citigroup Global Markets	120
04/04/2023	GBP	27.225	EUR	31.020	Négociation	Barclays	(39)
04/04/2023	USD	268.470	EUR	253.140	Négociation	JP Morgan	(6.079)
04/04/2023	USD	180.512	EUR	167.967	Négociation	JP Morgan	(1.850)
04/04/2023	USD	30.181	EUR	28.330	Négociation	Citigroup Global Markets	(555)
04/04/2023	USD	43.622	EUR	40.657	Négociation	JP Morgan	(514)
04/04/2023	GBP	25.741	EUR	29.303	Négociation	Barclays	(12)
04/04/2023	USD	200.000	EUR	185.463	Négociation	Citigroup Global Markets	(1.412)
04/04/2023	GBP	573.820	EUR	654.911	Négociation	JP Morgan	(1.945)
04/04/2023	GBP	25.761	EUR	29.187	Négociation	JP Morgan	126
04/04/2023	EUR	36.137	GBP	31.748	Négociation	JP Morgan	10
04/04/2023	EUR	5.569.729	GBP	4.936.754	Négociation	Barclays	(47.952)
04/04/2023	USD	257.670	EUR	237.724	Négociation	Citigroup Global Markets	(603)
04/04/2023	EUR	39.368	USD	42.882	Négociation	JP Morgan	(94)
04/04/2023	EUR	28.347	USD	30.399	Négociation	Barclays	372
04/04/2023	EUR	4.767.226	USD	5.101.861	Négociation	Barclays	72.235
04/04/2023	GBP	250.000	EUR	284.681	Négociation	JP Morgan	(199)
04/04/2023	GBP	100.000	EUR	113.880	Négociation	Barclays	(87)
04/04/2023	USD	41.416	EUR	38.262	Négociation	Barclays	(149)
							79.781 EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	255.062	GBP	225.484	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.382)
19/04/2023	EUR	23	USD	25	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	927	EUR	949	Couverture	JP Morgan Chase New York	(14)
19/04/2023	CHF	19	EUR	19	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	22	EUR	20	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	3.588	EUR	4.084	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	1.047	EUR	974	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	GBP	175.074	EUR	198.049	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.064
19/04/2023	GBP	9.445.688	EUR	10.685.244	Couverture	JP Morgan Chase New York	57.383
19/04/2023	GBP	767	EUR	867	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	GBP	190.937	EUR	217.283	Couverture	JP Morgan Chase New York	(129)
19/04/2023	GBP	16	EUR	18	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	476	EUR	538	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	4.109	GBP	3.617	Couverture	JP Morgan Chase New York	(5)
19/04/2023	EUR	372.042	GBP	327.549	Couverture	JP Morgan Chase New York	(481)
19/04/2023	EUR	1.694.815	GBP	1.496.617	Couverture	JP Morgan Chase New York	(7.299)
19/04/2023	EUR	771.282	GBP	678.293	Couverture	JP Morgan Chase New York	(144)

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	1.534.343	GBP	1.350.728	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.849)
19/04/2023	EUR	21	GBP	18	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	27	CHF	26	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
							47.139 EUR

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	4.356	USD	4.686	Couverture	JP Morgan Chase New York	52
19/04/2023	EUR	36.265	USD	38.742	Couverture	JP Morgan Chase New York	700
19/04/2023	EUR	264	USD	282	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	EUR	90	USD	97	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	663	USD	700	Couverture	JP Morgan Chase New York	21
19/04/2023	EUR	1.738.552	USD	1.870.166	Couverture	JP Morgan Chase New York	20.686
19/04/2023	EUR	12.664	USD	13.623	Couverture	JP Morgan Chase New York	151
19/04/2023	USD	5	EUR	5	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
							21.617 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	EUR	14	USD	16	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	3.284	USD	3.565	Couverture	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	614	USD	661	Couverture	JP Morgan Chase New York	7
19/04/2023	EUR	140.057	USD	150.660	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.666
19/04/2023	EUR	14	USD	15	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	3.194	USD	3.412	Couverture	JP Morgan Chase New York	62
19/04/2023	USD	14	EUR	13	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	3.250	EUR	3.033	Couverture	JP Morgan Chase New York	(48)
							1.694 USD

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities possédait les contrats de change à terme en cours suivants :

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	USD	864	EUR	805	Couverture	JP Morgan Chase New York	(11)
19/04/2023	EUR	116.664	USD	126.282	Couverture	JP Morgan Chase New York	601
19/04/2023	GBP	22	USD	27	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	2.395.600	USD	2.914.992	Couverture	JP Morgan Chase New York	48.211
19/04/2023	GBP	843.534	USD	1.026.421	Couverture	JP Morgan Chase New York	16.976
19/04/2023	GBP	47.385.733	USD	57.659.481	Couverture	JP Morgan Chase New York	953.639
19/04/2023	GBP	17.384	USD	21.437	Couverture	JP Morgan Chase New York	66
19/04/2023	GBP	956.990	USD	1.180.093	Couverture	JP Morgan Chase New York	3.642

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	GBP	48.557	USD	59.877	Couverture	JP Morgan Chase New York	185
19/04/2023	GBP	400	USD	487	Couverture	JP Morgan Chase New York	8
19/04/2023	GBP	2.150	USD	2.606	Couverture	JP Morgan Chase New York	54
19/04/2023	GBP	343	USD	420	Couverture	JP Morgan Chase New York	5
19/04/2023	GBP	3.431	USD	4.197	Couverture	JP Morgan Chase New York	47
19/04/2023	GBP	100	USD	123	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	GBP	25	USD	31	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	GBP	1.153	USD	1.428	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	GBP	2.421	USD	2.969	Couverture	JP Morgan Chase New York	26
19/04/2023	SGD	7.920	USD	5.943	Couverture	JP Morgan Chase New York	17
19/04/2023	SGD	5.272.279	USD	3.917.014	Couverture	JP Morgan Chase New York	50.829
19/04/2023	SGD	94.304	USD	71.040	Couverture	JP Morgan Chase New York	(68)
19/04/2023	EUR	32.952	USD	35.668	Couverture	JP Morgan Chase New York	170
19/04/2023	EUR	7.480	USD	8.032	Couverture	JP Morgan Chase New York	103
19/04/2023	EUR	99	USD	107	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	EUR	98	USD	106	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	50.723	SGD	67.553	Couverture	JP Morgan Chase New York	(116)
19/04/2023	USD	33.673	SGD	45.052	Couverture	JP Morgan Chase New York	(232)
19/04/2023	USD	55.292	GBP	45.086	Couverture	JP Morgan Chase New York	(476)
19/04/2023	USD	1.220	GBP	1.000	Couverture	JP Morgan Chase New York	(17)
19/04/2023	CHF	1.797.125	USD	1.978.774	Couverture	JP Morgan Chase New York	(7.564)
19/04/2023	CHF	33.384	USD	36.483	Couverture	JP Morgan Chase New York	135
19/04/2023	CHF	19	USD	21	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	CHF	1.018	USD	1.120	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)
19/04/2023	EUR	500	USD	540	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	USD	2.584	SGD	3.429	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
19/04/2023	EUR	2.490	USD	2.655	Couverture	JP Morgan Chase New York	53
19/04/2023	EUR	1.198	USD	1.264	Couverture	JP Morgan Chase New York	39
19/04/2023	EUR	1.631.693	USD	1.755.217	Couverture	JP Morgan Chase New York	19.415
19/04/2023	EUR	5.754.192	USD	6.189.803	Couverture	JP Morgan Chase New York	68.468
19/04/2023	EUR	60.379	USD	65.357	Couverture	JP Morgan Chase New York	311
19/04/2023	EUR	3.279	USD	3.550	Couverture	JP Morgan Chase New York	17
19/04/2023	EUR	1.000	USD	1.084	Couverture	JP Morgan Chase New York	4
19/04/2023	EUR	161.334	USD	173.548	Couverture	JP Morgan Chase New York	1.920
19/04/2023	EUR	298	USD	321	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	EUR	2.062	USD	2.219	Couverture	JP Morgan Chase New York	25
19/04/2023	EUR	3.014.174	USD	3.242.356	Couverture	JP Morgan Chase New York	35.865
19/04/2023	USD	95.679	SGD	128.814	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.264)
19/04/2023	USD	11.812	SGD	15.800	Couverture	JP Morgan Chase New York	(79)
19/04/2023	USD	1.869	SGD	2.516	Couverture	JP Morgan Chase New York	(24)
19/04/2023	USD	964	GBP	782	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	136	GBP	110	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	12.525	GBP	10.404	Couverture	JP Morgan Chase New York	(344)
19/04/2023	USD	8.170	GBP	6.786	Couverture	JP Morgan Chase New York	(224)
19/04/2023	USD	2.076	GBP	1.724	Couverture	JP Morgan Chase New York	(57)
19/04/2023	USD	148	GBP	122	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	657	GBP	533	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3)
19/04/2023	USD	240	GBP	195	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	513	GBP	418	Couverture	JP Morgan Chase New York	(4)

Annexes aux Comptes

(suite)

9 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS DE CHANGE À TERME

(suite)

Date d'échéance	Devise achetée	Montant acheté	Devise vendue	Montant vendu	Pour	Contrepartie	Plus-value/ (moins-value) latente dans la devise de référence du Portefeuille
19/04/2023	USD	11.255	GBP	9.250	Couverture	JP Morgan Chase New York	(186)
19/04/2023	USD	6.164	GBP	5.000	Couverture	JP Morgan Chase New York	(21)
19/04/2023	USD	78.663	GBP	65.003	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.741)
19/04/2023	USD	1.525.629	GBP	1.260.702	Couverture	JP Morgan Chase New York	(33.766)
19/04/2023	USD	677	GBP	549	Couverture	JP Morgan Chase New York	(2)
19/04/2023	USD	5.393	EUR	5.000	Couverture	JP Morgan Chase New York	(45)
19/04/2023	USD	8.568	EUR	7.943	Couverture	JP Morgan Chase New York	(71)
19/04/2023	USD	169.992	EUR	159.713	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3.709)
19/04/2023	USD	48.432	EUR	45.504	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.057)
19/04/2023	USD	44.202	EUR	40.471	Couverture	JP Morgan Chase New York	186
19/04/2023	USD	89.014	EUR	83.632	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.942)
19/04/2023	USD	9.985	GBP	8.183	Couverture	JP Morgan Chase New York	(137)
19/04/2023	USD	27.945	GBP	23.092	Couverture	JP Morgan Chase New York	(619)
19/04/2023	USD	1.807.032	GBP	1.486.657	Couverture	JP Morgan Chase New York	(31.856)
19/04/2023	USD	4.257	GBP	3.504	Couverture	JP Morgan Chase New York	(78)
19/04/2023	USD	33.633	SGD	45.433	Couverture	JP Morgan Chase New York	(558)
19/04/2023	USD	2.748	SGD	3.638	Couverture	JP Morgan Chase New York	10
19/04/2023	USD	258.994	SGD	348.647	Couverture	JP Morgan Chase New York	(3.390)
19/04/2023	USD	11.551	SGD	15.376	Couverture	JP Morgan Chase New York	(21)
19/04/2023	USD	115.539	SGD	155.211	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1.270)
19/04/2023	USD	2.193	SGD	2.911	Couverture	JP Morgan Chase New York	2
19/04/2023	USD	91.110	SGD	122.270	Couverture	JP Morgan Chase New York	(908)
19/04/2023	USD	31	CHF	28	Couverture	JP Morgan Chase New York	0
19/04/2023	USD	981	CHF	901	Couverture	JP Morgan Chase New York	(7)
19/04/2023	USD	1.067	GBP	878	Couverture	JP Morgan Chase New York	(20)
19/04/2023	USD	53.997	CHF	49.766	Couverture	JP Morgan Chase New York	(589)
19/04/2023	USD	10.887	EUR	10.210	Couverture	JP Morgan Chase New York	(217)
19/04/2023	USD	4.766	EUR	4.478	Couverture	JP Morgan Chase New York	(104)
19/04/2023	USD	9.244	EUR	8.477	Couverture	JP Morgan Chase New York	24
19/04/2023	USD	4.519	EUR	4.144	Couverture	JP Morgan Chase New York	12
19/04/2023	USD	19.690	EUR	18.056	Couverture	JP Morgan Chase New York	52
19/04/2023	USD	8.488	EUR	7.900	Couverture	JP Morgan Chase New York	(103)
19/04/2023	USD	152	EUR	141	Couverture	JP Morgan Chase New York	(1)
19/04/2023	USD	494	GBP	399	Couverture	JP Morgan Chase New York	1
19/04/2023	USD	3.775	GBP	3.106	Couverture	JP Morgan Chase New York	(67)
19/04/2023	USD	52.245	CHF	48.114	Couverture	JP Morgan Chase New York	(528)
19/04/2023	USD	17.519	SGD	23.274	Couverture	JP Morgan Chase New York	3
							1.107.623 USD

Annexes aux Comptes

(suite)

10 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR SWAPS

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond possédait les contrats sur Swaps sur défaut de crédit en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Vente	EUR	1.300.000	20/06/2025	16.406	0,00
CDS	JPMorgan	Glencore International	Vente	EUR	1.100.000	20/06/2026	137.572	0,02
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Vente	EUR	1.770.000	20/12/2026	248.476	0,03
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Achat	EUR	4.650.000	20/06/2027	41.686	0,00
CDS	JPMorgan	SSE plc	Achat	EUR	1.400.000	20/06/2027	(30.170)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Achat	EUR	1.200.000	20/06/2027	(1.715)	(0,00)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Achat	EUR	2.330.000	20/06/2027	(44.141)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	16.200.000	20/12/2027	(629.938)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	49.850.000	20/12/2027	576.905	0,07
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	20.000.000	20/12/2027	(231.456)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	4.000.000	20/12/2027	155.540	0,02
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Achat	EUR	4.740.000	20/12/2027	(38.288)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Achat	EUR	3.000.000	20/12/2027	(66.281)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Achat	EUR	4.000.000	20/12/2027	(106.106)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Achat	EUR	580.000	20/12/2023	(13.076)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Achat	EUR	200.000	20/12/2023	(4.509)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	22.000.000	20/12/2027	254.602	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	8.000.000	20/12/2027	80.854	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	11.000.000	20/12/2027	127.301	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	4.000.000	20/12/2027	40.427	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	9.500.000	20/12/2027	96.014	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	10.700.000	20/12/2027	123.829	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	5.550.000	20/12/2027	(64.229)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	18.000.000	20/12/2027	(208.311)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	38.000.000	20/12/2027	384.057	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	9.420.000	20/12/2027	95.206	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	31.080.000	20/12/2027	314.118	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	2.000.000	20/12/2027	(20.214)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	20.000.000	20/12/2027	(202.135)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	10.400.000	20/12/2027	(105.110)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	21.710.000	20/12/2027	(219.418)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	45.890.000	20/12/2027	(463.798)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	8.000.000	20/12/2027	(92.582)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	20.000.000	20/12/2027	(231.456)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	22.000.000	20/12/2027	(254.602)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Vente	EUR	15.700.000	20/06/2028	125.756	0,02

Annexes aux Comptes

(suite)

10 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR SWAPS

(suite)

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	10.810.000	20/06/2028	(305.221)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	12.200.000	20/12/2027	474.398	0,06
							(39.609) USD	(0,00)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond possédait les contrats sur Swaps sur défaut de crédit en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	4.201.000	20/12/2027	(39.080)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	2.680.000	20/12/2027	(95.919)	(0,12)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	820.000	20/12/2027	(7.628)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	2.600.000	20/12/2027	(24.187)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	1.400.000	20/12/2027	13.024	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	3.900.000	20/12/2027	(36.280)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	5.500.000	20/12/2027	(51.164)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	1.700.000	20/12/2027	15.814	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	11.980.000	20/06/2028	(88.324)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	13.921.000	20/12/2027	129.501	0,16
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	2.370.000	20/06/2028	(61.593)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	2.680.000	20/12/2027	95.920	0,12
CDS	JPMorgan	Glencore International	Vente	EUR	400.000	20/06/2026	46.046	0,06
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Vente	EUR	600.000	20/06/2027	6.269	0,01
CDS	Goldman Sachs	Airbus SE	Vente	EUR	600.000	20/06/2027	7.198	0,01
							(90.403) EUR	(0,11)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond possédait les contrats sur Swaps sur défaut de crédit en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Achat	EUR	325.000	20/12/2023	(6.744)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Vente	EUR	900.000	20/06/2025	10.454	0,01
CDS	JPMorgan	Glencore International	Vente	EUR	600.000	20/06/2026	69.069	0,05
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Achat	EUR	1.700.000	20/06/2027	14.027	0,01
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Achat	EUR	537.500	20/06/2027	(8.908)	(0,01)
CDS	JPMorgan	SSE plc	Achat	EUR	1.870.000	20/06/2027	(37.092)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Achat	EUR	800.000	20/06/2027	(1.053)	(0,00)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Achat	EUR	2.160.000	20/06/2027	(37.664)	(0,03)

Annexes aux Comptes

(suite)

10 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR SWAPS

(suite)

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	26.200.000	20/12/2027	(937.723)	(0,69)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	32.524.466	20/12/2027	302.561	0,22
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	1.120.000	20/12/2027	(10.419)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	1.095.534	20/12/2027	10.191	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	3.700.000	20/12/2027	113.575	0,08
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	6.300.000	20/12/2027	(58.606)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Achat	EUR	590.000	20/12/2027	5.003	0,00
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Achat	EUR	2.190.000	20/12/2027	(16.282)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	1.750.000	20/12/2027	62.634	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	1.000.000	20/12/2027	35.791	0,03
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Achat	EUR	1.750.000	20/12/2027	(35.587)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Achat	EUR	1.700.000	20/12/2027	(41.507)	(0,03)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Achat	USD	800.000	20/06/2023	(7.136)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	600.000	20/12/2027	21.475	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	2.250.000	20/12/2027	80.530	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	1.000.000	20/12/2027	35.791	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	600.000	20/12/2027	21.475	0,02
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Vente	EUR	580.000	20/12/2027	(56.599)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	800.000	20/12/2027	28.633	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	550.000	20/12/2027	19.685	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	1.500.000	20/12/2027	53.686	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	1.800.000	20/12/2027	64.424	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	6.000.000	20/12/2027	(55.815)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	5.200.000	20/12/2027	(48.373)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	4.000.000	20/12/2027	(37.210)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	900.000	20/12/2027	32.212	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	4.200.000	20/12/2027	(39.071)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	11.920.000	20/06/2028	(309.782)	(0,23)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	13.450.000	20/12/2027	481.388	0,35
							(282.967) EUR	(0,22)

Annexes aux Comptes

(suite)

10 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR SWAPS

(suite)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return possédait les contrats sur Swaps sur défaut de crédit en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	2.080.000	20/12/2027	80.881	0,23
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	3.340.000	20/12/2027	38.653	0,11
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Vente	USD	3.340.000	20/06/2028	37.908	0,11
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	3.340.000	20/12/2027	(38.653)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	2.080.000	20/12/2027	(80.881)	(0,23)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Vente	EUR	2.080.000	20/06/2028	58.729	0,16
							96.637 USD	0,27

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income possédait les contrats sur Swaps sur défaut de crédit en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	230.000	20/12/2027	(8.944)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	640.000	20/12/2027	6.468	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	640.000	20/12/2027	(6.468)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Vente	EUR	555.467	20/06/2028	4.449	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	300.000	20/12/2027	3.472	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	500.000	20/12/2027	5.786	0,01
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Achat	EUR	130.000	20/12/2027	(1.050)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	200.000	20/12/2027	(2.021)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	500.000	20/12/2027	(5.786)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	400.000	20/12/2027	(4.043)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Achat	EUR	70.000	20/12/2027	(1.547)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Achat	EUR	90.000	20/12/2027	(2.387)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Achat	EUR	100.000	20/12/2023	(3.656)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Vente	EUR	40.000	20/12/2026	5.615	0,01
CDS	JPMorgan	SSE plc	Achat	EUR	70.000	20/06/2027	(1.508)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	250.000	20/12/2027	(2.527)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	200.000	20/12/2027	2.021	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	300.000	20/12/2027	3.032	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	300.000	20/12/2027	(3.032)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	650.000	20/12/2027	6.569	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	150.000	20/12/2027	1.516	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	280.000	20/12/2027	2.830	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	340.000	20/12/2027	(3.436)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	300.000	20/12/2027	(3.472)	(0,00)

Annexes aux Comptes

(suite)

10 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR SWAPS

(suite)

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	90.000	20/12/2027	(910)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	200.000	20/06/2028	(5.645)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	230.000	20/12/2027	8.944	0,01
							(5.730) USD	(0,01)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha possédait les contrats sur Swaps de rendement total en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/ Émetteur	À payer/À recevoir	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Panier d'actions d'Amérique du Nord	Paie ment de la performance du panier sous-jacent de 8 actions et réception de US-1M-LIBOR.	USD	1.168.600	20/04/2023	(41.776)	(0,21)
TRS	UBS	Panier d'actions d'Amérique du Nord	Paie ment du US-1M- LIBOR et réception de la performance du panier sous- jacent de 6 actions. Paie ment de la performance du panier sous-jacent de 37 actions et réception de US-1M-LIBOR.	USD	6.499.476	26/06/2023	(221.525)	(1,13)
							(263.301) USD	(1,34)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities possédait les contrats sur Swaps sur défaut de crédit en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	Goldman Sachs	ArcelorMittal	Achat	EUR	7.500.000	20/12/2023	(230.831)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Vente	EUR	3.950.000	20/06/2025	45.883	0,01
CDS	JPMorgan	Société Générale SA	Achat	EUR	19.000.000	20/12/2026	15.073	0,00
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Vente	EUR	4.000.000	20/12/2026	516.847	0,12
CDS	BNP Paribas	Monitchem Holdco 3 S.A.	Achat	EUR	10.000.000	20/06/2027	(670.461)	(0,16)
CDS	BNP Paribas	British Telecommunications plc	Achat	EUR	15.000.000	20/06/2027	(40.054)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Achat	EUR	8.600.000	20/06/2027	70.962	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	BNP Paribas SA	Achat	EUR	6.500.000	20/12/2027	115.867	0,03
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Achat	EUR	19.355.000	20/06/2027	(320.764)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	122.080.000	20/12/2027	(4.369.356)	(1,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	17.840.000	20/12/2027	(59.007)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	126.220.000	20/12/2027	(1.344.489)	(0,31)
CDS	Goldman Sachs	Bayerische Motoren Werke AG	Achat	EUR	10.860.000	20/12/2027	(178.676)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Achat	EUR	10.400.000	20/12/2027	(46.243)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	15.920.000	20/12/2027	488.679	0,11
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Achat	EUR	11.800.000	20/12/2027	123.803	0,03
CDS	Goldman Sachs	ING Groep NV	Achat	EUR	6.170.000	20/12/2027	93.990	0,02
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Achat	EUR	15.370.000	20/12/2027	130.342	0,03
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Achat	EUR	13.390.000	20/12/2027	(99.552)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Achat	EUR	4.430.000	20/12/2027	(53.723)	(0,01)

Annexes aux Comptes

(suite)

10 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR SWAPS

(suite)

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	13.400.000	20/12/2027	(479.598)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	7.260.000	20/12/2027	(222.853)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Achat	EUR	10.000.000	20/12/2027	(203.355)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Achat	EUR	10.000.000	20/12/2027	(244.158)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Vente	EUR	8.400.000	20/06/2027	87.769	0,02
CDS	Goldman Sachs	Faurecia Se	Vente	EUR	3.200.000	20/06/2027	202.512	0,05
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Achat	EUR	9.700.000	20/06/2027	(12.763)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	164.000.000	21/06/2023	287.091	0,07
CDS	Barclays	Swedbank AB	Achat	EUR	18.560.000	20/06/2027	(323.631)	(0,08)
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Achat	USD	17.000.000	20/06/2027	(225.512)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	19.000.000	20/12/2027	(202.387)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	25.000.000	20/12/2027	266.299	0,06
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	10.000.000	20/12/2027	106.520	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	1.000.000	20/12/2027	35.791	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	14.110.000	20/12/2027	131.259	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	119.160.000	20/06/2028	(3.096.778)	(0,72)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	134.480.000	20/12/2027	4.813.164	1,12
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	14.470.000	20/06/2028	(7.734)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	17.840.000	20/12/2027	59.007	0,01
CDS	BNP Paribas	Unicredit SPA	Achat	EUR	2.400.000	20/12/2027	3.109	0,00
							(4.837.958) EUR	(1,11)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities possédait les contrats sur Swaps sur défaut de crédit en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Achat	EUR	60.000	20/06/2023	(104)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Pearson PLC	Achat	EUR	40.000	20/06/2023	(73)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banca Popolare Di Milano	Achat	EUR	30.000	20/06/2023	(159)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Achat	EUR	30.000	20/06/2023	(170)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Achat	EUR	80.000	20/06/2023	(139)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Vente	EUR	350.000	20/06/2025	4.066	0,02
CDS	JPMorgan	Tescp plc	Achat	EUR	60.000	20/06/2023	(104)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Société Générale SA	Achat	EUR	1.000.000	20/12/2026	793	0,00
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Vente	EUR	190.000	20/12/2026	24.550	0,14
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Achat	EUR	1.000.000	20/06/2027	8.251	0,05
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Achat	EUR	797.500	20/06/2027	(13.217)	(0,07)
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Vente	EUR	500.000	20/06/2027	5.224	0,03
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Achat	EUR	30.000	20/06/2023	(170)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Achat	EUR	580.000	20/06/2027	(763)	(0,00)

Annexes aux Comptes

(suite)

10 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR SWAPS

(suite)

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	Barclays	Swedbank AB	Achat	EUR	850.000	20/06/2027	(14.821)	(0,08)
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Achat	USD	1.420.000	20/06/2027	(18.837)	(0,11)
CDS	Citigroup Global Markets	BNP Paribas SA	Achat	EUR	600.000	20/12/2027	10.695	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	2.640.000	20/12/2027	(94.488)	(0,53)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	1.010.000	20/12/2027	(3.341)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Achat	USD	9.650.000	20/12/2027	(102.791)	(0,57)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Achat	EUR	80.000	20/12/2023	(514)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Bayerische Motoren Werke AG	Achat	EUR	480.000	20/12/2027	(7.897)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Achat	EUR	150.000	20/12/2027	(667)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	3.220.000	20/12/2027	98.841	0,55
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Vente	USD	1.150.000	20/12/2027	12.250	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	280.000	20/12/2027	926	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	240.000	20/12/2027	8.590	0,05
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Achat	EUR	720.000	20/12/2027	7.554	0,04
CDS	Goldman Sachs	ING Groep NV	Achat	EUR	560.000	20/12/2027	8.531	0,05
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Achat	EUR	910.000	20/12/2027	7.717	0,04
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Achat	EUR	1.050.000	20/12/2027	(7.807)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Achat	EUR	200.000	20/12/2027	(2.425)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	440.000	20/12/2027	(13.506)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	300.000	20/12/2027	(9.209)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	250.000	20/12/2027	(7.674)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Achat	EUR	480.000	20/12/2027	(9.761)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Achat	EUR	500.000	20/12/2027	(12.208)	(0,07)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	13.000.000	21/06/2023	22.757	0,13
CDS	Barclays	Natural Energy Group SA	Achat	EUR	500.000	20/12/2027	(5.855)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Achat	EUR	30.000	20/06/2023	(159)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Achat	EUR	145.000	20/12/2023	(3.009)	(0,02)
CDS	Barclays	Tesco plc	Achat	EUR	100.000	20/12/2023	(558)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Achat	EUR	260.000	20/12/2023	(1.450)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Achat	EUR	250.000	20/12/2023	(5.188)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	500.000	20/12/2027	5.326	0,03
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	800.000	20/12/2027	8.522	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Achat	EUR	1.550.000	20/12/2027	(14.419)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	270.000	20/12/2027	9.664	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	80.000	20/12/2027	2.863	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	450.000	20/12/2027	4.186	0,02

Annexes aux Comptes

(suite)

10 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR SWAPS

(suite)

Description	Contrepartie	Sous-jacent/Émetteur	Achat/ Vente	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	100.000	20/12/2027	930	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	280.000	20/12/2027	2.605	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	1.000.000	20/12/2027	9.303	0,05
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	800.000	20/12/2027	8.522	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	150.000	20/12/2027	5.369	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSUB 38	Vente	EUR	500.000	20/12/2027	(15.348)	(0,09)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 38	Vente	EUR	130.000	20/12/2027	430	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	230.000	20/12/2027	8.232	0,05
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Vente	USD	900.000	20/12/2027	9.587	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSUB 38	Vente	EUR	130.000	20/12/2027	(3.991)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	1.670.000	20/12/2027	59.771	0,33
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	1.480.000	20/06/2028	(38.463)	(0,22)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Achat	EUR	490.000	20/06/2028	(262)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Vente	EUR	600.000	20/12/2027	1.985	0,01
							(51.507) EUR	(0,26)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha possédait les contrats sur Swaps de rendement total en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/ Émetteur	À payer/À recevoir	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
TRS	Goldman Sachs	Panier d'actions	Paiement de la performance du panier sous-jacent de 4 actions et réception de 1M EURIBOR.	EUR	982.939	du 05/05/2027 au 24/10/2029	(16.183)	(0,02)
TRS	Goldman Sachs	Panier d'actions	Paiement de la performance de l'action sous-jacente et réception de 1M SONIA.	GBP	169.225	18/05/2029	(5.139)	(0,01)
TRS	UBS	Panier d'actions	Paiement de la performance du panier sous-jacent de 9 actions et réception de CHF SARON 1M.	CHF	5.570.292	07/02/2024	(215.043)	(0,28)
TRS	UBS	Panier d'actions	Paiement de la performance du panier sous-jacent de 10 actions et réception de 1M CIBOR.	DKK	73.558.815	07/02/2024	(266.150)	(0,34)
TRS	UBS	Panier d'actions	Paiement de la performance du panier sous-jacent de 34 actions et réception de 1M EURIBOR.	EUR	23.560.734	07/02/2024	(787.916)	(1,01)
TRS	UBS	Panier d'actions	Paiement de la performance du panier sous-jacent de 3 actions et réception de 1M NIBOR.	NOK	33.025.063	07/02/2024	44.968	0,06

Annexes aux Comptes

(suite)

10 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR SWAPS

(suite)

Description	Contrepartie	Sous-jacent/ Émetteur	À payer/À recevoir	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
TRS	UBS	Panier d'actions	Paiement de la performance du panier sous-jacent de 2 actions et réception de 1M SONIA.	GBP	2.046.162	06/12/2024	(93.878)	(0,12)
TRS	UBS	Panier d'actions	Paiement de la performance du panier sous-jacent de 12 actions et réception de 1M STIBOR.	SEK	96.313.710	07/02/2024	(409.070)	(0,52)
							(1.748.411) EUR	(2,24)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha possédait les contrats sur Swaps de rendement total en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/ Émetteur	À payer/À recevoir	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Panier d'actions d'Amérique du Nord	Paiement du US-1M- LIBOR et réception de la performance du panier sous- jacent de 2 actions. Paiement de la performance du panier sous-jacent de 8 actions et réception de US-1M-LIBOR.	USD	5.694.728	20/04/2023	(20.733)	(0,02)
TRS	UBS	Panier d'actions d'Amérique du Nord	Paiement du US-1M- LIBOR et réception de la performance du panier sous- jacent de 6 actions. Paiement de la performance du panier sous-jacent de 36 actions et réception de US-1M-LIBOR.	USD	23.966.928	26/06/2023	(549.776)	(0,62)
							(570.509) USD	(0,64)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha possédait les contrats sur Swaps de rendement total en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/ Émetteur	À payer/À recevoir	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
TRS	UBS	Panier d'actions	Paiement de la performance de l'action sous-jacente et réception de AUD SWAP OIS 1M.	AUD	1.461.675	10/01/2025	(756)	(0,00)
TRS	UBS	Panier d'actions	Paiement du 1M CDOR et réception de la performance de l'action sous-jacente.	CAD	990.444	03/06/2024	(71.338)	(0,09)
TRS	UBS	Panier d'actions	Paiement de CHF SARON 1M et réception de la performance de l'action sous-jacente.	CHF	1.395.765	04/11/2024	93.999	0,12
TRS	UBS	Panier d'actions	Paiement du 1M CIBOR et réception de la performance de l'action sous-jacente.	DKK	5.864.700	10/01/2025	(227.335)	(0,28)

Annexes aux Comptes

(suite)

10 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR SWAPS

(suite)

Description	Contrepartie	Sous-jacent/ Émetteur	À payer/À recevoir	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
TRS	UBS	Panier d'actions	Païement du 1M EURIBOR et réception de la performance de l'action sous-jacente. Païement de la performance du panier sous-jacent de 4 actions et réception de 1M EURIBOR.	EUR	2.357.649	10/01/2025	(9.707)	(0,01)
TRS	UBS	Panier d'actions	Païement de la performance du panier sous-jacent de 2 actions et réception de 1M SONIA.	GBP	1.016.948	10/01/2025	98.828	0,12
TRS	UBS	Panier d'actions	Païement du US 1M LIBOR et réception de la performance de l'action sous-jacente.	IDR	9.688.254.000	29/01/2026	(8.093)	(0,01)
TRS	UBS	Panier d'actions	Païement du 1M-TIBOR et réception de la performance du panier sous-jacent de 2 actions. Païement de la performance de l'action sous-jacente et réception de 1M-TIBOR.	JPY	346.912.800	03/06/2024	35.133	0,04
TRS	UBS	Panier d'actions	Païement du 1M STIBOR et réception de la performance de l'action sous-jacente. Païement de la performance de l'action sous-jacente et réception de 1M STIBOR.	SEK	17.192.546	10/01/2025	(71.957)	(0,09)
TRS	UBS	Panier d'actions	Païement du US 1M LIBOR et réception de la performance du panier sous-jacent de 18 actions. Païement de la performance du panier sous-jacent de 15 actions et réception de US 1M LIBOR.	USD	33.396.322	10/01/2025	1.015.006	1,25
							853.780 USD	1,05

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities possédait les contrats sur Swaps de rendement total en cours suivants :

Description	Contrepartie	Sous-jacent/ Émetteur	À payer/À recevoir	Devise	Montant du notionnel	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
TRS	Goldman Sachs	Panier de matières premières d'Amérique du Nord	Païement de 0,11 % et réception de la performance du panier sous-jacent de 2 indices.	USD	86.609.236	14/04/2023	1.086.000	0,54
TRS	JPMorgan	Panier de matières premières d'Amérique du Nord	Païement de 0 % à 0,58 % et réception de la performance du panier sous-jacent de 33 indices. Païement de la performance du panier sous-jacent de 17 indices et réception de 0 %.	USD	612.097.514	03/04/2023 au 14/04/2023	523.994	0,26
TRS	Macquarie	Panier de matières premières d'Amérique du Nord	Païement de 0,17 % et réception de la performance du panier sous-jacent de 2 indices.	USD	47.581.150	14/04/2023	532.045	0,27
							2.142.039 USD	1,07

Annexes aux Comptes

(suite)

11 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Au 31 mars 2023, la contrepartie des contrats à terme standardisés en cours est UBS.

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond possédait les contrats à terme standardisés en cours suivants :

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
Euro-Bobl Future	Ventes	(88)	EUR	(9.473.469)	08/06/2023	(237.215)	(0,03)
Euro-OAT Future	Ventes	(58)	EUR	(5.866.675)	08/06/2023	(294.276)	(0,04)
Euro-Bund Future	Ventes	(111)	EUR	(11.439.851)	08/06/2023	(365.961)	(0,04)
Japan 10Y Bond	Ventes	(13)	JPY	(9.669.461)	13/06/2023	(290.104)	(0,03)
Australian 10Y Treasury Bond Future	Achats	15	AUD	1.234.548	15/06/2023	37.600	0,00
Canada 10Y Bond Future	Achats	95	CAD	6.315.831	21/06/2023	358.415	0,04
Ultra 10Y US Treasury Note	Ventes	(178)	USD	(18.656.625)	21/06/2023	(182.134)	(0,02)
US Treasury Note	Achats	4	USD	443.250	21/06/2023	20.375	0,00
Ultra US Treasury Bond Future	Ventes	(10)	USD	(930.156)	21/06/2023	(10.000)	(0,00)
Long Gilt Future	Ventes	(176)	GBP	(23.088.538)	28/06/2023	(212.777)	(0,03)
5Y US Treasury Note	Achats	293	USD	29.782.992	30/06/2023	430.718	0,06
2Y US Treasury Note	Achats	16	USD	3.186.125	30/06/2023	36.250	0,00
						(709.109) USD	(0,09)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond possédait les contrats à terme standardisés en cours suivants :

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
Euro-Bund Future	Ventes	(1)	EUR	(94.861)	08/06/2023	(4.340)	(0,01)
Euro-Buxl Future	Ventes	(4)	EUR	(316.472)	08/06/2023	(38.080)	(0,05)
Euro-Bobl Future	Achats	31	EUR	3.071.697	08/06/2023	79.290	0,11
Ultra 10Y US Treasury Note	Ventes	(16)	USD	(1.543.559)	21/06/2023	(57.642)	(0,07)
US Treasury Note	Ventes	(3)	USD	(305.985)	21/06/2023	(14.124)	(0,02)
10Y US Treasury Note	Ventes	(12)	USD	(1.121.773)	21/06/2023	(34.516)	(0,04)
Long Gilt Future	Ventes	(10)	GBP	(1.207.463)	28/06/2023	(23.698)	(0,03)
5Y US Treasury Note	Ventes	(6)	USD	(561.361)	30/06/2023	(12.164)	(0,02)
						(105.274) EUR	(0,13)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond possédait les contrats à terme standardisés en cours suivants :

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
10Y US Treasury Note	Ventes	(26)	USD	(2.430.508)	21/06/2023	(80.768)	(0,02)
						(80.768) EUR	(0,02)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European Social Bond possédait les contrats à terme standardisés en cours suivants :

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
Long-Term Euro-BTP Future	Ventes	(4)	EUR	(410.020)	08/06/2023	(18.400)	(0,01)

Annexes aux Comptes

(suite)

11 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

(suite)

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
Euro-Bund Future	Ventes	(6)	EUR	(569.166)	08/06/2023	(30.900)	(0,01)
Short-Term Euro-BTP Future	Ventes	(1)	EUR	(96.961)	08/06/2023	(1.270)	(0,00)
Euro-Bobl Future	Ventes	(153)	EUR	(15.160.311)	08/06/2023	(317.520)	(0,08)
10Y US Treasury Note	Ventes	(35)	USD	(3.271.837)	21/06/2023	(100.672)	(0,03)
Long Gilt Future	Ventes	(74)	GBP	(8.935.229)	28/06/2023	(197.222)	(0,06)
5Y US Treasury Note	Ventes	(14)	USD	(1.309.842)	30/06/2023	(28.382)	(0,01)
2Y US Treasury Note	Ventes	(3)	USD	(549.863)	30/06/2023	(6.256)	(0,00)
						(700.622) EUR	(0,20)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond possédait les contrats à terme standardisés en cours suivants :

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
Euro-Buxl Future	Ventes	(29)	EUR	(2.294.422)	08/06/2023	(279.560)	(0,21)
Euro-Bund Future	Achats	82	EUR	7.778.602	08/06/2023	351.772	0,26
Euro-Schatz Future	Ventes	(4)	EUR	(398.184)	08/06/2023	(4.200)	(0,00)
Euro-Bobl Future	Ventes	(273)	EUR	(27.050.751)	08/06/2023	(552.660)	(0,41)
Japan 10Y Bond	Ventes	(14)	JPY	(9.584.671)	13/06/2023	(286.592)	(0,21)
10Y US Treasury Note	Achats	19	USD	1.776.140	21/06/2023	7.924	0,01
US Treasury Note	Ventes	(15)	USD	(1.529.925)	21/06/2023	(72.052)	(0,05)
Ultra US Treasury Bond Future	Ventes	(37)	USD	(3.167.728)	21/06/2023	(171.344)	(0,13)
Ultra 10Y US Treasury Note	Achats	27	USD	2.604.756	21/06/2023	95.437	0,07
Long Gilt Future	Ventes	(15)	GBP	(1.811.195)	28/06/2023	17.061	0,01
5Y US Treasury Note	Ventes	(46)	USD	(4.303.767)	30/06/2023	(136.612)	(0,10)
						(1.030.826) EUR	(0,76)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds possédait les contrats à terme standardisés en cours suivants :

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
10Y US Treasury Note	Ventes	(41)	USD	(4.164.063)	21/06/2023	(131.328)	(0,22)
5Y US Treasury Note	Achats	79	USD	8.030.227	30/06/2023	175.281	0,29
						43.953 USD	0,07

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return possédait les contrats à terme standardisés en cours suivants :

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
Topix Index Future	Achats	11	JPY	1.655.909	08/06/2023	23.803	0,07
E-Mini RUSs 1000 V	Achats	5	USD	378.050	16/06/2023	11.410	0,03
FTSE 100 Index Future	Achats	24	GBP	2.266.858	16/06/2023	25.294	0,07
MSCI Emerging Markets Index	Achats	9	USD	447.975	16/06/2023	16.900	0,05

Annexes aux Comptes

(suite)

11 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

(suite)

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
E-mini S&P 500 Future	Ventes	(25)	USD	(5.172.188)	16/06/2023	(306.873)	(0,86)
Euro Stoxx 50 PR	Ventes	(37)	EUR	(1.712.864)	16/06/2023	(85.221)	(0,24)
						(314.687) USD	(0,88)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income possédait les contrats à terme standardisés en cours suivants :

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
Euro-OAT Future	Ventes	(1)	EUR	(101.150)	08/06/2023	(5.074)	(0,00)
Euro-Bobl Future	Ventes	(8)	EUR	(861.224)	08/06/2023	(16.612)	(0,02)
Euro-Bund Future	Ventes	(2)	EUR	(206.123)	08/06/2023	(11.190)	(0,01)
FTSE 100 Index Future	Achats	8	GBP	755.619	16/06/2023	10.769	0,01
Euro Stoxx 50 PR	Achats	32	EUR	1.481.396	16/06/2023	36.309	0,02
E-mini S&P 500 Future	Achats	51	USD	10.551.263	16/06/2023	323.459	0,29
Canada 10Y Bond Future	Achats	2	CAD	132.965	21/06/2023	7.546	0,01
10Y US Treasury Note	Achats	2	USD	203.125	21/06/2023	6.234	0,01
US Treasury Note	Ventes	(1)	USD	(110.813)	21/06/2023	(5.219)	(0,00)
Ultra 10Y US Treasury Note	Achats	1	USD	104.813	21/06/2023	297	0,00
Long Gilt Future	Ventes	(3)	GBP	(393.555)	28/06/2023	(2.389)	(0,00)
5Y US Treasury Note	Achats	8	USD	813.188	30/06/2023	17.750	0,02
2Y US Treasury Note	Achats	2	USD	398.266	30/06/2023	4.531	0,00
						366.411 USD	0,33

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha possédait les contrats à terme standardisés en cours suivants :

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
E-mini S&P 500 Future	Ventes	(50)	USD	(10.344.375)	16/06/2023	(613.670)	(3,12)
						(613.670) USD	(3,12)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities possédait les contrats à terme standardisés en cours suivants :

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
Euro-OAT Future	Ventes	(187)	EUR	(17.409.887)	08/06/2023	(873.290)	(0,20)
Euro-Buxl Future	Ventes	(37)	EUR	(2.927.366)	08/06/2023	(352.240)	(0,08)
Euro-Bund Future	Ventes	(170)	EUR	(16.126.370)	08/06/2023	(873.400)	(0,20)
Euro-Bobl Future	Ventes	(833)	EUR	(82.539.471)	08/06/2023	(2.290.749)	(0,54)
Japan 10Y Bond	Ventes	(31)	JPY	(21.223.200)	13/06/2023	(636.741)	(0,15)
10Y US Treasury Note	Ventes	(41)	USD	(3.832.724)	21/06/2023	(117.930)	(0,03)
US Treasury Note	Ventes	(13)	USD	(1.325.935)	21/06/2023	(61.206)	(0,01)
Ultra US Treasury Bond Future	Ventes	(15)	USD	(1.284.214)	21/06/2023	3.794	0,00

Annexes aux Comptes

(suite)

11 PLUS-VALUE/(MOINS-VALUE) NETTE LATENTE SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

(suite)

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
Ultra 10Y US Treasury Note	Ventes	(37)	USD	(3.569.481)	21/06/2023	(133.296)	(0,03)
Long Gilt Future	Ventes	(260)	GBP	(31.394.049)	28/06/2023	(669.492)	(0,16)
5Y US Treasury Note	Achats	205	USD	19.179.833	30/06/2023	418.651	0,10
						(5.585.899) EUR	(1,30)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund possédait les contrats à terme standardisés en cours suivants :

Description	Statut	Nombre de contrats	Devise	Engagements notionnels dans la devise de référence du portefeuille	Date d'échéance	Plus-value/(moins-value) latente dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
Euro-Buxl Future	Ventes	(2)	EUR	(158.236)	08/06/2023	(19.040)	(0,11)
Euro-Bund Future	Ventes	(14)	EUR	(1.328.054)	08/06/2023	(71.890)	(0,39)
Euro-OAT Future	Ventes	(10)	EUR	(931.010)	08/06/2023	(46.700)	(0,26)
Euro-Schatz Future	Ventes	(2)	EUR	(199.092)	08/06/2023	(2.060)	(0,01)
Euro-Bobl Future	Ventes	(24)	EUR	(2.378.088)	08/06/2023	(65.770)	(0,37)
Japan 10Y Bond	Ventes	(2)	JPY	(1.369.239)	13/06/2023	(41.080)	(0,23)
10Y US Treasury Note	Achats	2	USD	186.962	21/06/2023	5.738	0,03
Ultra US Treasury Bond Future	Ventes	(1)	USD	(85.614)	21/06/2023	1.409	0,01
Ultra 10Y US Treasury Note	Ventes	(8)	USD	(771.780)	21/06/2023	(28.821)	(0,16)
Long Gilt Future	Ventes	(11)	GBP	(1.328.210)	28/06/2023	(22.798)	(0,13)
5Y US Treasury Note	Achats	3	USD	280.680	30/06/2023	6.127	0,03
						(284.885) EUR	(1,59)

12 OPTIONS À LA VALEUR DE MARCHÉ

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income détenait les Options en cours suivantes :

Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Devise	Contrats	Date d'échéance	Engagement dans la devise de référence du portefeuille	Valeur de marché dans la devise de référence du portefeuille	% de l'Actif net
Options sur contrats à terme standardisés								
Call S&P 500 Index	UBS	4.100,000	USD	(50)	14/04/2023	20.500.000*	(295.500)	(0,27)
Call DJ Euro Stoxx 50	UBS	4.250,000	EUR	(52)	21/04/2023	2.401.055*	(62.371)	(0,06)
Call FTSE 100 Index	UBS	7.625,000	GBP	(16)	21/04/2023	1.508.469*	(19.190)	(0,02)
							(377.061) USD	(0,35)

*L'engagement sur les positions achetées à découvert est illimité.

13 POOLING

La SICAV peut investir et gérer tout ou partie des actifs de deux ou plusieurs Portefeuilles (« Portefeuilles participants ») en regroupant ces actifs dans une masse d'actifs (« pool »). Ce pool est constitué par le regroupement de liquidités ou d'autres actifs (à condition que ces actifs soient conformes à la politique d'investissement du pool concerné) provenant de chacun des Portefeuilles participants.

La part d'un Portefeuille participant dans un pool d'actifs est mesurée par référence à des unités notionnelles d'égale valeur dans le pool d'actifs.

Au 31 mars 2023, la SICAV ne comptait aucun pool d'actifs, toutefois, à des fins de gestion d'investissement, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return est séparé en classe d'actifs dans plusieurs paniers qu'il détient exclusivement.

Annexes aux Comptes

(suite)

14 MODIFICATIONS DE LA COMPOSITION DES ÉTATS FINANCIERS DU PORTEFEUILLE

Les modifications des États financiers du portefeuille sont disponibles gratuitement sur demande des Actionnaires au siège social de la SICAV.

15 AJUSTEMENT DE DILUTION

Les Portefeuilles peuvent subir une réduction de la Valeur nette d'inventaire par action du fait des écarts de négociation, coûts de transaction et charges d'impôt découlant de l'achat et la vente d'investissements sous-jacents entrepris par le Conseiller par délégation pour gérer les entrées et sorties de capitaux. C'est ce que l'on appelle la « dilution ». Un ajustement de dilution pourra être appliqué pour protéger les Actionnaires des Portefeuilles en tenant compte de l'impact sur la dilution (l'« Ajustement de dilution »). Si les mouvements de capitaux (incluant les souscriptions, rachats et conversions dans un Portefeuille donné) à une Date d'évaluation donnée, dépassent parfois le seuil fixé par la Société de Gestion pour ce Portefeuille, la Valeur nette d'inventaire pour le Portefeuille concerné pourra être ajustée à la hausse ou à la baisse afin de suivre respectivement les entrées et sorties de trésorerie.

La Valeur nette d'inventaire par action de chaque Classe d'actions du Portefeuille sera calculée séparément, néanmoins tout Ajustement de dilution aura le même effet sur la Valeur nette d'inventaire de chaque Classe d'actions du Portefeuille. Le montant de l'Ajustement de dilution sera fixé par la Société de gestion afin de refléter les écarts de négociation estimés, les coûts de transaction et charges d'impôt supportés par le Portefeuille ; ces coûts peuvent varier en fonction des conditions de marché et de la composition du Portefeuille. L'Ajustement de dilution pourra être modifié à certains moments. Ces Ajustements de dilution pourront varier d'un Portefeuille à l'autre, et du fait des entrées et sorties de trésorerie journalières, mais ne pourront pas dépasser 2 % de la Valeur nette d'inventaire par action originelle. Une revue périodique est effectuée afin de vérifier l'exactitude des Ajustements de dilution effectués. Dans le cours normal des affaires, l'Ajustement de dilution sera effectué de manière mécanique et constante. Cependant, la Société de gestion a le droit de procéder de manière discrétionnaire à un Ajustement de Dilution, si elle estime que c'est dans l'intérêt des Actionnaires existants, et ce également dans des circonstances exceptionnelles. Ces circonstances exceptionnelles comprennent, sans s'y limiter, les périodes de forte volatilité des marchés et les périodes de liquidité tenue sur les marchés.

L'Ajustement de dilution peut s'appliquer à tous les Portefeuilles, à l'exception du Portefeuille Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities.

Les estimations du montant de l'Ajustement de dilution fondées sur les valeurs mobilières détenues par chaque Portefeuille et sur les conditions du marché lors de l'émission du Prospectus de janvier 2023 sont publiées sur le site Internet www.columbiathreadneedle.com.

Au 31 mars 2023, l'Ajustement de dilution suivant a été appliqué :

Portefeuille	VNI avant dilution	Ajustement de dilution	VNI après dilution
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	19.637.404	(7.855)	19.629.549
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	431.287.517	(2.673.983)	428.613.534

16 COÛTS DE TRANSACTION

Au cours de l'exercice considéré, la SICAV a assumé des coûts de transaction relatifs à l'achat ou à la vente de valeurs mobilières ou d'instruments du marché monétaire comme suit :

Portefeuilles	Devise	Coûts de transaction
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond ¹	USD	s.o.
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond ¹	EUR	s.o.
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond ¹	EUR	s.o.
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond ¹	EUR	s.o.
Threadneedle (Lux) - European Social Bond ¹	EUR	s.o.
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond ¹	EUR	s.o.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds ¹	USD	s.o.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt ¹	USD	s.o.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds ¹	USD	s.o.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond ¹	USD	s.o.
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond ¹	USD	s.o.
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	EUR	3.807
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	USD	20.544
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	USD	60.526
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	USD	7.762
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	2.545.294
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	694.259
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	USD	92.787
Threadneedle (Lux) - Global Select	USD	442.969
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	1.170.113
Threadneedle (Lux) - American	USD	274.225

Annexes aux Comptes

(suite)

16 COÛTS DE TRANSACTION

(suite)

Portefeuilles	Devise	Coûts de transaction
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	94.992
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	USD	251.532
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	160.090
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	USD	279.173
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	92.563
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	USD	21.104
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	EUR	1.063.670
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	EUR	140.826
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	190.056
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	408.921
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	803.151
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	EUR	440.474
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	82.870
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	125.990
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	504.823
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	308.630
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity ²	USD	s.o.
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	23.713
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities ¹	EUR	s.o.
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities ¹	EUR	s.o.
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	EUR	322.208
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	USD	43.830
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	USD	76.183
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	2.726

Les coûts de transaction sont inclus dans le coût total des investissements repris dans l'État du portefeuille. Le montant des coûts de transaction supportés par la SICAV au cours de l'exercice considéré est inclus dans l'État des opérations et de la variation de l'actif net aux postes « Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur ventes d'investissements » et « Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur investissements ».

¹ Dans le cas des titres à revenu fixe, les coûts de transaction ne sont pas identifiables séparément du prix d'achat du titre et, par conséquent, ils ne peuvent pas être indiqués séparément.

² Voir annexe 1.

17 INFORMATIONS RELATIVES À LA GARANTIE

Le tableau ci-dessous présente les montants de la garantie en espèces reçus et payés par les Portefeuilles au 31 mars 2023 :

Portefeuilles	Contrepartie	Type d'investissement	Devise	Garantie en espèces
Garantie reçue par le Portefeuille				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Contrats à terme et swaps	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPMorgan	Contrats à terme et swaps	USD	12.930.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	JPM Securities	Contrats à terme et swaps	EUR	70.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	NatWest Markets	Contrats à terme	EUR	60.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPMorgan	Contrats à terme	EUR	210.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	HSBC	Contrats à terme	EUR	340.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Citigroup Global Markets	Contrats à terme et swaps	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPMorgan	Contrats à terme	USD	430.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPMorgan	Contrats à terme	USD	410.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPMorgan	Contrats à terme	USD	550.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPMorgan	Contrats à terme	USD	270.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	JPMorgan	Contrats à terme	USD	160.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Lloyds	Contrats à terme	USD	20.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPMorgan	Contrats à terme et swaps	USD	900.000

Annexes aux Comptes

(suite)

17 INFORMATIONS RELATIVES À LA GARANTIE

(suite)

Portefeuilles	Contrepartie	Type d'investissement	Devise	Garantie en espèces
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Securities	Contrats à terme et swaps	USD	230.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPMorgan	Contrats à terme	USD	2.600.000
Threadneedle (Lux) - American	JPMorgan	Contrats à terme	USD	2.800.000
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	JPMorgan	Contrats à terme	USD	960.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPMorgan	Contrats à terme	USD	1.050.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPMorgan	Contrats à terme	USD	610.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPMorgan	Contrats à terme	USD	210.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Contrats à terme et swaps	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Goldman Sachs	Contrats à terme et swaps	EUR	410.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Securities	Contrats à terme et swaps	EUR	1.230.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Goldman Sachs	Swaps	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	UBS	Swaps	EUR	530.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	50.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	830.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	1.920.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPMorgan	Contrats à terme et swaps	USD	2.750.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	1.070.000
Garantie payée par le Portefeuille				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Contrats à terme et swaps	USD	7.640.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	JPM Securities	Contrats à terme	EUR	260.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Securities	Contrats à terme	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	JPMorgan	Contrats à terme	EUR	330.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Goldman Sachs	Swaps	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	HSBC	Contrats à terme	EUR	250.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Lloyds	Contrats à terme	USD	840.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	JPMorgan	Contrats à terme	EUR	540.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPMorgan	Contrats à terme	EUR	370.000
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	JPMorgan	Contrats à terme	EUR	150.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPMorgan	Contrats à terme	GBP	20.000
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	JPMorgan	Contrats à terme	GBP	110.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	UBS	Swaps	USD	170.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Barclays	Contrats à terme et swaps	EUR	670.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	BNP Paribas	Swaps	EUR	660.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Securities	Contrats à terme et swaps	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	450.000

18 INVESTISSEMENTS CROISÉS DANS LES PORTEFEUILLES

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return investit en actions des Portefeuilles suivants :

Portefeuille concerné par l'investissement croisé	Devise	Valeur de marché	% de l'Actif net dans la Devise de référence du Portefeuille concerné par l'investissement croisé
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	EUR	25.696	0,01
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	EUR	32.524	0,04
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	2.395	0,00
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	EUR	38.923	0,06
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	EUR	4.730	0,01
Threadneedle (Lux) - Global Focus	EUR	55.027	0,00
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	EUR	32.503	0,18
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	8.712	0,00

Annexes aux Comptes

(suite)

18 INVESTISSEMENTS CROISÉS DANS LES PORTEFEUILLES

(suite)

Au 31 mars 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return investit en actions des Portefeuilles suivants :

Portefeuille concerné par l'investissement croisé	Devise	Valeur de marché	% de l'Actif net dans la Devise de référence du Portefeuille concerné par l'investissement croisé
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	1.885.062	0,95

L'impact des opérations d'investissement croisé a été éliminé de l'État de l'actif net et de l'État de la variation de l'actif net consolidés.

Veuillez également vous référer à l'annexe 2 xi) pour plus d'informations concernant les réductions sur les commissions de gestion.

19 DÉPÔTS À TERME

Le tableau ci-dessous présente les montants des dépôts à terme détenus par la SICAV au 31 mars 2023 :

Portefeuilles	Contrepartie	Devise	Montant du dépôt à terme (dans la devise de référence du portefeuille)
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Sumitomo Bank Ltd London	USD	1.817.561
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	1.829.249
	Total	USD	3.646.810
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Rabobank Nederland	USD	642.605
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	768.696
	Total	USD	1.411.301
Threadneedle (Lux) - American Select	Mitsubishi UFJ Securities	USD	5.001.325
	Total	USD	5.001.325
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Mitsubishi UFJ Securities	USD	2.337.322
	ANZ Banking Group Ltd	USD	2.577.998
	Total	USD	4.915.320

20 AUTRES ACTIFS

Les autres actifs peuvent comprendre tout ajustement de la juste valeur appliqué lorsque certains marchés ont été clôturés en fin d'exercice afin d'éviter le « market timing », selon la procédure de fixation des prix en place au niveau du fonds.

Les autres actifs peuvent également comprendre toute retenue à la source et/ou tout impôt étranger.

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

Le Ratio du coût total est calculé selon les directives de la Asset Management Association Switzerland (AMAS).

La formule utilisée est la suivante :

Le TER exprime la somme calculée a posteriori de tous les frais et commissions facturés de façon régulière à chaque classe d'actions (Charges d'exploitation), en pourcentage de son actif net. Ce calcul est généralement effectué en utilisant la formule suivante :

$$\text{TER \%} = \frac{\text{Total des Charges d'exploitation}}{\text{Actif net moyen}} \times 100$$

Lorsqu'un fonds investit plus de 10 % dans d'autres organismes de placement collectif (des fonds cibles), le calcul inclut la part du fonds dans les dépenses des fonds cibles minorée de tout rabais reçu.

Les Ratios du coût total pour l'exercice clos le 31 mars 2023 sont les suivants :

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	0,80 %	
	AEH	0,80 %	
	AKH	0,71 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ANH	0,73 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	AU	0,80 %	
	AUP	0,80 %	
	DEC	1,55 %	
	DEH	1,55 %	
	DU	1,55 %	
	DUP	1,55 %	
	IEC	0,50 %	
	IEH	0,55 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	IEP	0,50 %	
	IGC	0,58 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	IGH	0,56 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	IKH	0,56 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	INH	0,50 %	
	IU	0,60 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	IUP	0,57 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	NEC	0,40 %	
	NEH	0,40 %	
NGC	0,40 %		
NGH	0,40 %		
NU	0,40 %		
NUP	0,40 %		
XEH	0,10 %		
XFH	0,10 %		
XGH	0,10 %		
XU	0,10 %		
ZEH	0,55 %		
ZFH	0,55 %		

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (suite)	ZGH	0,55 %	
	ZU	0,55 %	
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	AE	0,93 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	ANH	0,87 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	IE	0,55 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	IEP	0,50 %	
	INH	0,50 %	
	XE	0,10 %	
	XFH	0,10 %	
	XGH	0,10 %	
	XUH	0,10 %	
	ZE	0,55 %	
	ZFH	0,62 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	1E	1,19 %	
	1G	1,19 %	
	2E	0,58 %	
	2G	0,51 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	3G	0,69 %	
4E	0,08 %		
4G	0,08 %		
8E	0,62 %		
8G	0,62 %		
9G	0,60 %		
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	AE	1,50 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AKH	1,39 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	ANH	1,45 %	
	IE	0,71 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	IEP	0,71 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	IKH	0,65 %	
	INH	0,65 %	
	XE	0,10 %	
	ZE	0,80 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	ZEP	0,85 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	1E	1,38 %	
	1EP	1,38 %	
	1G	1,38 %	
1GP	1,38 %		
1UT	1,38 %		

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond (suite)	2E	0,82 %	
	2EP	0,82 %	
	2FH	0,82 %	
	2G	0,82 %	
	2GP	0,74 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	3E	0,77 %	
	3EP	0,77 %	
	3FC	0,77 %	
	3FH	0,77 %	
	3G	0,77 %	
	3GP	0,77 %	
	4E	0,07 %	
	4G	0,07 %	
	8E	0,86 %	
	8EP	0,86 %	
	8FH	0,86 %	
	8G	0,86 %	
	8GP	0,86 %	
	9E	0,70 %	
	9EP	0,70 %	
	9FC	0,59 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	9FH	0,70 %	
	9G	0,62 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	9GP	0,62 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	AE	0,90 %	
	AEP	0,90 %	
	AKH	0,90 %	
	ANH	0,90 %	
	IE	0,50 %	
	IEP	0,50 %	
	IGC	0,50 %	
	IGH	0,50 %	
	IKH	0,50 %	
	INH	0,50 %	
	XE	0,10 %	
	XGC	0,10 %	
	XGH	0,10 %	
	ZE	0,55 %	
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	AE	0,55 %	
	AEP	0,55 %	
	AFH	0,55 %	
	AKH	0,55 %	
	ANH	0,55 %	
	ASC	0,60 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ASH	0,55 %	
	AUC	0,55 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - European Social Bond (suite)	AUH	0,50 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ID	0,40 %	
	IE	0,40 %	
	IEP	0,40 %	
	IFH	0,40 %	
	IGH	0,46 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	IKH	0,51 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	INH	0,49 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ISC	0,27 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ISH	0,40 %	
	IUC	0,40 %	
	IUH	0,40 %	
	LE	0,40 %	
	NEP	0,40 %	
	ZD	0,45 %	
	ZE	0,45 %	
	ZEP	0,45 %	
	ZFH	0,45 %	
	ZGC	0,45 %	
	ZGH	0,45 %	
	ZUH	0,45 %	
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	1,10 %	
	AEP	1,10 %	
	AKH	1,10 %	
	ANH	1,10 %	
	AUH	1,10 %	
	DE	1,65 %	
	DEP	1,65 %	
	DUH	1,65 %	
	IE	0,50 %	
	INH	0,50 %	
	ZE	0,62 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	AKH	1,61 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	ANH	1,55 %	
	ASH	1,55 %	
	AU	1,60 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	AUP	1,55 %	
	DEC	1,65 %	
	DEH	1,65 %	
	DU	1,65 %	
	IEC	0,75 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds (suite)	IEH	0,75 %	
	IU	0,75 %	
	W	1,20 %	
	WEH	1,20 %	
	ZU	0,65 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	XUP	0,10 %	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	AKH	1,50 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ANH	1,55 %	
	ASH	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUP	1,55 %	
	DEH	1,65 %	
	DU	1,65 %	
	IEH	0,75 %	
	IU	0,67 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	SU	1,70 %	
	SUP	1,75 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	W	1,20 %	
	XUP	0,10 %	
	ZU	0,68 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AEC	1,50 %	
	AEH	1,50 %	
	AKH	1,50 %	
	ANH	1,50 %	
	ASC	1,50 %	
	ASH	1,50 %	
	AU	1,56 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	AUP	1,50 %	
	DEH	1,65 %	
	DU	1,65 %	
	IE	0,75 %	
	IEH	0,75 %	
	XU	0,10 %	
	XUP	0,10 %	
	ZEH	0,80 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	ZU	0,66 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	AEC	1,50 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	AEH	1,45 %	
	AKH	1,45 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (suite)	ANH	1,45 %	
	ASH	1,51 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	AU	1,45 %	
	AUP	1,45 %	
	DEC	1,71 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	DEH	1,70 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	DU	1,65 %	
	IEC	0,58 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	IEH	0,65 %	
	IKH	0,57 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	INH	0,57 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ISC	0,65 %	
	IU	0,65 %	
	TEH	0,65 %	
	XUP	0,10 %	
	ZFH	0,69 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZGH	0,70 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZU	0,75 %	
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	AEH	1,10 %	
	AKH	1,10 %	
	AS	1,10 %	
	ASC	1,10 %	
	ASH	1,10 %	
	AU	1,10 %	
	AUP	1,10 %	
	AVC	0,93 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	AVH	1,10 %	
	DEH	1,40 %	
	IEH	0,50 %	
	IGH	0,50 %	
	ISH	0,50 %	
	IU	0,50 %	
	XU	0,10 %	
	ZU	0,55 %	
	ZUP	0,55 %	
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	AE	1,63 %	Le TER courant inclut le coût synthétique de la détention des investissements sous-jacents qui, au cours de la période considérée, équivaut à 8 pb annualisés.
	DE	2,38 %	Le TER courant inclut le coût synthétique de la détention des investissements sous-jacents qui, au cours de la période considérée, équivaut à 8 pb annualisés.

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AEC	1,65 %	
	AEH	1,65 %	
	AKH	1,80 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AU	1,65 %	
	AUP	1,65 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IEH	0,95 %	
	IGH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	W	1,75 %	
ZU	1,14 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.	
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	AE	1,55 %	
	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	AEP	1,55 %	
	AS	1,72 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ASC	1,55 %	
	ASH	1,55 %	
	ASP	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUM	1,55 %	
	AUP	1,55 %	
	DEC	2,30 %	
	DEH	2,30 %	
	DEP	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	DUP	2,30 %	
	ZE	1,12 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZEC	1,22 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,16 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
ZU	1,05 %		
ZUP	1,18 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	AE	1,79 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AEC	1,65 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AEH	1,75 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	AU	1,75 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AUP	1,64 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	IE	0,75 %	
	IEH	0,70 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities (suite)	IG	0,75 %	
	IU	0,68 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	LE	0,45 %	
	LG	0,40 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	XU	0,10 %	
	ZE	0,90 %	
	ZEC	0,97 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZEH	0,97 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZU	0,95 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.
	ZUP	0,98 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
Threadneedle (Lux) - Global Focus	AEH	1,70 %	
	AEP	1,70 %	
	ASH	1,64 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	AU	1,70 %	
	AUP	1,70 %	
	DEH	2,45 %	
	DU	2,45 %	
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	IU	0,85 %	
	IUP	0,85 %	
	W	1,72 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	XU	0,10 %	
	ZE	0,95 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	ZEH	0,90 %	
	ZEP	0,95 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	ZFH	1,09 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	ZG	0,95 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	ZU	0,98 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	AEH	1,70 %	
	AU	1,70 %	
	DEH	2,50 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	DU	2,50 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities (suite)	IU	0,90 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	XU	0,10 %	
	ZU	0,95 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	1E	1,71 %	
	1U	1,71 %	
	2E	1,10 %	
	2U	1,10 %	
	8E	1,23 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.
	8U	1,14 %	
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	AEC	1,80 %
AUP		1,90 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
DEC		2,39 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
DUP		2,30 %	
IU		0,95 %	
TE		0,98 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
ZU		1,12 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
1E		1,68 %	
1EP		1,68 %	
1SC		1,68 %	
1SH		1,68 %	
1ST		1,68 %	
1U		1,68 %	
1UP		1,68 %	
1VT		1,68 %	
2E		1,07 %	
2EP		1,07 %	
2U		1,07 %	
2UP		1,02 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
3E		0,93 %	
3EP		0,93 %	
3U		0,93 %	
3UP		0,93 %	
8E		1,11 %	
8EP		1,11 %	
8U		1,11 %	
8UP		1,11 %	
9E	0,95 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.	
9EP	0,89 %		
9U	0,84 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.	
9UP	0,89 %		
Threadneedle (Lux) - Global Select	IU	0,85 %	
	ZU	0,95 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Global Select (suite)	1E	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	2E	1,07 %	
	2U	1,07 %	
	3U	0,90 %	
	8E	1,11 %	
	8U	1,11 %	
	9U	0,85 %	
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	AE	1,80 %
AEP		1,80 %	
AK		1,80 %	
AUP		1,80 %	
DE		2,30 %	
IE		0,95 %	
IEP		0,95 %	
NE		0,75 %	
XE		0,15 %	
XFH		0,07 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
XG		0,08 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
XGH		0,08 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
XU		0,15 %	
ZE		1,05 %	
ZFH		1,05 %	
ZG	1,05 %		
ZGH	1,05 %		
ZU	1,05 %		
Threadneedle (Lux) - American	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,15 %	
	DU	2,15 %	
	IEH	0,90 %	
	IU	0,90 %	
	W	1,50 %	
	ZE	1,00 %	
	ZEH	1,00 %	
	ZU	1,12 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	1E	1,67 %	
	1EH	1,67 %	
	1EP	1,67 %	
	1U	1,67 %	
	2E	1,06 %	
	2U	1,06 %	
	3EH	0,88 %	
3U	0,88 %		
8E	1,10 %		
8U	1,10 %		
9EH	0,84 %		
9U	0,84 %		

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - American Select	AD	1,85 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AEH	1,80 %	
	AN	1,85 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AU	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	ID	0,93 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	IE	0,93 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	IEH	1,00 %	
	IN	0,93 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	W	1,75 %	
	ZEH	1,17 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZU	1,10 %	
	1E	1,67 %	
	1EH	1,67 %	
	1EP	1,67 %	
	1U	1,67 %	
	2EH	1,06 %	
	2U	1,06 %	
	3E	0,87 %	
3U	0,87 %		
8EH	1,10 %		
8U	1,10 %		
9E	0,83 %		
9U	0,83 %		
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	AEH	1,80 %	
	ASH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IE	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,68 %	
	1EP	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	2U	1,07 %	
	3EH	0,93 %	
	3U	0,93 %	
8U	1,11 %		
9EH	0,84 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.	
9U	0,89 %		
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	AE	1,80 %	
	AF	1,91 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AS	1,80 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity (suite)	ASH	1,80 %	
	AU	1,91 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.
	DE	2,55 %	
	IF	0,80 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ISH	0,78 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	IU	0,95 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZE	1,11 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZEH	1,05 %	
	ZF	1,12 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZG	1,11 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZU	1,05 %	
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	AE	1,94 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AEH	1,71 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	DE	2,44 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	DEH	2,22 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	IE	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,70 %	
	1U	1,70 %	
	2E	1,09 %	
	2U	1,09 %	
	3U	0,95 %	
	8E	1,13 %	
	8U	1,13 %	
	9U	0,91 %	
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	AEC	1,92 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AEH	1,85 %	
	AU	1,85 %	
	AUP	1,85 %	
	DU	2,35 %	
	IU	1,05 %	
	XS	0,07 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	XSH	0,15 %	
	ZEH	1,10 %	
	ZFH	1,18 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZGH	1,22 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZU	1,10 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	AE	0,70 %	
	AEH	0,57 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AU	0,57 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	AUP	0,55 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	DE	0,90 %	
	DEH	0,90 %	
	DU	0,90 %	
	IE	0,35 %	
	IEC	0,35 %	
	IEH	0,40 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	IFH	0,40 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	IG	0,35 %	
	IU	0,35 %	
	NE	0,20 %	
	NG	0,20 %	
	NU	0,20 %	
	XG	0,10 %	
	ZEH	0,45 %	
	ZFH	0,45 %	
	ZU	0,45 %	
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	AE	1,50 %	
	ASH	1,50 %	
	AUH	1,50 %	
	DE	1,70 %	
	IE	0,75 %	
	W	1,65 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	XE	0,10 %	
	ZE	0,90 %	
	ZUH	0,90 %	
	1E	1,53 %	
	1EP	1,53 %	
	1G	1,53 %	
	1GP	1,53 %	
	2E	1,08 %	
	2G	1,08 %	
	2U	1,00 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	3E	0,94 %	
	3G	0,94 %	
	3GP	0,94 %	
	4E	0,08 %	
	4G	0,08 %	
	8E	1,12 %	
	8G	1,12 %	
	8U	1,03 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	9E	0,85 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities (suite)	9G	0,85 %	
	9GP	0,85 %	
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	AE	1,80 %	
	AEP	1,80 %	
	AUP	1,92 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	DE	2,15 %	
	DEP	2,15 %	
	IE	0,65 %	
	IEP	0,65 %	
	ZE	1,12 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.
	ZEP	1,05 %	
	1E	1,70 %	
	1EP	1,70 %	
	1G	1,70 %	
	1GP	1,70 %	
	2E	1,09 %	
	2EP	1,09 %	
	2G	1,02 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	2GP	1,09 %	
	3EP	0,95 %	
	3G	0,95 %	
	3GP	0,95 %	
4GP	0,09 %		
8E	1,13 %		
8EP	1,13 %		
8G	1,13 %		
8GP	1,13 %		
9EP	0,91 %		
9G	0,91 %		
9GP	0,86 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.	
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	AE	1,85 %	
	ASH	1,85 %	
	AUH	1,85 %	
	DE	2,75 %	
	DUH	2,80 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.
	IE	1,10 %	
	W	1,90 %	
	XE	0,07 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZE	1,10 %	
	ZFH	1,10 %	
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	IE	0,95 %	
	ZE	1,10 %	
	1E	1,72 %	
	1EP	1,72 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies (suite)	1FH	1,72 %	
	1G	1,72 %	
	1UH	1,72 %	
	2E	1,07 %	
	2G	1,07 %	
	3E	0,91 %	
	3EP	0,91 %	
	3FH	0,91 %	
	3G	0,91 %	
	3GP	0,91 %	
	3UH	0,91 %	
	4E	0,07 %	
	4G	0,07 %	
	8E	1,11 %	
	8G	1,11 %	
	9E	0,87 %	
	9EP	0,74 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	9FH	0,87 %	
	9G	0,87 %	
	9GP	0,75 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	9UH	0,87 %	
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	1,80 %	
	AGH	1,75 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.
	AUH	1,75 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.
	DUH	2,41 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	IE	0,95 %	
	ZE	1,17 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZG	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	1E	1,65 %	
	1EP	1,65 %	
	1SH	1,65 %	
	1U	1,65 %	
	1UH	1,65 %	
	2E	1,06 %	
	2EP	1,06 %	
	3E	0,88 %	
	3U	0,88 %	
	8E	1,10 %	
	8EP	1,10 %	
	9E	0,84 %	
	9U	0,84 %	
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	IE	0,95 %	
	ZE	1,10 %	
	1E	1,72 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies (suite)	1EP	1,72 %	
	1FH	1,57 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	2E	1,07 %	
	3E	0,93 %	
	3EP	0,93 %	
	3FH	0,93 %	
	8E	1,11 %	
	9E	0,89 %	
	9EP	0,89 %	
	9FH	0,89 %	
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	DUP	2,55 %	
	IEP	0,95 %	
	IU	0,89 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	W	2,00 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZG	1,18 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZGH	1,05 %	
	ZGP	1,21 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZU	1,16 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZUP	1,05 %	
Threadneedle (Lux) - Global Technology	AEH	1,95 %	
	AS	1,95 %	
	AU	1,95 %	
	AUP	1,95 %	
	BU	2,35 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IE	1,05 %	
	IEH	1,05 %	
	IG	1,05 %	
	IU	1,05 %	
	ZEH	1,15 %	
	ZFH	1,15 %	
	ZG	1,15 %	
	ZU	1,15 %	
Threadneedle (Lux) - UK Equities	AE	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AFH	1,80 %	
	AG	1,80 %	
	AGP	1,80 %	
	DEH	2,60 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - UK Equities (suite)	DG	2,40 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	IG	0,85 %	
	IGP	0,85 %	
	NEH	0,57 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	NFH	0,58 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	NG	0,68 %	
	NGP	0,57 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	NUH	0,58 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	TEH	0,62 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	TFH	0,61 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	TG	0,63 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	TGP	0,64 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	TUH	0,59 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGP	1,05 %	
	ZUH	1,05 %	
	3EH	0,87 %	
	3FH	0,87 %	
	3UH	0,87 %	
	9EH	0,83 %	
	9EP	0,83 %	
	9FH	0,83 %	
	9G	0,83 %	
	9UH	0,89 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	AE	1,80 %	
	AEC	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AG	1,80 %	
	ASC	1,80 %	
	AUC	1,80 %	
	DE	2,55 %	
	DEC	2,55 %	
	DEH	2,55 %	
	DG	2,61 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.
	DGP	2,47 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.
	IE	0,85 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income (suite)	IEH	0,85 %	
	IG	0,85 %	
	IGP	0,85 %	
	IU	0,85 %	
	IUH	0,85 %	
	LG	0,70 %	
	LGP	0,70 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGP	1,05 %	
	ZUH	1,05 %	
	1EH	1,64 %	
	1FH	1,64 %	
	1UH	1,64 %	
	3EH	0,88 %	
	3FH	0,88 %	
	3UH	0,88 %	
	9EH	0,84 %	
9FH	0,84 %		
9G	0,84 %		
9UH	0,84 %		
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	AEH	1,80 %	
	AFH	1,80 %	
	AGH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IEH	0,95 %	
	IGH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	XGH	0,15 %	
	ZE	1,10 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZEH	1,21 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZGH	1,05 %	
ZU	1,05 %		
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	AE	1,12 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	IE	0,51 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	ZE	0,70 %	
	1E	1,17 %	
	1EP	1,17 %	
	1GH	1,17 %	
	1UH	1,17 %	
	2E	0,56 %	
	2EP	0,56 %	
2GC	0,47 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities (suite)	2GH	0,56 %	
	4GH	0,06 %	
	8E	0,60 %	
	8EP	0,60 %	
	8GC	0,60 %	
	8GH	0,60 %	
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	AE	1,10 %	
	AFH	1,05 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	AKH	1,10 %	
	ANH	1,10 %	
	AUH	1,10 %	
	DE	1,65 %	
	IE	0,45 %	
	IEP	0,45 %	
	IGH	0,45 %	
	INH	0,45 %	
	IU	0,45 %	
	IUH	0,51 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	JE	0,45 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	JGH	0,44 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	JUH	0,46 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	LE	0,30 %	
	LEP	0,15 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	LGH	0,15 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	XE	0,10 %	
	XGH	0,10 %	
	XUH	0,10 %	
	YE	0,56 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et à sa taille réduite.
	YGH	0,50 %	
YUH	0,50 %		
ZE	0,60 %		
ZFH	0,60 %		
ZGH	0,60 %		
ZUH	0,60 %		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	AE	1,85 %	
	AEP	1,85 %	

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha (suite)	AUH	1,96 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	DE	2,35 %	
	IE	0,95 %	
	IGH	0,95 %	
	LE	0,575 %	
	XGH	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZF	1,18 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
ZFH	1,11 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.	
ZGH	1,17 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.	
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IU	0,90 %	
	ZU	1,16 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	1E	1,69 %	
	1EH	1,69 %	
	1U	1,69 %	
	2E	0,83 %	
	2U	0,83 %	
	3U	0,94 %	
	8E	0,87 %	
8U	0,87 %		
9U	0,90 %		
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	AEH	1,85 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la variation importante de la VNI moyenne.
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IU	0,90 %	
	ZU	1,22 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
	1E	1,69 %	
	1U	1,69 %	
	2E	0,88 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la taille réduite de la classe.
2U	0,83 %		
8E	0,87 %		
8U	0,87 %		
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	AEH	1,20 %	
	AFH	1,20 %	
	AGH	1,20 %	
	ASH	1,26 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	AU	1,25 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.

Annexes aux Comptes

(suite)

21 RATIO DU COÛT TOTAL (TER, TOTAL EXPENSE RATIO)

(suite)

Portefeuille	Classe	TER	Commentaires
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (suite)	DEH	1,45 %	
	DU	1,45 %	
	IEH	0,90 %	
	IG	0,90 %	
	IGH	0,90 %	
	IU	0,97 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	NG	0,55 %	
	XU	0,10 %	
	ZEH	0,95 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022.
	ZFH	0,90 %	
	ZGH	0,97 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.
	ZU	1,01 %	Le TER courant diffère du TER prévu pour l'ensemble de l'exercice du fait de la réduction des frais appliqués à cette classe d'actions le 1 ^{er} août 2022 et de la variation importante de la VNI moyenne.

22 ÉVÉNEMENT ULTÉRIEUR

À compter du 28 avril 2023, le Portefeuille Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return a été mis en liquidation.

À compter du 13 juillet 2023, les Portefeuilles Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities et Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio ont été mis en liquidation.

23 AUTRES INFORMATIONS

L'invasion à grande échelle de l'Ukraine par la Russie en février 2022 a entraîné des sanctions et des perturbations du marché, notamment des baisses sur les marchés d'actions régionaux et mondiaux, une volatilité inhabituelle sur les marchés mondiaux des matières premières et une forte dévaluation de la devise russe. L'ampleur et la durée de l'action militaire sont impossibles à prédire, mais peuvent être importantes. La perturbation du marché causée par l'action militaire russe et toute contre-mesure ou réponse à celle-ci (y compris les sanctions internationales, la dégradation de la notation de crédit du pays, les restrictions d'achat et de financement, les boycotts, les droits de douane, les changements dans les préférences des consommateurs ou des acheteurs, les cyberattaques et l'espionnage) pourraient avoir des impacts négatifs importants sur les marchés régionaux et/ou mondiaux des titres et des matières premières, y compris les marchés du pétrole et du gaz naturel. Ces impacts peuvent inclure une réduction de la liquidité du marché, des difficultés sur les marchés du crédit, une perturbation supplémentaire des chaînes d'approvisionnement mondiales, un risque accru d'inflation et un accès limité aux investissements dans certains marchés et/ou de certains émetteurs internationaux. Ces développements et d'autres événements connexes pourraient avoir un impact négatif sur la performance des Portefeuilles.

Les informations publiées périodiquement dans le cadre du SFDR pour les produits financiers visés à l'article 8(1) du règlement (UE) 2019/2088, et à l'article 6 du règlement (UE) 2020/852 figurent dans l'Annexe non audité jointe au présent document.

Exposition globale au risque (non audité)

Exposition globale et levier financier

L'exposition globale de l'OPCVM est gérée via une approche par les engagements, une approche par la Valeur à Risque absolue (VaR absolue) ou une approche par la Valeur à Risque relative (VaR relative).

Les informations relatives à l'exposition globale au risque de marché pour l'exercice clos le 31 mars 2023 sont les suivantes :

Approche par les engagements

Tous les portefeuilles qui ne suivent pas l'approche par la VaR ont recours à l'approche par les engagements pour contrôler et mesurer l'exposition globale. L'exposition globale des portefeuilles est calculée sur la base de l'approche par les engagements conformément à la méthodologie décrite dans les directives 10-788 de l'AEMF.

Pour la période entre avril 2022 et mars 2023 :

Portefeuilles appliquant l'approche par la VaR	Méthode de calcul*	Modèle de VaR*	Portefeuille de référence	Limite interne de la VaR (%)	Limite légale et contractuelle de la VaR (%)	En glissement sur un an				
						Utilisation la plus basse de la limite de la VaR	Utilisation la plus élevée de la limite de la VaR	Utilisation moyenne de la limite de la VaR	Exposition moyenne aux engagements	Somme moyenne des notionnels
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	VaR relative	Covariance	Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (USD Hedged)	1,5 x VaR réf	2,0 x VaR réf	99,08 %	112,46 %	105,86 %	38,22 %	89,28 %
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	VaR relative	Covariance	ICE BofA Custom Index 0-4 Year European Currency High Yield, BB-B, 3 % Constrained, Excluding Subordinated Debt (EUR Hedged)	1,5 x VaR réf	2,0 x VaR réf	86,04 %	115,77 %	98,93 %	0,46 %	25,48 %
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	VaR relative	Covariance	ICE BofA 1-7 Year All Euro Government Index (20 %) ICE BofA 1-10 Year Euro Corporate Index (40 %) ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index (40 %)	1,8 x VaR réf	2,0 x VaR réf	80,22 %	105,17 %	95,86 %	90,06 %	128,44 %
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	VaR relative	Covariance	J.P. Morgan Asia Credit Index Diversified	1,8 x VaR réf	2,0 x VaR réf	95,43 %	133,11 %	110,60 %	6,98 %	12,35 %
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	VaR relative	Covariance	MSCI ACWI Index (45 %) ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index (USD Hedged) (30 %) Bloomberg Global Aggregate Index (USD Hedged) (20 %) 30-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR) (5 %)	1,8 x VaR réf	2,0 x VaR réf	52,50 %	125,20 %	104,45 %	30,22 %	76,91 %
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	VaR absolue	Covariance	S.O.	8	20	2,97 %	7,49 %	5,04 %	43,39 %	91,56 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	VaR absolue	Covariance	S.O.	10	20	4,20 %	9,43 %	7,13 %	51,69 %	51,69 %

Exposition globale au risque (non audité)

(suite)

Portefeuilles appliquant l'approche par la VaR	Méthode de calcul*	Modèle de VaR*	Portefeuille de référence	Limite interne de la VaR (%)	Limite légale et contractuelle de la VaR (%)	En glissement sur un an				Somme moyenne des notionnels
						Utilisation la plus basse de la limite de la VaR	Utilisation la plus élevée de la limite de la VaR	Utilisation moyenne de la VaR	Exposition moyenne aux engagements	
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	VaR absolue	Covariance	S.O.	3,3	20	1,04 %	2,87 %	1,89 %	199,06 %	333,12 %
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	VaR absolue	Covariance	S.O.	4,7	20	1,07 %	2,75 %	1,96 %	157,55 %	220,73 %
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	VaR relative	Covariance	MSCI ACWI Index	1,6 x VaR réf	2,0 x VaR réf	100,74 %	127,33 %	118,13 %	85,20 %	91,61 %
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	VaR relative	Covariance	S&P 500 Index	1,6 x VaR réf	2,0 x VaR réf	100,44 %	123,67 %	108,58 %	48,18 %	48,54 %
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	VaR relative	Historique	Bloomberg Commodity Index	1,3 x VaR réf	1,3 x VaR réf	92,32 %	118,96 %	100,80 %	8,75 %	399,01 %

*Méthode de calcul. Le modèle de VaR est fondé sur un intervalle de confiance de 99 % sur une période de détention d'un mois. Le modèle de covariance se fonde sur les données de 2 années, pondérées avec une demi-vie de 6 mois, et est mis à jour quotidiennement. La méthode historique utilise 1 an de données quotidiennes.

Informations aux Actionnaires (non audité)

La SICAV est organisée en tant que Société d'Investissement à Capital Variable au Grand-Duché de Luxembourg en vertu de la loi du 10 août 1915, telle qu'amendée, et bénéficie du statut d'Organisme de placement collectif en valeurs mobilières (« OPCVM ») en vertu de la partie I de la loi du 17 décembre 2010, telle qu'amendée.

La SICAV a été constituée le 10 février 1995 pour une durée indéterminée. Les statuts de la SICAV ont été publiés pour la première fois dans le Recueil des Sociétés et Associations du Grand-Duché de Luxembourg le 31 mars 1995 et ont été modifiés pour la dernière fois le 14 septembre 2018.

La SICAV est immatriculée sous le numéro de registre du commerce R.C.S. Luxembourg B-50216.

L'assemblée générale annuelle des Actionnaires de la SICAV se tient à Luxembourg tel qu'indiqué dans l'avis de convocation, dans les six mois suivant la clôture de l'exercice. L'assemblée générale annuelle peut se tenir à l'étranger si, de l'avis absolu et définitif du Conseil, des circonstances exceptionnelles l'exigent. D'autres assemblées des Actionnaires peuvent se tenir à l'endroit et selon le délai tels que pouvant être indiqués dans les avis de convocation respectifs. Les avis de convocation des assemblées générales sont donnés conformément à la loi luxembourgeoise et conformément aux règles applicables dans les pays concernés où les Actions sont publiquement offertes à la vente. Les convocations indiqueront l'endroit et l'heure de l'assemblée, les conditions d'admission, l'ordre du jour, le quorum et les règles de vote.

L'exercice fiscal de la SICAV se termine le 31 mars de chaque année.

La SICAV met à la disposition des personnes intéressées son rapport annuel et comptes audités et son rapport semestriel non audité à son siège social, ainsi qu'au siège principal de chaque agent payeur et distributeur. Les comptes consolidés de la SICAV sont exprimés en dollar US.

La Valeur nette d'inventaire et les prix de souscription et de rachat des actions de la SICAV seront publiés au siège social de la SICAV.

Le présent rapport ne constitue ni une offre ni une sollicitation d'offre d'achat d'actions de la SICAV. Les souscriptions sont acceptées sur la base du Prospectus et du dernier rapport annuel publié contenant les comptes audités au 31 mars et, le cas échéant, du dernier rapport semestriel au 30 septembre, s'il est publié entre-temps.

Certains Portefeuilles et/ou certaines Classes d'actions mentionné(e)s dans le présent rapport peuvent ne pas être actuellement autorisé(e)s ou proposé(e)s à la vente dans certaines juridictions.

Document d'information clé pour l'investisseur (« DICI ») / Document d'information clé (« DIC ») - Exigences relatives aux souscriptions

Le DICI/DIC constitue un document précontractuel et les investisseurs devront confirmer qu'ils ont lu le dernier DICI/DIC avant de procéder à une souscription. La Société de gestion peut refuser la souscription si l'investisseur ne confirme pas avoir lu la dernière version du DICI/DIC au moment de la souscription. La dernière version en date du DICI/DIC est disponible sur www.columbiathreadneedle.com.

Informations relatives à la rémunération

Ces informations sont fournies au titre de la Politique de rémunération du Groupe telle qu'elle s'applique à Threadneedle Management Luxembourg S.A. (le « Gestionnaire ») en vertu de la directive sur les organismes de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) et autres règles et orientations.

La Politique de rémunération s'applique à l'ensemble des filiales de la Société concernées par les dispositions des Directives OPCVM et a été approuvée pour la dernière fois par le Comité de rémunération en juin 2022.

1. Le Comité de rémunération

Le Comité de rémunération de UK HoldCo (« le Comité ») est un sous-comité du Conseil de UK HoldCo et est chargé de fixer les principes et objectifs régissant les programmes de rémunération et d'avantages du Groupe, d'examiner et approuver les plans, politiques et pratiques en matière de rémunération et d'avantages, ainsi que de superviser et d'approuver la rémunération du Groupe. Sa constitution prévoit son indépendance à l'égard de la direction exécutive du Groupe au quotidien, ses Membres étant des Administrateurs du Groupe nommés par Ameriprise Financial, la société mère du Groupe.

Les membres actuels du Comité sont M. Walter Berman et M. William Turner. Les réunions se tiennent généralement en janvier, mars, juin, septembre et décembre. Le Responsable mondial des primes agit en qualité de Secrétaire du Comité. Le Comité peut, en tant que de besoin, requérir la participation de tout salarié du Groupe ou expert de la société mère en vue d'acquiescer ses responsabilités, et notamment de s'assurer que la rémunération est conforme à une gestion des risques efficace et n'incite pas à une prise de risques excessive.

2. Détermination des enveloppes d'intéressement

Le Gestionnaire a déterminé la Prime d'intéressement globale annuelle en fonction des différentes enveloppes destinées aux services Immobilier, Distribution, Investissements et Support, lesquelles sont ensuite cumulées à des fins de gouvernance et de supervision au niveau de la région EMOA. La décision concernant la détermination de ces enveloppes revient à la Société, sous réserve de la supervision et de l'approbation finales du Comité de rémunération. Les enveloppes pour les Plans d'intéressement spéciaux (Special Incentive Plans ou « SIP ») des services Immobilier, Distribution et Investissements sont déterminées selon les quatre facteurs non pondérés suivants : une évaluation « descendante » des pratiques de marché, des dispositions légales et réglementaires et de tout autre facteur contextuel interne ou externe ; un calcul « ascendant » basé sur la performance de la société par rapport au niveau de son Plan d'intéressement ciblé (voir « Rémunération à la performance » ci-dessous) ; la performance financière et stratégique globale du Groupe ; et la performance financière et stratégique d'Ameriprise Financial en tant que société mère et actionnaire du Groupe. Le financement des postes de soutien fait partie du plan mondial « AIA » ; le financement pour chaque région et chaque

Informations aux Actionnaires (non audité)

(suite)

activité est déterminé par une évaluation complète de l'unité commerciale équilibrée dans le contexte de la performance globale du groupe Ameriprise Financial. Toutes les enveloppes sont établies dans le contexte de l'environnement de risque et de contrôle maintenu au cours de l'année et peuvent être ajustées selon une approche descendante pour tenir compte de tout élément substantiel à cet égard. Le Comité reçoit également des rapports réguliers de la fonction Risques au cours de l'exercice, qui portent sur l'évaluation des risques et tout sujet ou domaine pertinent en matière de contrôle des risques ou de comportements liés aux risques.

Le Comité tient compte de l'ensemble de ces facteurs en vue de prendre une décision objective concernant sa supervision et les enveloppes d'intéressement globales pour l'exercice concerné.

3. Détermination des primes d'intéressement globales individuelles

Les décisions en matière de primes individuelles, pour tous les plans d'intéressement, sont entièrement discrétionnaires, bien que largement fondées sur l'évaluation de la performance annuelle, les niveaux de rémunération en vigueur sur le marché pour des postes similaires et le montant disponible des enveloppes. La contribution des fonctions Risques et Conformité est essentielle dans le cadre de l'évaluation finale de la performance, en veillant à ce que toute question concernant les risques et les comportements y afférents soit prise en compte dans cette évaluation puis dans les recommandations émises en matière de rémunération. En outre, les responsables Risque et Conformité EMOA rendent directement compte de la procédure d'attribution des primes au Comité de rémunération pour s'assurer que ce dernier bénéficie d'une transmission directe des informations sur lesquelles il fondera ses décisions finales quant à l'ajustement des risques.

Les salaires de base sont fixés à un niveau compétitif par rapport au marché afin qu'il soit possible, au besoin, de ne pas attribuer de prime d'intéressement.

Rémunération à la performance

Le critère ascendant du processus de détermination des enveloppes d'intéressement mesure la performance de l'équipe et de l'entreprise au sens large par rapport à des objectifs clés fixés pour chaque domaine d'activité du Groupe, tels que la performance des investissements à plus long terme pour les services Investissements et Immobilier et une combinaison des chiffres d'affaires brut et net pour le service Distribution. La performance des investissements est évaluée en fonction de l'indice de référence et du profil de risque de chaque fonds. Les répercussions de ces évaluations sur le calcul ascendant sont plafonnées, et pondérées plus fortement pour les périodes plus longues, pour ne pas inciter les gestionnaires à prendre des risques excessifs dans le but de générer des enveloppes d'intéressement plus élevées. Bien que les résultats financiers et stratégiques du Groupe et de sa société mère constituent des facteurs importants pour la détermination des enveloppes, le modèle est conçu de manière à ce que la réalisation des objectifs principaux de l'entreprise, dont celui de garantir aux clients la performance de leurs investissements, soit clairement un moteur significatif de la détermination des enveloppes pour ces services.

Dans une optique de primes compétitives par rapport au marché pour un poste donné, les primes discrétionnaires individuelles issues de l'enveloppe disponible dépendent fortement du classement individuel des salariés par rapport aux Objectifs fixés et aux attentes en matière de comportement de la direction du Groupe (nos Valeurs), ces deux critères étant évalués séparément sur une échelle de 5 points afin de garantir que l'évaluation relative aux comportements soit prépondérante. Les Objectifs portent sur les principaux accomplissements attendus de la fonction pour l'exercice concerné, notamment en termes de performance des investissements pour les services Investissements et Patrimoine. Tous les salariés sont également liés par un Objectif de gestion des risques obligatoire. Pour les fonctions concernées, la performance des Investissements est évaluée par rapport à l'indice de référence et au profil de risque de chaque fonds.

Les classements sont vérifiés à des fins de cohérence à travers l'entreprise, avec le concours des responsables des services Risques et Conformité EMOA qui communiquent les informations requises pour s'assurer de leur objectivité et du juste reflet de la gestion des risques. Il n'existe pas de grille ni de formule prédéfinies pour l'attribution des primes d'intéressement des services Ventas, Immobilier et Investissements, celle-ci étant discrétionnaire afin de prendre en compte et d'intégrer tous les facteurs pertinents.

Versement des primes d'intéressement globales

Le Groupe estime que le versement différé des primes aux salariés percevant une rémunération supérieure et aux preneurs de risques est synonyme de bonne pratique et permet d'aligner les intérêts du personnel clé avec ceux à long terme des clients et actionnaires. À cette fin, les primes d'intéressement globales attribuées à l'ensemble des salariés du Groupe peuvent être en partie versées sous forme de primes différées via le programme de Prime d'intéressement à long terme (Long-Term Incentive Award, « LTIA ») d'Ameriprise Financial et, pour les salariés du Code de rémunération/le Personnel identifié et du service Investissements, via un programme de report de fonds. Les reports, ainsi que le versement de primes sous forme d'instruments seront à tout moment conformes aux dispositions réglementaires applicables en la matière.

Un taux de report plus élevé s'applique aux salariés du Code de rémunération/au Personnel identifié et à ceux dont le niveau d'ancienneté est comparable. 50 % de l'ensemble des primes d'intéressement est versé sous forme d'unités de compte du fonds faisant l'objet d'une période de détention après distribution. Les unités de compte du fonds sont conçues pour refléter la performance d'un échantillon de produits et de classes d'actifs dans la région.

4. Personnel identifié

Les salariés du Code de rémunération/le Personnel identifié comprennent les membres de la direction, les personnes ayant une forte incidence sur le profil de risque des OPCVM, les personnes détenant des fonctions de contrôle et tout autre salarié dont la rémunération totale s'inscrit dans la même tranche de rémunération que les membres de la direction et les preneurs de risques et dont les activités professionnelles ont une forte incidence sur les profils de risque du Gestionnaire ou des fonds qu'il gère. Concrètement, le Personnel identifié inclut les Gestionnaires de fonds désignés des fonds du Gestionnaire.

Informations aux Actionnaires (non audité)

(suite)

5. Informations relatives au versement de la rémunération

La période de performance considérée pour la rémunération est basée sur une année civile.

Le montant total de la rémunération versée par le Groupe à 27 membres de la direction tels que définis par le Code de rémunération de la Directive OPCVM V relativement à ses activités liées aux OPCVM pour la performance réalisée sur l'exercice 2022 était de 2,06 millions GBP, respectivement réparti selon des montants de 0,85 million GBP et 1,21 million GBP entre les composantes fixe et variable. Le montant total de la rémunération versée aux autres membres du personnel tels que définis par le Code de rémunération de la Directive OPCVM dont les actions ont eu une incidence importante sur le profil de risque du Gestionnaire s'élevait à 6,27 millions GBP, respectivement réparti selon des montants de 2,66 millions GBP et 3,61 millions GBP entre les composantes fixe et variable. Le montant total de la rémunération versée aux gestionnaires délégués de fonds réglementés de type OPCVM s'élevait à 0,99 million GBP, respectivement réparti selon des montants de 0,29 million GBP et 0,70 million GBP entre les composantes fixe et variable.

Informations concernant les investisseurs en Suisse (non audité)

Le rapport annuel et comptes audités, le rapport semestriel non audité, l'État des variations du Portefeuille pour l'exercice, les statuts, le Prospectus (dans sa version suisse), ainsi que le DICI/DIC peuvent être obtenus sans frais et sur simple demande aux bureaux du Représentant et de l'Agent payeur pour la Suisse de la SICAV : RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, succursale de Zurich, Bleicherweg 7, 8027 Zurich, Suisse, ou au siège social de la SICAV.

La performance passée n'est pas indicative de la performance actuelle ou future, et les données sur la performance ne tiennent pas compte des commissions et frais engagés lors de l'émission et du rachat d'actions.

Performance des Classes d'actions (non audité)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
AEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,59 %	-0,79 %	-2,48 %	8,26 %	9,67 %
AEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,57 %	-0,79 %	-2,49 %	8,26 %	9,71 %
AKH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,24 %	-0,79 %	-2,26 %	8,26 %	9,87 %
ANH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,49 %	-0,79 %	-1,75 %	8,26 %	10,06 %
AU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,69 %	-0,79 %	-1,57 %	8,26 %	11,36 %
AUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,69 %	-0,79 %	-1,57 %	8,26 %	11,36 %
DEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-18,19 %	-0,79 %	-3,21 %	8,26 %	8,90 %
DEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-18,16 %	-0,79 %	-3,22 %	8,26 %	8,85 %
DU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,31 %	-0,79 %	-2,30 %	8,26 %	10,53 %
DUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,32 %	-0,79 %	-2,30 %	8,26 %	10,53 %
IEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,41 %	-0,79 %	-2,29 %	8,26 %	9,92 %
IEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,38 %	-0,79 %	-2,29 %	8,26 %	9,86 %
IEP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-9,97 %	-0,79 %	6,08 %	8,26 %	2,20 %
IGC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,25 %	-0,79 %	-1,63 %	8,26 %	10,24 %
IGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,23 %	-0,79 %	-1,61 %	8,26 %	10,25 %
IKH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,03 %	-0,79 %	-1,95 %	8,26 %	10,10 %
INH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,27 %	-0,79 %	-1,47 %	8,26 %	10,39 %
IU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,48 %	-0,79 %	-1,37 %	8,26 %	11,58 %
IUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,48 %	-0,79 %	-1,37 %	8,26 %	11,61 %
NEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,26 %	-0,79 %	-2,09 %	8,26 %	10,16 %
NEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,27 %	-0,79 %	-2,10 %	8,26 %	10,08 %
NGC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,11 %	-0,79 %	-1,41 %	8,26 %	10,51 %
NGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,09 %	-0,79 %	-1,41 %	8,26 %	10,49 %
NU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,35 %	-0,79 %	-1,17 %	8,26 %	11,80 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
<i>(suite)</i>								
NUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,35 %	-0,79 %	-1,17 %	8,26 %	11,82 %
XEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Performance depuis le lancement le 16 octobre 2020	-14,11 %	-17,05 %	-0,79 %	-1,80 %	2,18 %	2,27 %
XFH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Performance depuis le lancement le 16 octobre 2020	-14,11 %	-17,39 %	-0,79 %	-2,07 %	2,18 %	2,21 %
XGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,85 %	-0,79 %	-1,11 %	8,26 %	10,81 %
XU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Performance depuis le lancement le 16 octobre 2020	-14,11 %	-15,09 %	-0,79 %	-0,87 %	2,18 %	2,48 %
ZEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,38 %	-0,79 %	-2,23 %	8,26 %	9,97 %
ZFH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Performance depuis le lancement le 14 octobre 2020	-14,11 %	-17,80 %	-0,79 %	-2,66 %	2,17 %	2,11 %
ZGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,22 %	-0,79 %	-1,55 %	8,26 %	10,32 %
ZU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,48 %	-0,79 %	-1,32 %	8,26 %	11,63 %
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond								
AE	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,74 %	-1,08 %	-1,81 %	2,73 %	3,76 %
ANH	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-13,72 %	-1,08 %	-1,20 %	2,73 %	4,48 %
IE	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,33 %	-1,08 %	-1,22 %	2,73 %	4,39 %
IEP	iBoxx EUR Corporate Bond	Performance depuis le lancement le 8 avril 2021	-14,17 %	-14,43 %	-0,66 %	-0,97 %	s.o.	s.o.
INH	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-13,27 %	-1,08 %	-0,51 %	2,73 %	5,04 %
XE	iBoxx EUR Corporate Bond	Performance depuis le lancement le 16 octobre 2020	-14,17 %	-14,08 %	-1,08 %	-0,73 %	1,13 %	1,53 %
XFH	iBoxx EUR Corporate Bond	Performance depuis le lancement le 16 octobre 2020	-14,17 %	-14,50 %	-1,08 %	-1,05 %	1,13 %	1,48 %
XGH	iBoxx EUR Corporate Bond	Performance depuis le lancement le 16 octobre 2020	-14,17 %	-12,92 %	-1,08 %	-0,20 %	1,13 %	1,65 %
XUH	iBoxx EUR Corporate Bond	Performance depuis le lancement le 16 octobre 2020	-14,17 %	-12,29 %	-1,08 %	-0,04 %	1,13 %	1,72 %
ZE	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,53 %	-1,08 %	-1,45 %	2,73 %	4,29 %
ZFH	iBoxx EUR Corporate Bond	Performance depuis le lancement le 14 octobre 2020	-14,17 %	-15,00 %	-1,08 %	-1,72 %	1,27 %	1,51 %
1E	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,87 %	-1,08 %	-1,80 %	2,73 %	3,78 %
1G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-10,04 %	-1,08 %	-7,89 %	2,73 %	9,62 %
2E	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,35 %	-1,08 %	-1,20 %	2,73 %	4,41 %
2G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-9,59 %	-1,08 %	-7,36 %	2,73 %	10,26 %
3G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-9,59 %	-1,08 %	-7,43 %	2,73 %	10,18 %
4E	iBoxx EUR Corporate Bond	Performance depuis le lancement le 8 avril 2020	-14,17 %	-13,92 %	-1,08 %	-0,70 %	9,46 %	10,73 %
4G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-9,04 %	-1,08 %	-6,86 %	2,73 %	10,85 %
8E	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,39 %	-1,08 %	-1,24 %	2,73 %	4,37 %
8G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-9,53 %	-1,08 %	-7,36 %	2,73 %	10,26 %
9G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-9,62 %	-1,08 %	-7,46 %	2,73 %	10,22 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
AE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)	Performance depuis le lancement le 6 mai 2020	-11,75 %	-12,21 %	3,25 %	1,46 %	14,26 %	11,30 %
AKH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-12,00 %	3,25 %	1,67 %	2,82 %	2,71 %
ANH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,18 %	3,25 %	2,17 %	2,82 %	2,68 %
IE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,55 %	3,25 %	2,27 %	2,82 %	3,43 %
IEP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,55 %	3,25 %	2,27 %	2,82 %	3,43 %
IKH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,23 %	3,25 %	2,48 %	2,82 %	3,32 %
INH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-10,42 %	3,25 %	2,93 %	2,82 %	3,36 %
XE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,01 %	3,25 %	3,00 %	2,82 %	4,15 %
ZE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,61 %	3,25 %	2,22 %	2,82 %	3,38 %
ZEP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,61 %	3,25 %	2,22 %	2,82 %	3,36 %
1E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-12,09 %	3,25 %	1,73 %	2,82 %	2,88 %
1EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-12,09 %	3,25 %	1,73 %	2,82 %	2,88 %
1G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-7,10 %	3,25 %	-4,58 %	2,82 %	8,68 %
1GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-7,09 %	3,25 %	-4,56 %	2,82 %	8,65 %
1UT	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-10,24 %	3,25 %	2,47 %	2,82 %	4,25 %
2E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,60 %	3,25 %	2,30 %	2,82 %	3,46 %
2EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,59 %	3,25 %	2,33 %	2,82 %	3,50 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
<i>(suite)</i>								
2FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-12,03 %	3,25 %	1,99 %	2,82 %	3,12 %
2G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,65 %	3,25 %	-4,11 %	2,82 %	9,29 %
2GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,56 %	3,25 %	-3,99 %	2,82 %	9,36 %
3E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,55 %	3,25 %	2,35 %	2,82 %	3,51 %
3EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,55 %	3,25 %	2,35 %	2,82 %	3,51 %
3FC	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,98 %	3,25 %	2,03 %	2,82 %	3,16 %
3FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,98 %	3,25 %	2,04 %	2,82 %	3,18 %
3G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,53 %	3,25 %	-3,99 %	2,82 %	9,35 %
3GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,52 %	3,25 %	-3,98 %	2,82 %	9,32 %
4E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-10,93 %	3,25 %	3,07 %	2,82 %	4,24 %
4G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-5,90 %	3,25 %	-3,32 %	2,82 %	10,12 %
8E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,63 %	3,25 %	2,26 %	2,82 %	3,42 %
8EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,63 %	3,25 %	2,26 %	2,82 %	3,42 %
8FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-12,06 %	3,25 %	1,95 %	2,82 %	3,09 %
8G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,62 %	3,25 %	-4,08 %	2,82 %	9,25 %
8GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,61 %	3,25 %	-4,06 %	2,82 %	9,22 %
9E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,51 %	3,25 %	2,40 %	2,82 %	3,55 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
<i>(suite)</i>								
9EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,51 %	3,25 %	2,40 %	2,82 %	3,55 %
9FC	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,86 %	3,25 %	2,10 %	2,82 %	3,19 %
9FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,85 %	3,25 %	2,08 %	2,82 %	3,22 %
9G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,48 %	3,25 %	-3,87 %	2,82 %	9,44 %
9GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,43 %	3,25 %	-3,88 %	2,82 %	9,41 %
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond								
AE	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-4,82 %	s.o.	1,82 %	0,62 %	1,31 %
AEP	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-4,83 %	s.o.	1,82 %	0,62 %	1,31 %
AKH	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-4,55 %	s.o.	2,11 %	0,62 %	1,43 %
ANH	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-3,62 %	s.o.	2,55 %	0,62 %	1,64 %
IE	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-4,44 %	s.o.	2,23 %	0,62 %	1,72 %
IEP	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-4,44 %	s.o.	2,22 %	0,62 %	1,67 %
IGC	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-3,15 %	s.o.	2,80 %	0,62 %	2,11 %
IGH	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-3,20 %	s.o.	2,76 %	0,62 %	2,04 %
IKH	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-4,18 %	s.o.	2,49 %	0,62 %	1,82 %
INH	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-3,30 %	s.o.	2,92 %	0,62 %	2,02 %
XE	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-4,06 %	s.o.	2,64 %	0,62 %	2,13 %
XGC	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-2,71 %	s.o.	3,19 %	0,62 %	2,48 %
XGH	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-2,67 %	s.o.	3,17 %	0,62 %	2,52 %
ZE	PAS D'INDICE DE RÉFÉRENCE OFFICIEL		s.o.	-4,53 %	s.o.	2,16 %	0,62 %	1,66 %
Threadneedle (Lux) - European Social Bond								
AE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 18 septembre 2020	-14,49 %	-15,43 %	-1,46 %	-2,38 %	1,52 %	1,36 %
AEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 18 septembre 2020	-14,49 %	-15,43 %	-1,46 %	-2,38 %	1,52 %	1,36 %
AFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 25 février 2021	-14,49 %	-15,82 %	-0,62 %	-1,19 %	s.o.	s.o.
AKH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 14 octobre 2020	-14,49 %	-15,00 %	-1,46 %	-1,93 %	1,04 %	1,03 %
ANH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 14 octobre 2020	-14,49 %	-14,14 %	-1,46 %	-1,46 %	1,04 %	1,12 %
ASC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 25 février 2021	-14,49 %	-13,98 %	-0,62 %	-0,43 %	s.o.	s.o.
ASH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 25 février 2021	-14,49 %	-13,94 %	-0,62 %	-0,44 %	s.o.	s.o.
AUC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 25 février 2021	-14,49 %	-13,67 %	-0,62 %	-0,36 %	s.o.	s.o.

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - European Social Bond								
<i>(suite)</i>								
AUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 25 février 2021	-14,49 %	-13,69 %	-0,62 %	-0,33 %	s.o.	s.o.
ID	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-15,31 %	-1,46 %	-2,31 %	2,74 %	2,77 %
IE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-15,30 %	-1,46 %	-2,23 %	2,74 %	3,16 %
IEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-15,30 %	-1,46 %	-2,23 %	2,74 %	3,16 %
IFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-15,74 %	-1,46 %	-2,56 %	2,74 %	2,78 %
IGH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 25 février 2021	-14,49 %	-14,19 %	-0,62 %	-0,45 %	s.o.	s.o.
IKH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-14,96 %	-1,46 %	-1,88 %	2,74 %	3,33 %
INH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-14,09 %	-1,46 %	-1,41 %	2,74 %	3,69 %
ISC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 25 février 2021	-14,49 %	-13,77 %	-0,62 %	-0,42 %	s.o.	s.o.
ISH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 25 février 2021	-14,49 %	-13,81 %	-0,62 %	-0,42 %	s.o.	s.o.
IUC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 25 février 2021	-14,49 %	-13,62 %	-0,62 %	-0,35 %	s.o.	s.o.
IUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 25 février 2021	-14,49 %	-13,62 %	-0,62 %	-0,26 %	s.o.	s.o.
LE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-15,30 %	-1,46 %	-2,24 %	2,74 %	3,23 %
NEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-15,30 %	-1,46 %	-2,23 %	2,74 %	3,23 %
ZD	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-15,36 %	-1,46 %	-2,36 %	2,74 %	2,71 %
ZE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-15,34 %	-1,46 %	-2,28 %	2,74 %	3,11 %
ZEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-15,34 %	-1,46 %	-2,28 %	2,74 %	3,11 %
ZFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)		-14,49 %	-15,79 %	-1,46 %	-2,60 %	2,74 %	2,76 %
ZGC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 3 avril 2020	-14,49 %	-14,27 %	-1,46 %	-1,75 %	7,68 %	7,77 %
ZGH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 3 avril 2020	-14,49 %	-14,25 %	-1,46 %	-1,75 %	7,68 %	7,78 %
ZUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50 %), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50 %)	Performance depuis le lancement le 12 juin 2020	-14,49 %	-13,65 %	-1,46 %	-1,58 %	3,50 %	3,92 %
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond								
AE	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-10,90 %	0,86 %	-0,63 %	2,23 %	5,38 %
AEP	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-10,90 %	0,86 %	-0,63 %	2,23 %	5,38 %
AKH	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-10,69 %	0,86 %	-0,54 %	2,23 %	5,56 %
ANH	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-9,71 %	0,86 %	-0,13 %	2,23 %	5,97 %
AUH	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-9,17 %	0,86 %	-0,02 %	2,23 %	6,72 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond								
<i>(suite)</i>								
DE	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-11,39 %	0,86 %	-1,18 %	2,23 %	4,80 %
DEP	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-11,39 %	0,86 %	-1,18 %	2,23 %	4,80 %
DUH	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-9,64 %	0,86 %	-0,65 %	2,23 %	6,04 %
IE	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-10,36 %	0,86 %	-0,04 %	2,23 %	6,01 %
INH	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-9,13 %	0,86 %	0,70 %	2,23 %	6,77 %
ZE	ICE BofA Custom Index	Performance depuis le lancement le 11 novembre 2021	-11,32 %	-10,58 %	-0,42 %	-0,40 %	s.o.	s.o.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds								
AEC	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,53 %	0,91 %	-2,47 %	7,13 %	6,21 %
AEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,58 %	0,91 %	-2,43 %	7,13 %	6,22 %
AKH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,19 %	0,91 %	-2,12 %	7,13 %	6,31 %
ANH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-13,33 %	0,91 %	-1,71 %	7,13 %	6,15 %
ASH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-12,95 %	0,91 %	-1,60 %	7,13 %	7,35 %
AU	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-12,62 %	0,91 %	-1,54 %	7,13 %	7,90 %
AUP	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-12,62 %	0,91 %	-1,54 %	7,13 %	7,90 %
DEC	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,62 %	0,91 %	-2,57 %	7,13 %	6,10 %
DEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,67 %	0,91 %	-2,53 %	7,13 %	6,12 %
DU	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-12,70 %	0,91 %	-1,64 %	7,13 %	7,79 %
IEC	JPM CEMBI Broad Diversified	Performance depuis le lancement le 25 février 2021	-12,26 %	-13,82 %	s.o.	-1,16 %	s.o.	s.o.
IEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-13,89 %	0,91 %	-1,65 %	7,13 %	7,09 %
IU	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-11,92 %	0,91 %	-0,77 %	7,13 %	8,76 %
W	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-12,31 %	0,91 %	-1,20 %	7,13 %	8,27 %
WEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,27 %	0,91 %	-2,10 %	7,13 %	6,59 %
XUP	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-11,27 %	0,91 %	0,07 %	7,13 %	9,66 %
ZU	JPM CEMBI Broad Diversified	Performance depuis le lancement le 11 novembre 2021	-12,26 %	-11,88 %	s.o.	0,01 %	s.o.	s.o.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt								
AEC	JPM EMBI Global		-16,45 %	-18,84 %	-1,51 %	-3,92 %	5,88 %	5,56 %
AEH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-18,88 %	-1,51 %	-3,91 %	5,88 %	5,55 %
AKH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-18,75 %	-1,51 %	-3,83 %	5,88 %	5,36 %
ANH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-17,86 %	-1,51 %	-3,40 %	5,88 %	4,87 %
ASH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-17,12 %	-1,51 %	-3,08 %	5,88 %	6,61 %
AU	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,64 %	-1,51 %	-2,96 %	5,88 %	7,29 %
AUP	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,64 %	-1,51 %	-2,96 %	5,88 %	7,29 %
DEH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-18,94 %	-1,51 %	-4,02 %	5,88 %	5,44 %
DU	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,73 %	-1,51 %	-3,06 %	5,88 %	7,18 %
IEH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-18,21 %	-1,51 %	-3,16 %	5,88 %	6,41 %
IU	JPM EMBI Global		-16,45 %	-15,97 %	-1,51 %	-2,45 %	5,88 %	7,98 %
SU	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,77 %	-1,51 %	-3,11 %	5,88 %	7,12 %
SUP	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,77 %	-1,51 %	-3,11 %	5,88 %	7,13 %
W	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,35 %	-1,51 %	-2,62 %	5,88 %	7,66 %
XUP	JPM EMBI Global		-16,45 %	-15,45 %	-1,51 %	-1,59 %	5,88 %	8,91 %
ZU	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,01 %	-1,51 %	-2,34 %	5,88 %	8,07 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
AEC	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-12,48 %	0,19 %	-2,58 %	4,79 %	2,68 %
AEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-12,49 %	0,19 %	-2,59 %	4,79 %	2,69 %
AKH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-12,37 %	0,19 %	-2,33 %	4,79 %	2,65 %
ANH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-11,33 %	0,19 %	-1,88 %	4,79 %	2,90 %
ASC	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-10,75 %	0,19 %	-1,70 %	4,79 %	3,71 %
ASH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-10,77 %	0,19 %	-1,72 %	4,79 %	3,70 %
AU	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-10,41 %	0,19 %	-1,65 %	4,79 %	4,22 %
AUP	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-10,41 %	0,19 %	-1,65 %	4,79 %	4,22 %
DEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-12,63 %	0,19 %	-2,73 %	4,79 %	2,54 %
DU	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-10,54 %	0,19 %	-1,79 %	4,79 %	4,07 %
IE	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-3,82 %	0,19 %	6,62 %	4,79 %	-3,68 %
IEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-11,84 %	0,19 %	-1,84 %	4,79 %	3,45 %
XU	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-9,12 %	0,19 %	-0,21 %	4,79 %	5,75 %
XUP	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-9,12 %	0,19 %	-0,21 %	4,79 %	5,75 %
ZEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-11,86 %	0,19 %	-1,90 %	4,79 %	3,38 %
ZU	JPM EMBI Global 3-5 Years	Performance depuis le lancement le 11 novembre 2021	-10,28 %	-9,68 %	-1,11 %	-0,74 %	s.o.	s.o.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
AEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,36 %	5,27 %	2,57 %	6,10 %	3,32 %
AEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,37 %	5,27 %	2,56 %	6,10 %	3,33 %
AKH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,21 %	5,27 %	2,89 %	6,10 %	3,11 %
ANH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-12,52 %	5,27 %	3,26 %	6,10 %	2,96 %
ASH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,66 %	5,27 %	3,45 %	6,10 %	4,30 %
AU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,18 %	5,27 %	3,54 %	6,10 %	4,99 %
AUP	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,18 %	5,27 %	3,54 %	6,10 %	4,99 %
DEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,52 %	5,27 %	2,37 %	6,10 %	3,13 %
DEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,55 %	5,27 %	2,38 %	6,10 %	3,13 %
DU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,36 %	5,27 %	3,34 %	6,10 %	4,78 %
IEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-12,61 %	5,27 %	3,48 %	6,10 %	4,30 %
IEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-12,60 %	5,27 %	3,49 %	6,10 %	4,22 %
IKH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-12,38 %	5,27 %	3,80 %	6,10 %	4,08 %
INH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,63 %	5,27 %	4,19 %	6,10 %	3,97 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
<i>(suite)</i>								
ISC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Performance depuis le lancement le 29 juillet 2021	-11,10 %	-10,88 %	1,38 %	1,52 %	s.o.	s.o.
IU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-10,42 %	5,27 %	4,48 %	6,10 %	5,94 %
TEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-12,59 %	5,27 %	3,48 %	6,10 %	4,22 %
XUP	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-9,96 %	5,27 %	5,06 %	6,10 %	6,51 %
ZFH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,06 %	5,27 %	2,91 %	6,10 %	3,70 %
ZGH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,68 %	5,27 %	3,79 %	6,10 %	4,13 %
ZU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-10,59 %	5,27 %	4,22 %	6,10 %	5,67 %
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond								
AEH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-15,70 %	-0,61 %	-0,82 %	5,67 %	2,44 %
AKH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-15,25 %	-0,61 %	-0,50 %	5,67 %	2,68 %
AS	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,29 %	-0,61 %	2,06 %	5,67 %	2,32 %
ASC	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,13 %	-0,61 %	0,03 %	5,67 %	3,65 %
ASH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,15 %	-0,61 %	0,01 %	5,67 %	3,61 %
AU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,84 %	-0,61 %	0,07 %	5,67 %	4,10 %
AUP	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,84 %	-0,61 %	0,07 %	5,67 %	4,10 %
AVC	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,54 %	-0,61 %	-0,50 %	5,67 %	3,16 %
AVH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,59 %	-0,61 %	-0,38 %	5,67 %	3,10 %
DEH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-15,95 %	-0,61 %	-1,14 %	5,67 %	2,21 %
IEH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-15,20 %	-0,61 %	-0,24 %	5,67 %	3,15 %
IGH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,00 %	-0,61 %	0,41 %	5,67 %	3,60 %
ISH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,64 %	-0,61 %	0,66 %	5,67 %	4,34 %
IU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,32 %	-0,61 %	0,67 %	5,67 %	4,80 %
XU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-12,97 %	-0,61 %	1,07 %	5,67 %	5,46 %
ZU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,39 %	-0,61 %	0,57 %	5,67 %	4,70 %
ZUP	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,44 %	-0,61 %	0,55 %	5,67 %	4,63 %
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return								
AE	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-10,68 %	4,76 %	6,86 %	-0,25 %	5,21 %
AEP	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-10,80 %	4,76 %	6,81 %	-0,25 %	5,16 %
DE	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-11,35 %	4,76 %	6,06 %	-0,25 %	4,43 %
IE	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-10,05 %	4,76 %	7,61 %	-0,25 %	5,95 %
IEP	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-9,82 %	4,76 %	7,61 %	-0,25 %	5,92 %
LE	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-9,92 %	4,76 %	7,77 %	-0,25 %	6,11 %
LEP	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-9,73 %	4,76 %	7,82 %	-0,25 %	6,10 %
ZE	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-10,33 %	4,76 %	7,41 %	-0,25 %	5,74 %
ZEP	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-10,31 %	4,76 %	7,42 %	-0,25 %	5,75 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return								
AEC	US CPI		6,42 %	-16,15 %	7,12 %	-0,68 %	s.o.	9,60 %
AEH	US CPI		6,42 %	-16,15 %	7,12 %	-0,67 %	s.o.	9,60 %
AKH	US CPI		6,42 %	-16,11 %	7,12 %	-0,44 %	s.o.	9,59 %
AU	US CPI		6,42 %	-13,80 %	7,12 %	0,32 %	s.o.	11,46 %
AUP	US CPI		6,42 %	-13,80 %	7,12 %	0,32 %	s.o.	11,46 %
DEH	US CPI		6,42 %	-16,69 %	7,12 %	-1,32 %	s.o.	8,89 %
DU	US CPI		6,42 %	-14,36 %	7,12 %	-0,33 %	s.o.	10,74 %
IEH	US CPI		6,42 %	-15,48 %	7,12 %	-0,09 %	s.o.	10,26 %
IGH	US CPI		6,42 %	-14,49 %	7,12 %	0,66 %	s.o.	10,78 %
IU	US CPI		6,42 %	-13,19 %	7,12 %	1,03 %	s.o.	12,24 %
W	US CPI		6,42 %	-13,89 %	7,12 %	0,22 %	s.o.	11,35 %
ZU	US CPI	Performance depuis le lancement le 11 novembre 2021	6,42 %	-13,38 %	0,99 %	-1,89 %	s.o.	s.o.
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
AE	Indice de référence composite		-12,89 %	-5,86 %	1,03 %	15,61 %	0,66 %	-6,12 %
AEC	Indice de référence composite		-12,89 %	-13,92 %	1,03 %	6,43 %	0,66 %	0,64 %
AEH	Indice de référence composite		-12,89 %	-13,90 %	1,03 %	6,35 %	0,66 %	0,61 %
AEP	Indice de référence composite		-12,89 %	-5,87 %	1,03 %	15,61 %	0,66 %	-6,12 %
AS	Indice de référence composite		-12,89 %	-12,32 %	1,03 %	9,39 %	0,66 %	0,33 %
ASC	Indice de référence composite		-12,89 %	-12,17 %	1,03 %	7,33 %	0,66 %	1,53 %
ASH	Indice de référence composite		-12,89 %	-12,17 %	1,03 %	7,27 %	0,66 %	1,46 %
ASP	Indice de référence composite		-12,89 %	-12,11 %	1,03 %	9,60 %	0,66 %	0,57 %
AU	Indice de référence composite		-12,89 %	-11,65 %	1,03 %	7,45 %	0,66 %	2,33 %
AUM	Indice de référence composite		-12,89 %	-11,65 %	1,03 %	7,45 %	0,66 %	2,32 %
AUP	Indice de référence composite		-12,89 %	-11,65 %	1,03 %	7,45 %	0,66 %	2,33 %
DEC	Indice de référence composite		-12,89 %	-14,56 %	1,03 %	5,63 %	0,66 %	-0,14 %
DEH	Indice de référence composite		-12,89 %	-14,54 %	1,03 %	5,55 %	0,66 %	-0,14 %
DEP	Indice de référence composite		-12,89 %	-6,57 %	1,03 %	14,74 %	0,66 %	-6,82 %
DU	Indice de référence composite		-12,89 %	-12,31 %	1,03 %	6,65 %	0,66 %	1,56 %
DUP	Indice de référence composite		-12,89 %	-12,31 %	1,03 %	6,65 %	0,66 %	1,56 %
ZE	Indice de référence composite		-12,89 %	-5,50 %	1,03 %	16,17 %	0,66 %	-5,65 %
ZEC	Indice de référence composite		-12,89 %	-13,64 %	1,03 %	6,93 %	0,66 %	1,08 %
ZEH	Indice de référence composite		-12,89 %	-13,43 %	1,03 %	6,91 %	0,66 %	1,11 %
ZFH	Indice de référence composite		-12,89 %	-13,93 %	1,03 %	6,59 %	0,66 %	0,89 %
ZU	Indice de référence composite		-12,89 %	-11,20 %	1,03 %	7,98 %	0,66 %	2,84 %
ZUP	Indice de référence composite		-12,89 %	-11,31 %	1,03 %	7,90 %	0,66 %	2,72 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities								
AE	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-28,89 %	-2,22 %	-2,97 %	20,31 %	24,15 %
AEC	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-35,44 %	-2,22 %	-10,90 %	20,31 %	29,65 %
AEH	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-35,45 %	-2,22 %	-10,94 %	20,31 %	29,65 %
AU	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-33,26 %	-2,22 %	-9,83 %	20,31 %	30,12 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities								
<i>(suite)</i>								
AUP	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-33,24 %	-2,22 %	-9,84 %	20,31 %	30,12 %
IE	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-28,17 %	-2,22 %	-2,10 %	20,31 %	24,47 %
IEH	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-34,77 %	-2,22 %	-10,11 %	20,31 %	29,96 %
IG	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-24,11 %	-2,22 %	-8,13 %	20,31 %	21,79 %
IU	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-32,55 %	-2,22 %	-8,98 %	20,31 %	30,48 %
LE	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-27,98 %	-2,22 %	-1,75 %	20,31 %	24,58 %
LG	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-23,85 %	-2,22 %	-7,89 %	20,31 %	21,90 %
XU	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-32,14 %	-2,22 %	-8,41 %	20,31 %	30,71 %
ZE	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-28,31 %	-2,22 %	-2,23 %	20,31 %	24,40 %
ZEC	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-34,99 %	-2,22 %	-10,21 %	20,31 %	29,89 %
ZEH	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-34,98 %	-2,22 %	-10,24 %	20,31 %	29,89 %
ZU	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-32,75 %	-2,22 %	-9,18 %	20,31 %	30,39 %
ZUP	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 24 septembre 2020	-19,74 %	-32,76 %	-2,22 %	-9,18 %	20,31 %	30,38 %
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
AEH	MSCI AC World		-17,96 %	-29,05 %	19,04 %	21,21 %	16,82 %	24,63 %
AEP	MSCI AC World		-17,96 %	-21,68 %	19,04 %	31,78 %	16,82 %	16,31 %
ASH	MSCI AC World	Performance depuis le lancement le 27 avril 2022	-6,07 %	-8,11 %	s.o.	s.o.	s.o.	s.o.
AU	MSCI AC World		-17,96 %	-26,50 %	19,04 %	22,48 %	16,82 %	26,78 %
AUP	MSCI AC World		-17,96 %	-26,50 %	19,04 %	22,48 %	16,82 %	26,78 %
DEH	MSCI AC World		-17,96 %	-29,57 %	19,04 %	20,31 %	16,82 %	23,70 %
DU	MSCI AC World		-17,96 %	-27,05 %	19,04 %	21,57 %	16,82 %	25,84 %
IE	MSCI AC World		-17,96 %	-21,01 %	19,04 %	32,91 %	16,82 %	17,30 %
IEH	MSCI AC World		-17,96 %	-28,45 %	19,04 %	22,24 %	16,82 %	25,69 %
IU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,87 %	19,04 %	23,53 %	16,82 %	27,86 %
IUP	MSCI AC World		-17,96 %	-25,87 %	19,04 %	23,52 %	16,82 %	27,82 %
W	MSCI AC World		-17,96 %	-26,45 %	19,04 %	22,54 %	16,82 %	26,85 %
XU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,33 %	19,04 %	24,52 %	16,82 %	28,89 %
ZE	MSCI AC World		-17,96 %	-21,07 %	19,04 %	32,77 %	16,82 %	17,19 %
ZEH	MSCI AC World	Performance depuis le lancement le 16 septembre 2020	-17,96 %	-28,46 %	19,04 %	22,14 %	12,83 %	9,88 %
ZEP	MSCI AC World		-17,96 %	-21,08 %	19,04 %	32,77 %	16,82 %	17,19 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
<i>(suite)</i>								
ZFH	MSCI AC World	Performance depuis le lancement le 16 septembre 2020	-17,96 %	-28,49 %	19,04 %	21,76 %	12,83 %	9,80 %
ZG	MSCI AC World		-17,96 %	-16,60 %	19,04 %	24,54 %	16,82 %	23,79 %
ZU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,93 %	19,04 %	23,40 %	16,82 %	27,74 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities								
AEH	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-36,61 %	-2,22 %	-10,32 %	18,69 %	31,52 %
AU	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-34,37 %	-2,22 %	-9,25 %	18,69 %	33,80 %
DEH	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-37,08 %	-2,22 %	-10,97 %	18,69 %	30,51 %
DU	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-34,86 %	-2,22 %	-9,93 %	18,69 %	32,80 %
IE	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 6 mai 2020	-19,74 %	-29,48 %	-2,22 %	-1,53 %	46,87 %	47,45 %
IEH	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-36,03 %	-2,22 %	-9,54 %	18,69 %	32,58 %
IU	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-33,81 %	-2,22 %	-8,48 %	18,69 %	34,94 %
XU	MSCI Emerging Markets	Performance depuis le lancement le 17 mars 2022	-8,81 %	-14,47 %	s.o.	s.o.	s.o.	s.o.
ZU	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-33,87 %	-2,22 %	-8,57 %	18,69 %	34,80 %
1E	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-30,04 %	-2,22 %	-2,27 %	18,69 %	22,86 %
1U	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-34,34 %	-2,22 %	-9,17 %	18,69 %	33,92 %
2E	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-29,61 %	-2,22 %	-1,68 %	18,69 %	23,61 %
2U	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-33,94 %	-2,22 %	-8,60 %	18,69 %	34,80 %
8E	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-29,66 %	-2,22 %	-1,71 %	18,69 %	23,56 %
8U	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-33,97 %	-2,22 %	-8,65 %	18,69 %	34,69 %
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income								
AEC	MSCI AC World		-17,96 %	-15,94 %	19,04 %	14,84 %	16,82 %	1,52 %
AUP	MSCI AC World		-17,96 %	-13,10 %	19,04 %	16,13 %	16,82 %	3,23 %
DEC	MSCI AC World		-17,96 %	-16,44 %	19,04 %	14,27 %	16,82 %	0,97 %
DUP	MSCI AC World		-17,96 %	-13,48 %	19,04 %	15,58 %	16,82 %	2,71 %
IU	MSCI AC World		-17,96 %	-12,30 %	19,04 %	17,04 %	16,82 %	4,09 %
TE	MSCI AC World		-17,96 %	-6,62 %	19,04 %	25,75 %	16,82 %	-4,66 %
ZU	MSCI AC World		-17,96 %	-12,43 %	19,04 %	16,99 %	16,82 %	4,02 %
1E	MSCI AC World		-17,96 %	-7,23 %	19,04 %	25,12 %	16,82 %	-5,14 %
1EP	MSCI AC World		-17,96 %	-7,24 %	19,04 %	25,12 %	16,82 %	-5,14 %
1SC	MSCI AC World		-17,96 %	-13,77 %	19,04 %	15,95 %	16,82 %	2,22 %
1SH	MSCI AC World		-17,96 %	-13,79 %	19,04 %	15,95 %	16,82 %	2,18 %
1ST	MSCI AC World		-17,96 %	-13,79 %	19,04 %	15,98 %	16,82 %	2,19 %
1U	MSCI AC World		-17,96 %	-12,94 %	19,04 %	16,29 %	16,82 %	3,40 %
1UP	MSCI AC World		-17,96 %	-12,94 %	19,04 %	16,29 %	16,82 %	3,40 %
1VT	MSCI AC World		-17,96 %	-14,93 %	19,04 %	15,25 %	16,82 %	0,40 %
2E	MSCI AC World		-17,96 %	-6,67 %	19,04 %	25,88 %	16,82 %	-4,56 %
2EP	MSCI AC World		-17,96 %	-6,63 %	19,04 %	25,84 %	16,82 %	-4,53 %
2U	MSCI AC World		-17,96 %	-12,41 %	19,04 %	17,00 %	16,82 %	4,04 %
2UP	MSCI AC World		-17,96 %	-12,37 %	19,04 %	17,03 %	16,82 %	4,03 %
3E	MSCI AC World		-17,96 %	-6,54 %	19,04 %	26,06 %	16,82 %	-4,43 %
3EP	MSCI AC World		-17,96 %	-6,55 %	19,04 %	26,06 %	16,82 %	-4,42 %
3U	MSCI AC World		-17,96 %	-12,29 %	19,04 %	17,16 %	16,82 %	4,18 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income								
<i>(suite)</i>								
3UP	MSCI AC World		-17,96 %	-12,28 %	19,04 %	17,16 %	16,82 %	4,18 %
8E	MSCI AC World		-17,96 %	-6,70 %	19,04 %	25,83 %	16,82 %	-4,60 %
8EP	MSCI AC World		-17,96 %	-6,74 %	19,04 %	25,83 %	16,82 %	-4,63 %
8U	MSCI AC World		-17,96 %	-12,44 %	19,04 %	16,95 %	16,82 %	3,99 %
8UP	MSCI AC World		-17,96 %	-12,44 %	19,04 %	16,95 %	16,82 %	3,99 %
9E	MSCI AC World		-17,96 %	-6,47 %	19,04 %	26,09 %	16,82 %	-4,33 %
9EP	MSCI AC World		-17,96 %	-6,46 %	19,04 %	26,10 %	16,82 %	-4,31 %
9U	MSCI AC World		-17,96 %	-12,21 %	19,04 %	17,22 %	16,82 %	4,33 %
9UP	MSCI AC World		-17,96 %	-12,19 %	19,04 %	17,31 %	16,82 %	4,27 %
Threadneedle (Lux) - Global Select								
IU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,08 %	19,04 %	13,86 %	16,82 %	21,20 %
ZU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,14 %	19,04 %	13,80 %	16,82 %	21,08 %
1E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,79 %	19,04 %	21,61 %	16,82 %	10,40 %
1U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,66 %	19,04 %	13,03 %	16,82 %	20,34 %
2E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,26 %	19,04 %	22,39 %	16,82 %	11,10 %
2U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,20 %	19,04 %	13,72 %	16,82 %	21,07 %
3U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,08 %	19,04 %	13,91 %	16,82 %	21,28 %
8E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,33 %	19,04 %	22,31 %	16,82 %	11,03 %
8U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,23 %	19,04 %	13,67 %	16,82 %	21,03 %
9U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,04 %	19,04 %	13,96 %	16,82 %	21,33 %
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies								
AE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,73 %	25,00 %	22,14 %	6,85 %	27,53 %
AEP	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,73 %	25,00 %	22,14 %	6,85 %	27,53 %
AK	MSCI World Small Cap	Performance depuis le lancement le 10 janvier 2020	-13,02 %	-25,18 %	25,00 %	25,15 %	5,98 %	19,04 %
AUP	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-34,99 %	25,00 %	13,53 %	6,85 %	39,00 %
DE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-31,07 %	25,00 %	21,53 %	6,85 %	26,89 %
IE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,14 %	25,00 %	23,19 %	6,85 %	28,62 %
IEP	MSCI World Small Cap	Performance depuis le lancement le 29 juillet 2020	-13,02 %	-30,14 %	25,00 %	23,19 %	22,69 %	25,47 %
NE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,00 %	25,00 %	23,43 %	6,85 %	28,88 %
XE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-29,58 %	25,00 %	24,17 %	6,85 %	29,65 %
XFH	MSCI World Small Cap	Performance depuis le lancement le 11 novembre 2020	-13,02 %	-29,72 %	25,00 %	23,86 %	8,50 %	9,06 %
XG	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-25,51 %	25,00 %	16,50 %	6,85 %	36,89 %
XGH	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-28,82 %	25,00 %	24,53 %	6,85 %	28,85 %
XU	MSCI World Small Cap	Performance depuis le lancement le 11 novembre 2020	-13,02 %	-33,91 %	25,00 %	15,41 %	8,50 %	12,89 %
ZE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,21 %	25,00 %	23,06 %	6,85 %	28,49 %
ZFH	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,44 %	25,00 %	22,60 %	6,85 %	28,16 %
ZG	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-26,25 %	25,00 %	15,43 %	6,85 %	35,73 %
ZGH	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-29,52 %	25,00 %	23,29 %	6,85 %	27,70 %
ZU	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-34,50 %	25,00 %	14,38 %	6,85 %	40,06 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - American								
AEH	S&P 500		-18,11 %	-23,95 %	28,71 %	23,73 %	18,40 %	18,60 %
AU	S&P 500		-18,11 %	-21,30 %	28,71 %	24,99 %	18,40 %	20,51 %
DEH	S&P 500		-18,11 %	-24,26 %	28,71 %	23,30 %	18,40 %	18,17 %
DU	S&P 500		-18,11 %	-21,58 %	28,71 %	24,56 %	18,40 %	20,08 %
IEH	S&P 500		-18,11 %	-23,32 %	28,71 %	24,85 %	18,40 %	19,66 %
IU	S&P 500		-18,11 %	-20,59 %	28,71 %	26,12 %	18,40 %	21,59 %
W	S&P 500		-18,11 %	-21,07 %	28,71 %	25,37 %	18,40 %	20,87 %
ZE	S&P 500		-18,11 %	-15,51 %	28,71 %	35,57 %	18,40 %	11,43 %
ZEH	S&P 500		-18,11 %	-23,37 %	28,71 %	24,73 %	18,40 %	19,56 %
ZU	S&P 500		-18,11 %	-20,75 %	28,71 %	26,02 %	18,40 %	21,42 %
1E	S&P 500		-18,11 %	-16,04 %	28,71 %	34,66 %	18,40 %	10,70 %
1EH	S&P 500		-18,11 %	-23,87 %	28,71 %	23,90 %	18,40 %	18,71 %
1EP	S&P 500		-18,11 %	-16,04 %	28,71 %	34,65 %	18,40 %	10,70 %
1U	S&P 500		-18,11 %	-21,20 %	28,71 %	25,15 %	18,40 %	20,66 %
2E	S&P 500		-18,11 %	-15,52 %	28,71 %	35,48 %	18,40 %	11,37 %
2U	S&P 500		-18,11 %	-20,72 %	28,71 %	25,92 %	18,40 %	21,40 %
3EH	S&P 500		-18,11 %	-23,29 %	28,71 %	24,90 %	18,40 %	19,63 %
3U	S&P 500		-18,11 %	-20,58 %	28,71 %	26,15 %	18,40 %	21,62 %
8E	S&P 500		-18,11 %	-15,56 %	28,71 %	35,43 %	18,40 %	11,33 %
8U	S&P 500		-18,11 %	-20,75 %	28,71 %	25,87 %	18,40 %	21,35 %
9EH	S&P 500		-18,11 %	-23,27 %	28,71 %	24,99 %	18,40 %	19,78 %
9U	S&P 500		-18,11 %	-20,54 %	28,71 %	26,20 %	18,40 %	21,67 %
Threadneedle (Lux) - American Select								
AD	S&P 500		-18,11 %	-19,29 %	28,71 %	29,73 %	18,40 %	13,52 %
AEH	S&P 500		-18,11 %	-26,87 %	28,71 %	19,50 %	18,40 %	22,24 %
AN	S&P 500		-18,11 %	-15,37 %	28,71 %	24,30 %	18,40 %	21,04 %
AU	S&P 500		-18,11 %	-24,19 %	28,71 %	20,68 %	18,40 %	24,22 %
DEH	S&P 500		-18,11 %	-27,38 %	28,71 %	18,57 %	18,40 %	21,33 %
DU	S&P 500		-18,11 %	-24,76 %	28,71 %	19,78 %	18,40 %	23,29 %
ID	S&P 500		-18,11 %	-18,57 %	28,71 %	30,76 %	18,40 %	14,42 %
IE	S&P 500		-18,11 %	-18,58 %	28,71 %	30,84 %	18,40 %	14,82 %
IEH	S&P 500		-18,11 %	-26,26 %	28,71 %	20,45 %	18,40 %	23,20 %
IN	S&P 500		-18,11 %	-14,62 %	28,71 %	25,26 %	18,40 %	21,96 %
W	S&P 500		-18,11 %	-24,15 %	28,71 %	20,74 %	18,40 %	24,28 %
ZEH	S&P 500		-18,11 %	-26,40 %	28,71 %	20,30 %	18,40 %	23,14 %
ZU	S&P 500		-18,11 %	-23,66 %	28,71 %	21,52 %	18,40 %	25,09 %
1E	S&P 500		-18,11 %	-19,12 %	28,71 %	30,01 %	18,40 %	14,11 %
1EH	S&P 500		-18,11 %	-26,76 %	28,71 %	19,66 %	18,40 %	22,39 %
1EP	S&P 500		-18,11 %	-19,12 %	28,71 %	30,00 %	18,40 %	14,11 %
1U	S&P 500		-18,11 %	-24,09 %	28,71 %	20,83 %	18,40 %	24,38 %
2EH	S&P 500		-18,11 %	-26,31 %	28,71 %	20,44 %	18,40 %	23,19 %
2U	S&P 500		-18,11 %	-23,63 %	28,71 %	21,59 %	18,40 %	25,16 %
3E	S&P 500		-18,11 %	-18,47 %	28,71 %	31,05 %	18,40 %	15,02 %
3U	S&P 500		-18,11 %	-23,48 %	28,71 %	21,80 %	18,40 %	25,37 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - American Select								
<i>(suite)</i>								
8EH	S&P 500		-18,11 %	-26,33 %	28,71 %	20,29 %	18,40 %	23,12 %
8U	S&P 500		-18,11 %	-23,66 %	28,71 %	21,52 %	18,40 %	25,09 %
9E	S&P 500		-18,11 %	-18,46 %	28,71 %	31,17 %	18,40 %	15,12 %
9U	S&P 500		-18,11 %	-23,45 %	28,71 %	21,87 %	18,40 %	25,46 %
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies								
AEH	Russell 2500		-18,37 %	-20,84 %	18,18 %	22,12 %	19,99 %	28,44 %
ASH	Russell 2500	Performance depuis le lancement le 27 avril 2022	-6,16 %	-7,59 %	s.o.	s.o.	s.o.	s.o.
AU	Russell 2500		-18,37 %	-18,04 %	18,18 %	23,60 %	19,99 %	30,64 %
DEH	Russell 2500		-18,37 %	-21,28 %	18,18 %	21,51 %	19,99 %	27,81 %
DU	Russell 2500		-18,37 %	-18,45 %	18,18 %	22,99 %	19,99 %	30,06 %
IE	Russell 2500		-18,37 %	-11,93 %	18,18 %	34,11 %	19,99 %	20,86 %
IU	Russell 2500		-18,37 %	-17,35 %	18,18 %	24,66 %	19,99 %	31,79 %
ZU	Russell 2500		-18,37 %	-17,43 %	18,18 %	24,54 %	19,99 %	31,71 %
1E	Russell 2500		-18,37 %	-12,57 %	18,18 %	33,15 %	19,99 %	20,05 %
1EP	Russell 2500		-18,37 %	-12,57 %	18,18 %	33,14 %	19,99 %	20,06 %
1U	Russell 2500		-18,37 %	-17,95 %	18,18 %	23,75 %	19,99 %	30,86 %
2U	Russell 2500		-18,37 %	-17,44 %	18,18 %	24,51 %	19,99 %	31,66 %
3EH	Russell 2500		-18,37 %	-19,99 %	18,18 %	23,19 %	19,99 %	29,63 %
3U	Russell 2500		-18,37 %	-17,33 %	18,18 %	24,68 %	19,99 %	31,84 %
8U	Russell 2500		-18,37 %	-17,48 %	18,18 %	24,46 %	19,99 %	31,61 %
9EH	Russell 2500		-18,37 %	-20,13 %	18,18 %	23,20 %	19,99 %	29,69 %
9U	Russell 2500		-18,37 %	-17,30 %	18,18 %	24,73 %	19,99 %	31,89 %
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity								
AE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-19,96 %	-2,65 %	-0,40 %	22,75 %	13,91 %
AF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,81 %	-2,65 %	-4,62 %	22,75 %	13,34 %
AS	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-25,26 %	-2,65 %	-5,58 %	22,75 %	21,97 %
ASH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-25,75 %	-2,65 %	-7,80 %	22,75 %	22,68 %
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-24,88 %	-2,65 %	-7,43 %	22,75 %	24,14 %
DE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-20,55 %	-2,65 %	-1,14 %	22,75 %	13,04 %
IF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-22,96 %	-2,65 %	-3,76 %	22,75 %	14,26 %
ISH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-25,04 %	-2,65 %	-7,00 %	22,75 %	23,72 %
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-24,23 %	-2,65 %	-6,64 %	22,75 %	25,20 %
XU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,63 %	-2,65 %	-5,89 %	22,75 %	26,21 %
XUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,63 %	-2,65 %	-5,89 %	22,75 %	26,21 %
ZE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-19,40 %	-2,65 %	0,35 %	22,75 %	14,75 %
ZEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-26,72 %	-2,65 %	-7,83 %	22,75 %	22,88 %
ZF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,20 %	-2,65 %	-3,87 %	22,75 %	14,21 %
ZG	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-14,83 %	-2,65 %	-5,85 %	22,75 %	21,19 %
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-24,31 %	-2,65 %	-6,73 %	22,75 %	25,08 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Asia Equities								
AE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Performance depuis le lancement le 10 juin 2021	-17,19 %	-19,62 %	-8,64 %	-3,78 %	s.o.	s.o.
AEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Performance depuis le lancement le 10 juin 2021	-17,19 %	-26,93 %	-8,64 %	-10,74 %	s.o.	s.o.
DE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Performance depuis le lancement le 10 juin 2021	-17,19 %	-20,00 %	-8,64 %	-4,02 %	s.o.	s.o.
DEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Performance depuis le lancement le 10 juin 2021	-17,19 %	-27,28 %	-8,64 %	-10,98 %	s.o.	s.o.
IE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-18,82 %	-2,65 %	2,96 %	22,75 %	17,53 %
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,81 %	-2,65 %	-4,31 %	22,75 %	28,11 %
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,89 %	-2,65 %	-4,40 %	22,75 %	27,99 %
1E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-19,43 %	-2,65 %	2,19 %	22,75 %	16,65 %
1U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-24,38 %	-2,65 %	-5,02 %	22,75 %	27,15 %
2E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-18,89 %	-2,65 %	2,82 %	22,75 %	17,36 %
2U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,92 %	-2,65 %	-4,44 %	22,75 %	27,93 %
3U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,81 %	-2,65 %	-4,31 %	22,75 %	28,11 %
8E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-18,97 %	-2,65 %	2,78 %	22,75 %	17,25 %
8U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,95 %	-2,65 %	-4,48 %	22,75 %	27,88 %
9U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,78 %	-2,65 %	-4,27 %	22,75 %	28,16 %
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
AEC	S&P 500		-18,11 %	-22,47 %	28,71 %	20,75 %	18,40 %	18,72 %
AEH	S&P 500		-18,11 %	-22,43 %	28,71 %	20,75 %	18,40 %	18,55 %
AU	S&P 500		-18,11 %	-19,79 %	28,71 %	22,01 %	18,40 %	20,48 %
AUP	S&P 500		-18,11 %	-19,79 %	28,71 %	22,01 %	18,40 %	20,48 %
DU	S&P 500		-18,11 %	-20,19 %	28,71 %	21,40 %	18,40 %	19,88 %
IU	S&P 500		-18,11 %	-19,15 %	28,71 %	22,99 %	18,40 %	21,45 %
XS	S&P 500		-18,11 %	-18,79 %	28,71 %	26,59 %	18,40 %	20,54 %
XSH	S&P 500		-18,11 %	-19,24 %	28,71 %	23,81 %	18,40 %	21,24 %
ZEH	S&P 500		-18,11 %	-21,85 %	28,71 %	21,65 %	18,40 %	19,39 %
ZFH	S&P 500		-18,11 %	-21,90 %	28,71 %	21,29 %	18,40 %	19,27 %
ZGH	S&P 500		-18,11 %	-21,03 %	28,71 %	22,11 %	18,40 %	18,83 %
ZU	S&P 500		-18,11 %	-19,19 %	28,71 %	22,93 %	18,40 %	21,39 %
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities								
AE	S&P 500		-18,11 %	-14,00 %	28,71 %	43,84 %	18,40 %	-0,94 %
AEH	S&P 500		-18,11 %	-21,86 %	28,71 %	32,34 %	18,40 %	6,15 %
AU	S&P 500		-18,11 %	-19,23 %	28,71 %	33,69 %	18,40 %	7,97 %
AUP	S&P 500		-18,11 %	-19,21 %	28,71 %	33,70 %	18,40 %	7,97 %
DE	S&P 500		-18,11 %	-14,17 %	28,71 %	43,55 %	18,40 %	-1,14 %
DEH	S&P 500		-18,11 %	-22,02 %	28,71 %	32,08 %	18,40 %	5,98 %
DU	S&P 500		-18,11 %	-19,45 %	28,71 %	33,42 %	18,40 %	7,76 %
IE	S&P 500		-18,11 %	-13,73 %	28,71 %	44,35 %	18,40 %	-0,64 %
IEC	S&P 500		-18,11 %	-21,68 %	28,71 %	32,81 %	18,40 %	6,54 %
IEH	S&P 500		-18,11 %	-21,69 %	28,71 %	32,84 %	18,40 %	6,50 %
IFH	S&P 500		-18,11 %	-21,68 %	28,71 %	32,50 %	18,40 %	6,38 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities								
<i>(suite)</i>								
IG	S&P 500		-18,11 %	-8,80 %	28,71 %	35,45 %	18,40 %	5,05 %
IU	S&P 500		-18,11 %	-19,03 %	28,71 %	34,19 %	18,40 %	8,35 %
NE	S&P 500	Performance depuis le lancement le 18 septembre 2020	-18,11 %	-13,50 %	28,71 %	44,70 %	12,39 %	7,24 %
NG	S&P 500	Performance depuis le lancement le 18 septembre 2020	-18,11 %	-8,67 %	28,71 %	35,62 %	12,39 %	5,28 %
NU	S&P 500	Performance depuis le lancement le 18 septembre 2020	-18,11 %	-18,88 %	28,71 %	34,41 %	12,39 %	11,13 %
XG	S&P 500	Performance depuis le lancement le 20 mai 2020	-18,11 %	-8,56 %	28,71 %	35,73 %	29,86 %	5,63 %
ZEH	S&P 500		-18,11 %	-21,75 %	28,71 %	32,69 %	18,40 %	6,44 %
ZFH	S&P 500		-18,11 %	-21,69 %	28,71 %	32,38 %	18,40 %	6,24 %
ZU	S&P 500		-18,11 %	-19,09 %	28,71 %	34,02 %	18,40 %	8,24 %
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities								
AE	MSCI Europe		-8,92 %	-18,93 %	25,85 %	28,58 %	-2,82 %	6,41 %
ASH	MSCI Europe		-8,92 %	-17,14 %	25,85 %	29,32 %	-2,82 %	6,82 %
AUH	MSCI Europe		-8,92 %	-16,35 %	25,85 %	29,60 %	-2,82 %	7,77 %
DE	MSCI Europe		-8,92 %	-19,09 %	25,85 %	28,32 %	-2,82 %	6,08 %
IE	MSCI Europe		-8,92 %	-18,32 %	25,85 %	29,55 %	-2,82 %	7,29 %
W	MSCI Europe		-8,92 %	-19,06 %	25,85 %	28,32 %	-2,82 %	6,40 %
XE	MSCI Europe		-8,92 %	-17,75 %	25,85 %	30,39 %	-2,82 %	8,12 %
ZE	MSCI Europe	Performance depuis le lancement le 15 juillet 2021	-8,92 %	-18,50 %	6,81 %	9,50 %	s.o.	s.o.
ZUH	MSCI Europe		-8,92 %	-15,90 %	25,85 %	30,33 %	-2,82 %	8,53 %
1E	MSCI Europe		-8,92 %	-18,93 %	25,85 %	28,61 %	-2,82 %	6,47 %
1EP	MSCI Europe		-8,92 %	-18,94 %	25,85 %	28,57 %	-2,82 %	6,41 %
1G	MSCI Europe		-8,92 %	-14,34 %	25,85 %	20,63 %	-2,82 %	12,48 %
1GP	MSCI Europe		-8,92 %	-14,30 %	25,85 %	20,59 %	-2,82 %	12,43 %
2E	MSCI Europe		-8,92 %	-18,57 %	25,85 %	29,19 %	-2,82 %	7,11 %
2G	MSCI Europe		-8,92 %	-13,95 %	25,85 %	21,18 %	-2,82 %	13,15 %
2U	MSCI Europe		-8,92 %	-23,52 %	25,85 %	20,14 %	-2,82 %	16,81 %
3E	MSCI Europe		-8,92 %	-18,45 %	25,85 %	29,36 %	-2,82 %	7,26 %
3G	MSCI Europe		-8,92 %	-13,83 %	25,85 %	21,35 %	-2,82 %	13,31 %
3GP	MSCI Europe		-8,92 %	-13,81 %	25,85 %	21,38 %	-2,82 %	13,26 %
4E	MSCI Europe		-8,92 %	-17,75 %	25,85 %	30,48 %	-2,82 %	8,19 %
4G	MSCI Europe		-8,92 %	-13,06 %	25,85 %	22,45 %	-2,82 %	14,32 %
8E	MSCI Europe		-8,92 %	-18,60 %	25,85 %	29,13 %	-2,82 %	7,07 %
8G	MSCI Europe		-8,92 %	-13,98 %	25,85 %	21,13 %	-2,82 %	13,11 %
8U	MSCI Europe		-8,92 %	-23,55 %	25,85 %	20,13 %	-2,82 %	16,78 %
9E	MSCI Europe		-8,92 %	-18,40 %	25,85 %	29,42 %	-2,82 %	7,45 %
9G	MSCI Europe		-8,92 %	-13,79 %	25,85 %	21,38 %	-2,82 %	13,41 %
9GP	MSCI Europe		-8,92 %	-13,75 %	25,85 %	21,39 %	-2,82 %	13,41 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend								
AE	MSCI Europe		-8,92 %	-16,35 %	25,85 %	20,28 %	-2,82 %	0,02 %
AEP	MSCI Europe		-8,92 %	-16,35 %	25,85 %	20,27 %	-2,82 %	0,05 %
AUP	MSCI Europe		-8,92 %	-21,57 %	25,85 %	11,75 %	-2,82 %	8,99 %
DE	MSCI Europe		-8,92 %	-16,65 %	25,85 %	19,85 %	-2,82 %	-0,35 %
DEP	MSCI Europe		-8,92 %	-16,65 %	25,85 %	19,85 %	-2,82 %	-0,32 %
IE	MSCI Europe		-8,92 %	-15,39 %	25,85 %	21,42 %	-2,82 %	0,86 %
IEP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,39 %	25,85 %	21,42 %	-2,82 %	0,89 %
ZE	MSCI Europe		-8,92 %	-15,81 %	25,85 %	21,18 %	-2,82 %	0,80 %
ZEP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,72 %	25,85 %	21,18 %	-2,82 %	0,76 %
1E	MSCI Europe		-8,92 %	-16,27 %	25,85 %	20,39 %	-2,82 %	0,15 %
1EP	MSCI Europe		-8,92 %	-16,27 %	25,85 %	20,38 %	-2,82 %	0,15 %
1G	MSCI Europe		-8,92 %	-11,52 %	25,85 %	12,93 %	-2,82 %	5,79 %
1GP	MSCI Europe		-8,92 %	-11,53 %	25,85 %	12,92 %	-2,82 %	5,78 %
2E	MSCI Europe		-8,92 %	-15,76 %	25,85 %	21,13 %	-2,82 %	0,76 %
2EP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,71 %	25,85 %	21,24 %	-2,82 %	0,78 %
2G	MSCI Europe		-8,92 %	-10,94 %	25,85 %	13,71 %	-2,82 %	6,50 %
2GP	MSCI Europe		-8,92 %	-10,94 %	25,85 %	13,72 %	-2,82 %	6,48 %
3EP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,64 %	25,85 %	21,30 %	-2,82 %	0,90 %
3G	MSCI Europe		-8,92 %	-10,85 %	25,85 %	13,77 %	-2,82 %	6,59 %
3GP	MSCI Europe		-8,92 %	-10,87 %	25,85 %	13,78 %	-2,82 %	6,58 %
4GP	MSCI Europe		-8,92 %	-10,10 %	25,85 %	14,76 %	-2,82 %	7,50 %
8E	MSCI Europe		-8,92 %	-15,79 %	25,85 %	21,08 %	-2,82 %	0,72 %
8EP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,80 %	25,85 %	21,08 %	-2,82 %	0,71 %
8G	MSCI Europe		-8,92 %	-11,02 %	25,85 %	13,57 %	-2,82 %	6,40 %
8GP	MSCI Europe		-8,92 %	-11,02 %	25,85 %	13,57 %	-2,82 %	6,38 %
9EP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,54 %	25,85 %	21,37 %	-2,82 %	1,04 %
9G	MSCI Europe		-8,92 %	-10,81 %	25,85 %	13,83 %	-2,82 %	6,65 %
9GP	MSCI Europe		-8,92 %	-10,78 %	25,85 %	13,78 %	-2,82 %	6,69 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities								
AE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-35,76 %	23,41 %	22,58 %	7,78 %	13,08 %
ASH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,25 %	23,41 %	23,34 %	7,78 %	13,61 %
AUH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,53 %	23,41 %	23,69 %	7,78 %	14,73 %
DE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-36,33 %	23,41 %	21,48 %	7,78 %	12,07 %
DUH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,16 %	23,41 %	22,60 %	7,78 %	13,74 %
IE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-35,27 %	23,41 %	23,50 %	7,78 %	13,93 %
W	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-35,79 %	23,41 %	22,52 %	7,78 %	13,03 %
XE	EMIX Smaller European Companies	Performance depuis le lancement le 25 février 2022	-10,26 %	-14,98 %	s.o.	s.o.	s.o.	s.o.
ZE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-35,27 %	23,41 %	23,50 %	7,78 %	13,93 %
ZFH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-35,41 %	23,41 %	23,07 %	7,78 %	13,72 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies								
IE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,00 %	23,41 %	20,83 %	7,78 %	9,80 %
ZE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,10 %	23,41 %	20,65 %	7,78 %	9,63 %
1E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,51 %	23,41 %	19,91 %	7,78 %	8,96 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies								
<i>(suite)</i>								
1EP	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,51 %	23,41 %	19,91 %	7,78 %	8,96 %
1FH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,62 %	23,41 %	19,48 %	7,78 %	8,77 %
1G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,79 %	23,41 %	12,47 %	7,78 %	15,10 %
1UH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-32,25 %	23,41 %	20,95 %	7,78 %	10,56 %
2E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,08 %	23,41 %	20,69 %	7,78 %	9,67 %
2G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,36 %	23,41 %	13,25 %	7,78 %	15,91 %
3E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,97 %	23,41 %	20,88 %	7,78 %	9,84 %
3EP	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,97 %	23,41 %	20,88 %	7,78 %	9,84 %
3FH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,09 %	23,41 %	20,44 %	7,78 %	9,65 %
3G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,23 %	23,41 %	13,39 %	7,78 %	16,03 %
3GP	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,23 %	23,41 %	13,39 %	7,78 %	16,02 %
3UH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-31,70 %	23,41 %	21,93 %	7,78 %	11,45 %
4E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,42 %	23,41 %	21,90 %	7,78 %	10,77 %
4G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-29,64 %	23,41 %	14,34 %	7,78 %	17,01 %
8E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,11 %	23,41 %	20,64 %	7,78 %	9,62 %
8G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,37 %	23,41 %	13,16 %	7,78 %	15,80 %
9E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,95 %	23,41 %	20,93 %	7,78 %	9,89 %
9EP	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,88 %	23,41 %	20,99 %	7,78 %	9,99 %
9FH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,06 %	23,41 %	20,47 %	7,78 %	9,72 %
9G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,20 %	23,41 %	13,43 %	7,78 %	16,08 %
9GP	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,11 %	23,41 %	13,48 %	7,78 %	16,16 %
9UH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-31,67 %	23,41 %	21,99 %	7,78 %	11,48 %
Threadneedle (Lux) - European Select								
AE	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-22,44 %	25,16 %	25,17 %	2,83 %	8,47 %
AGH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,55 %	25,16 %	25,60 %	2,83 %	8,30 %
AUH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-19,94 %	25,16 %	26,16 %	2,83 %	9,89 %
DUH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-20,38 %	25,16 %	25,49 %	2,83 %	9,28 %
IE	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,78 %	25,16 %	26,23 %	2,83 %	9,40 %
ZE	FTSE World Europe ex UK	Performance depuis le lancement le 14 octobre 2021	-11,97 %	-21,93 %	6,24 %	5,96 %	s.o.	s.o.
ZG	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-17,42 %	25,16 %	18,29 %	2,83 %	15,45 %
ZGH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-20,94 %	25,16 %	26,53 %	2,83 %	9,08 %
1E	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-22,32 %	25,16 %	25,35 %	2,83 %	8,63 %
1EP	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-22,32 %	25,16 %	25,35 %	2,83 %	8,63 %
1SH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-20,58 %	25,16 %	26,12 %	2,83 %	9,20 %
1U	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-27,10 %	25,16 %	16,51 %	2,83 %	18,41 %
1UH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-19,79 %	25,16 %	26,35 %	2,83 %	10,09 %
2E	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,86 %	25,16 %	26,09 %	2,83 %	9,28 %
2EP	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,84 %	25,16 %	26,12 %	2,83 %	9,35 %
3E	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,72 %	25,16 %	26,32 %	2,83 %	9,47 %
3U	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-26,54 %	25,16 %	17,41 %	2,83 %	19,33 %
8E	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,89 %	25,16 %	26,04 %	2,83 %	9,23 %
8EP	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,89 %	25,16 %	26,04 %	2,83 %	9,23 %
9E	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,69 %	25,16 %	26,37 %	2,83 %	9,52 %
9U	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-26,50 %	25,16 %	17,50 %	2,83 %	19,47 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies								
IE	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,90 %	23,02 %	22,87 %	12,55 %	14,97 %
ZE	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,00 %	23,02 %	22,69 %	12,55 %	14,80 %
1E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,44 %	23,02 %	21,93 %	12,55 %	14,09 %
1EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,44 %	23,02 %	21,93 %	12,55 %	14,09 %
1FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,53 %	23,02 %	21,45 %	12,55 %	13,84 %
2E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,98 %	23,02 %	22,73 %	12,55 %	14,83 %
3E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,88 %	23,02 %	22,90 %	12,55 %	14,99 %
3EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,88 %	23,02 %	22,90 %	12,55 %	14,99 %
3FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,03 %	23,02 %	22,41 %	12,55 %	14,74 %
8E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,01 %	23,02 %	22,68 %	12,55 %	14,78 %
9E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,86 %	23,02 %	22,95 %	12,55 %	15,04 %
9EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,86 %	23,02 %	22,95 %	12,55 %	15,04 %
9FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,02 %	23,02 %	22,45 %	12,55 %	14,77 %
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income								
AEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-19,13 %	-2,65 %	0,42 %	22,75 %	21,55 %
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-16,48 %	-2,65 %	1,49 %	22,75 %	23,68 %
AUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-16,48 %	-2,65 %	1,49 %	22,75 %	23,68 %
DEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-19,69 %	-2,65 %	-0,34 %	22,75 %	20,64 %
DU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-17,10 %	-2,65 %	0,74 %	22,75 %	22,76 %
DUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-17,10 %	-2,65 %	0,74 %	22,75 %	22,76 %
IEP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-10,26 %	-2,65 %	10,12 %	22,75 %	14,36 %
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-15,73 %	-2,65 %	2,29 %	22,75 %	24,68 %
W	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-16,65 %	-2,65 %	1,29 %	22,75 %	23,43 %
XU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-15,09 %	-2,65 %	3,18 %	22,75 %	25,74 %
XUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-15,09 %	-2,65 %	3,18 %	22,75 %	25,74 %
ZG	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-5,37 %	-2,65 %	3,16 %	22,75 %	20,82 %
ZGH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-17,58 %	-2,65 %	1,50 %	22,75 %	21,94 %
ZGP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-5,39 %	-2,65 %	3,16 %	22,75 %	20,76 %
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Performance depuis le lancement le 11 novembre 2021	-17,19 %	-15,93 %	-2,63 %	1,62 %	s.o.	s.o.
ZUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-15,85 %	-2,65 %	2,26 %	22,75 %	24,61 %
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
AEH	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-34,58 %	30,15 %	36,06 %	44,26 %	40,63 %
AS	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-32,40 %	30,15 %	40,24 %	44,26 %	40,53 %
AU	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-32,05 %	30,15 %	37,48 %	44,26 %	42,98 %
AUP	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-32,05 %	30,15 %	37,48 %	44,26 %	42,98 %
BU	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-32,32 %	30,15 %	36,93 %	44,26 %	42,41 %
DEH	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-34,77 %	30,15 %	35,58 %	44,26 %	40,18 %
DU	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-32,28 %	30,15 %	37,00 %	44,26 %	42,48 %
IE	MSCI World Information Technology	Performance depuis le lancement le 10 janvier 2020	-30,60 %	-26,94 %	30,15 %	49,26 %	40,01 %	27,46 %
IEH	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-34,00 %	30,15 %	37,27 %	44,26 %	41,91 %
IG	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-22,79 %	30,15 %	40,01 %	44,26 %	39,81 %
IU	MSCI World Information Technology	Performance depuis le lancement le 10 janvier 2020	-30,60 %	-31,43 %	30,15 %	38,72 %	40,01 %	40,48 %
ZEH	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-34,05 %	30,15 %	37,14 %	44,26 %	41,73 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
<i>(suite)</i>								
ZFH	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-33,94 %	30,15 %	36,74 %	44,26 %	41,68 %
ZG	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-22,87 %	30,15 %	39,88 %	44,26 %	39,67 %
ZU	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-31,50 %	30,15 %	38,58 %	44,26 %	44,12 %
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
AE	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 12 février 2020	0,34 %	-11,85 %	18,32 %	16,67 %	-9,32 %	-15,31 %
AEH	FTSE All Share		0,34 %	-8,20 %	18,32 %	8,76 %	-9,82 %	-11,08 %
AFH	FTSE All Share		0,34 %	-8,21 %	18,32 %	8,55 %	-9,82 %	-11,06 %
AG	FTSE All Share		0,34 %	-6,85 %	18,32 %	9,44 %	-9,82 %	-11,26 %
AGP	FTSE All Share		0,34 %	-6,85 %	18,32 %	9,44 %	-9,82 %	-11,26 %
DEH	FTSE All Share		0,34 %	-8,90 %	18,32 %	7,90 %	-9,82 %	-11,77 %
DG	FTSE All Share		0,34 %	-7,59 %	18,32 %	8,56 %	-9,82 %	-11,97 %
IE	FTSE All Share		0,34 %	-11,01 %	18,32 %	17,84 %	-9,82 %	-15,11 %
IEH	FTSE All Share		0,34 %	-7,32 %	18,32 %	9,79 %	-9,82 %	-10,24 %
IG	FTSE All Share		0,34 %	-5,96 %	18,32 %	10,48 %	-9,82 %	-10,41 %
IGP	FTSE All Share		0,34 %	-5,96 %	18,32 %	10,48 %	-9,82 %	-10,41 %
NEH	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 28 octobre 2020	0,34 %	-7,06 %	18,32 %	10,02 %	14,13 %	18,52 %
NFH	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 28 octobre 2020	0,34 %	-7,10 %	18,32 %	9,83 %	14,13 %	18,55 %
NG	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 28 octobre 2020	0,34 %	-5,80 %	18,32 %	10,72 %	14,13 %	18,66 %
NGP	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 28 octobre 2020	0,34 %	-5,71 %	18,32 %	10,75 %	14,13 %	18,66 %
NUH	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 28 octobre 2020	0,34 %	-4,31 %	18,32 %	11,11 %	14,13 %	18,86 %
TEH	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 28 octobre 2020	0,34 %	-7,10 %	18,32 %	9,99 %	14,13 %	18,52 %
TFH	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 28 octobre 2020	0,34 %	-7,14 %	18,32 %	9,77 %	14,13 %	18,55 %
TG	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 28 octobre 2020	0,34 %	-5,76 %	18,32 %	10,72 %	14,13 %	18,66 %
TGP	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 28 octobre 2020	0,34 %	-5,77 %	18,32 %	10,72 %	14,13 %	18,66 %
TUH	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 28 octobre 2020	0,34 %	-4,32 %	18,32 %	11,08 %	14,13 %	18,86 %
ZE	FTSE All Share	Performance depuis le lancement le 12 février 2020	0,34 %	-11,21 %	18,32 %	17,53 %	-9,32 %	-14,76 %
ZEH	FTSE All Share		0,34 %	-7,52 %	18,32 %	9,58 %	-9,82 %	-10,44 %
ZFH	FTSE All Share		0,34 %	-7,53 %	18,32 %	9,39 %	-9,82 %	-10,43 %
ZG	FTSE All Share		0,34 %	-6,15 %	18,32 %	10,26 %	-9,82 %	-10,59 %
ZGP	FTSE All Share		0,34 %	-6,15 %	18,32 %	10,26 %	-9,82 %	-10,59 %
ZUH	FTSE All Share	Était inactif du 24 septembre 2020 au 20 novembre 2020	0,34 %	-4,70 %	18,32 %	10,65 %	2,92 %	4,04 %
3EH	FTSE All Share		0,34 %	-7,35 %	18,32 %	9,78 %	-9,82 %	-10,25 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
<i>(suite)</i>								
3FH	FTSE All Share	Performance depuis le 24 novembre 2020	0,34 %	-7,37 %	18,32 %	9,60 %	2,80 %	4,44 %
3UH	FTSE All Share		0,34 %	-4,58 %	18,32 %	10,85 %	-9,82 %	-8,79 %
9EH	FTSE All Share		0,34 %	-7,24 %	18,32 %	9,80 %	-9,82 %	-10,27 %
9EP	FTSE All Share		0,34 %	-10,99 %	18,32 %	17,80 %	-9,82 %	-15,17 %
9FH	FTSE All Share		0,34 %	-7,33 %	18,32 %	9,64 %	-9,82 %	-10,23 %
9G	FTSE All Share		0,34 %	-5,94 %	18,32 %	10,50 %	-9,82 %	-10,40 %
9UH	FTSE All Share		0,34 %	-4,63 %	18,32 %	10,89 %	-9,82 %	-8,85 %
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
AE	FTSE All Share		0,34 %	-8,75 %	18,32 %	25,96 %	-9,82 %	-12,97 %
AEC	FTSE All Share		0,34 %	-4,98 %	18,32 %	17,40 %	-9,82 %	-8,16 %
AEH	FTSE All Share		0,34 %	-4,99 %	18,32 %	17,39 %	-9,82 %	-8,19 %
AG	FTSE All Share		0,34 %	-3,58 %	18,32 %	18,15 %	-9,82 %	-8,07 %
ASC	FTSE All Share		0,34 %	-3,02 %	18,32 %	18,24 %	-9,82 %	-7,63 %
AUC	FTSE All Share		0,34 %	-2,35 %	18,32 %	18,42 %	-9,82 %	-6,82 %
DE	FTSE All Share		0,34 %	-9,43 %	18,32 %	25,02 %	-9,82 %	-13,62 %
DEC	FTSE All Share		0,34 %	-5,68 %	18,32 %	16,41 %	-9,82 %	-8,95 %
DEH	FTSE All Share		0,34 %	-5,69 %	18,32 %	16,49 %	-9,82 %	-8,86 %
DG	FTSE All Share		0,34 %	-4,30 %	18,32 %	17,27 %	-9,82 %	-8,76 %
DGP	FTSE All Share		0,34 %	-4,32 %	18,32 %	17,15 %	-9,82 %	-8,79 %
IE	FTSE All Share		0,34 %	-7,88 %	18,32 %	27,16 %	-9,82 %	-12,14 %
IEH	FTSE All Share		0,34 %	-4,18 %	18,32 %	18,49 %	-9,82 %	-7,33 %
IG	FTSE All Share		0,34 %	-2,66 %	18,32 %	19,27 %	-9,82 %	-7,19 %
IGP	FTSE All Share		0,34 %	-2,66 %	18,32 %	19,28 %	-9,82 %	-7,19 %
IU	FTSE All Share		0,34 %	-13,55 %	18,32 %	18,18 %	-9,82 %	-4,23 %
IUH	FTSE All Share		0,34 %	-1,30 %	18,32 %	19,70 %	-9,82 %	-5,72 %
LG	FTSE All Share		0,34 %	-2,51 %	18,32 %	19,45 %	-9,82 %	-7,05 %
LGP	FTSE All Share		0,34 %	-2,51 %	18,32 %	19,45 %	-9,82 %	-7,05 %
ZE	FTSE All Share		0,34 %	-8,07 %	18,32 %	26,90 %	-9,82 %	-12,32 %
ZEH	FTSE All Share		0,34 %	-4,34 %	18,32 %	18,22 %	-9,82 %	-7,49 %
ZFH	FTSE All Share		0,34 %	-4,41 %	18,32 %	17,97 %	-9,82 %	-7,62 %
ZG	FTSE All Share		0,34 %	-2,85 %	18,32 %	19,04 %	-9,82 %	-7,38 %
ZGP	FTSE All Share		0,34 %	-2,85 %	18,32 %	19,04 %	-9,82 %	-7,38 %
ZUH	FTSE All Share		0,34 %	-1,63 %	18,32 %	19,33 %	-9,82 %	-6,85 %
1EH	FTSE All Share		0,34 %	-4,86 %	18,32 %	17,55 %	-9,82 %	-8,07 %
1FH	FTSE All Share		0,34 %	-4,97 %	18,32 %	17,27 %	-9,82 %	-8,17 %
1UH	FTSE All Share		0,34 %	-2,17 %	18,32 %	18,62 %	-9,82 %	-6,65 %
3EH	FTSE All Share		0,34 %	-4,18 %	18,32 %	18,43 %	-9,82 %	-7,32 %
3FH	FTSE All Share		0,34 %	-4,31 %	18,32 %	18,17 %	-9,82 %	-7,46 %
3UH	FTSE All Share		0,34 %	-1,43 %	18,32 %	19,53 %	-9,82 %	-5,91 %
9EH	FTSE All Share		0,34 %	-4,12 %	18,32 %	18,50 %	-9,82 %	-7,29 %
9FH	FTSE All Share		0,34 %	-4,27 %	18,32 %	18,14 %	-9,82 %	-7,44 %
9G	FTSE All Share		0,34 %	-2,65 %	18,32 %	19,29 %	-9,82 %	-7,18 %
9UH	FTSE All Share		0,34 %	-1,40 %	18,32 %	19,57 %	-9,82 %	-5,90 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity								
IU	MSCI EFM Africa ex-ZA 10/40		s.o.	-5,78 %	11,30 %	0,43 %	0,95 %	-7,63 %
ZU	MSCI EFM Africa ex-ZA 10/40		s.o.	-5,78 %	11,30 %	0,43 %	0,95 %	-7,63 %
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha								
AEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-10,05 %	0,13 %	1,63 %	0,66 %	-1,27 %
AFH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-10,30 %	0,13 %	1,36 %	0,66 %	-1,50 %
AGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-8,84 %	0,13 %	2,32 %	0,66 %	-0,78 %
AU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-8,04 %	0,13 %	2,61 %	0,66 %	0,00 %
DEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-10,56 %	0,13 %	1,13 %	0,66 %	-1,74 %
DU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-8,50 %	0,13 %	2,10 %	0,66 %	-0,51 %
IEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-9,33 %	0,13 %	2,51 %	0,66 %	-0,41 %
IGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-8,08 %	0,13 %	2,92 %	0,66 %	0,01 %
IU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-7,26 %	0,13 %	3,23 %	0,66 %	0,85 %
XGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-7,32 %	0,13 %	4,04 %	0,66 %	0,79 %
ZE	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-1,30 %	0,13 %	11,23 %	0,66 %	-7,50 %
ZEH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-9,58 %	0,13 %	2,40 %	0,66 %	-0,47 %
ZGH	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-8,15 %	0,13 %	3,14 %	0,66 %	-0,07 %
ZU	90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-7,36 %	0,13 %	3,03 %	0,66 %	0,76 %
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities								
AE	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois	Performance depuis le lancement le 5 août 2021	-0,11 %	-4,47 %	-0,24 %	-1,02 %	s.o.	s.o.
IE	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois	Performance depuis le lancement le 5 août 2021	-0,11 %	-3,96 %	-0,24 %	-0,82 %	s.o.	s.o.
ZE	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-4,03 %	-0,65 %	-0,48 %	-0,62 %	0,72 %
1E	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-4,48 %	-0,65 %	-0,88 %	-0,62 %	0,35 %
1EP	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-4,48 %	-0,65 %	-0,88 %	-0,62 %	0,35 %
1GH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,99 %	-0,65 %	-0,36 %	-0,62 %	0,84 %
1UH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,78 %	-0,65 %	-0,17 %	-0,62 %	1,55 %
2E	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-3,90 %	-0,65 %	-0,27 %	-0,62 %	0,96 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities								
<i>(suite)</i>								
2EP	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-3,90 %	-0,65 %	-0,18 %	-0,62 %	1,05 %
2GC	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,35 %	-0,65 %	0,28 %	-0,62 %	1,55 %
2GH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,39 %	-0,65 %	0,26 %	-0,62 %	1,47 %
4GH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-1,91 %	-0,65 %	0,75 %	-0,62 %	1,99 %
8E	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-3,94 %	-0,65 %	-0,31 %	-0,62 %	0,92 %
8EP	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-3,94 %	-0,65 %	-0,31 %	-0,62 %	0,92 %
8GC	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,42 %	-0,65 %	0,25 %	-0,62 %	1,44 %
8GH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,41 %	-0,65 %	0,22 %	-0,62 %	1,45 %
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities								
AE	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-4,74 %	-0,65 %	-1,41 %	-0,62 %	1,24 %
AFH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-5,23 %	-0,65 %	-1,58 %	-0,62 %	0,93 %
AKH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-4,28 %	-0,65 %	-1,14 %	-0,62 %	1,45 %
ANH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-3,28 %	-0,65 %	-0,78 %	-0,62 %	1,75 %
AUH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-3,12 %	-0,65 %	-0,69 %	-0,62 %	2,47 %
DE	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-5,27 %	-0,65 %	-1,88 %	-0,62 %	0,67 %
IE	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-4,13 %	-0,65 %	-0,70 %	-0,62 %	1,89 %
IEP	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-4,14 %	-0,65 %	-0,76 %	-0,62 %	1,68 %
IGH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,61 %	-0,65 %	-0,11 %	-0,62 %	2,38 %
INH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,52 %	-0,65 %	-0,09 %	-0,62 %	2,28 %
IU	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-9,97 %	-0,65 %	-7,81 %	-0,62 %	11,08 %
IUH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,48 %	-0,65 %	-0,05 %	-0,62 %	3,16 %
JE	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-4,06 %	-0,65 %	-0,73 %	-0,62 %	1,69 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities								
<i>(suite)</i>								
JGH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,57 %	-0,65 %	-0,01 %	-0,62 %	2,33 %
JUH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,42 %	-0,65 %	0,01 %	-0,62 %	2,97 %
LE	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-3,99 %	-0,65 %	-0,57 %	-0,62 %	2,04 %
LEP	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-3,82 %	-0,65 %	-0,56 %	-0,62 %	2,04 %
LGH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,28 %	-0,65 %	0,12 %	-0,62 %	2,48 %
XE	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois	Performance depuis le lancement le 8 avril 2020	-0,11 %	-3,77 %	-0,65 %	-0,30 %	-0,46 %	7,21 %
XGH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,25 %	-0,65 %	0,22 %	-0,62 %	2,79 %
XUH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois	Performance depuis le lancement le 8 avril 2020	-0,11 %	-2,04 %	-0,65 %	0,51 %	-0,46 %	7,83 %
YE	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-4,24 %	-0,65 %	-0,87 %	-0,62 %	1,63 %
YGH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,74 %	-0,65 %	-0,24 %	-0,62 %	2,17 %
YUH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,58 %	-0,65 %	-0,21 %	-0,62 %	2,82 %
ZE	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-4,35 %	-0,65 %	-0,94 %	-0,62 %	1,69 %
ZFH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-4,77 %	-0,65 %	-1,13 %	-0,62 %	1,39 %
ZGH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,83 %	-0,65 %	-0,31 %	-0,62 %	2,23 %
ZUH	Taux moyens composés fondés sur l'Euro short-term rate (€STR), échéance à 1 mois		-0,11 %	-2,59 %	-0,65 %	-0,24 %	-0,62 %	2,94 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha								
AE	EURIBOR 3M		0,34 %	-8,70 %	-0,55 %	7,41 %	-0,43 %	-0,45 %
AEP	EURIBOR 3M		0,34 %	-8,70 %	-0,55 %	6,49 %	-0,43 %	0,16 %
AUH	EURIBOR 3M		0,34 %	-6,21 %	-0,55 %	7,97 %	-0,43 %	1,39 %
DE	EURIBOR 3M		0,34 %	-9,16 %	-0,55 %	6,00 %	-0,43 %	-0,40 %
IE	EURIBOR 3M		0,34 %	-7,88 %	-0,55 %	6,83 %	-0,43 %	0,93 %
IGH	EURIBOR 3M		0,34 %	-6,62 %	-0,55 %	7,42 %	-0,43 %	1,29 %
LE	EURIBOR 3M		0,34 %	-7,53 %	-0,55 %	7,00 %	-0,43 %	1,58 %
XGH	EURIBOR 3M		0,34 %	-5,92 %	-0,55 %	9,16 %	-0,43 %	2,22 %
ZE	EURIBOR 3M		0,34 %	-7,97 %	-0,55 %	7,37 %	-0,43 %	0,83 %
ZF	EURIBOR 3M		0,34 %	-12,42 %	-0,55 %	3,39 %	-0,43 %	0,62 %
ZFH	EURIBOR 3M		0,34 %	-8,19 %	-0,55 %	6,53 %	-0,43 %	0,43 %
ZGH	EURIBOR 3M		0,34 %	-6,84 %	-0,55 %	8,94 %	-0,43 %	1,31 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Performance des Classes d'actions (non audité)

(suite)

Classe d'actions	Nom de l'indice de référence	Commentaires	31 décembre 2022		31 décembre 2021		31 décembre 2020	
			Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille	Indice de référence	Performance du Portefeuille
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha								
AEH	S&P 500		-18,11 %	-29,77 %	28,71 %	23,64 %	18,40 %	21,51 %
AU	S&P 500		-18,11 %	-27,31 %	28,71 %	24,80 %	18,40 %	23,40 %
DEH	S&P 500		-18,11 %	-30,13 %	28,71 %	22,95 %	18,40 %	20,92 %
DU	S&P 500		-18,11 %	-27,67 %	28,71 %	24,18 %	18,40 %	22,78 %
IU	S&P 500		-18,11 %	-26,65 %	28,71 %	25,93 %	18,40 %	24,50 %
ZU	S&P 500		-18,11 %	-26,83 %	28,71 %	25,84 %	18,40 %	24,34 %
1E	S&P 500		-18,11 %	-22,46 %	28,71 %	34,43 %	18,40 %	13,32 %
1EH	S&P 500		-18,11 %	-29,71 %	28,71 %	23,74 %	18,40 %	21,57 %
1U	S&P 500		-18,11 %	-27,23 %	28,71 %	24,94 %	18,40 %	23,52 %
2E	S&P 500		-18,11 %	-21,79 %	28,71 %	35,61 %	18,40 %	14,30 %
2U	S&P 500		-18,11 %	-26,61 %	28,71 %	26,14 %	18,40 %	24,65 %
3U	S&P 500		-18,11 %	-26,68 %	28,71 %	25,88 %	18,40 %	24,45 %
8E	S&P 500		-18,11 %	-21,82 %	28,71 %	35,53 %	18,40 %	14,25 %
8U	S&P 500		-18,11 %	-26,63 %	28,71 %	25,97 %	18,40 %	24,53 %
9U	S&P 500		-18,11 %	-26,62 %	28,71 %	26,03 %	18,40 %	24,48 %
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha								
AEH	MSCI AC World		-17,96 %	-28,37 %	19,04 %	7,85 %	16,82 %	21,19 %
AU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,81 %	19,04 %	9,02 %	16,82 %	23,11 %
DEH	MSCI AC World		-17,96 %	-28,87 %	19,04 %	7,35 %	16,82 %	20,47 %
DU	MSCI AC World		-17,96 %	-26,18 %	19,04 %	8,48 %	16,82 %	22,56 %
IU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,14 %	19,04 %	10,00 %	16,82 %	24,22 %
ZU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,28 %	19,04 %	9,92 %	16,82 %	24,08 %
1E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,86 %	19,04 %	17,43 %	16,82 %	13,07 %
1U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,73 %	19,04 %	9,14 %	16,82 %	23,25 %
2E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,18 %	19,04 %	18,52 %	16,82 %	14,04 %
2U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,09 %	19,04 %	10,08 %	16,82 %	24,31 %
8E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,21 %	19,04 %	18,39 %	16,82 %	13,99 %
8U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,12 %	19,04 %	10,04 %	16,82 %	24,26 %
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities								
AEH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	14,13 %	27,11 %	22,67 %	-3,12 %	-3,93 %
AFH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	13,46 %	27,11 %	22,48 %	-3,12 %	-4,10 %
AGH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	15,29 %	27,11 %	23,16 %	-3,12 %	-3,80 %
ASH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	16,09 %	27,11 %	23,70 %	-3,12 %	-3,11 %
AU	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	16,83 %	27,11 %	24,03 %	-3,12 %	-2,37 %
DEH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	13,85 %	27,11 %	22,07 %	-3,12 %	-4,41 %
DU	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	16,54 %	27,11 %	23,44 %	-3,12 %	-2,85 %
IEH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	14,46 %	27,11 %	23,89 %	-3,12 %	-2,91 %
IG	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	31,81 %	27,11 %	26,34 %	-3,12 %	-4,55 %
IGH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	15,64 %	27,11 %	24,40 %	-3,12 %	-2,79 %
IU	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	17,18 %	27,11 %	25,26 %	-3,12 %	-1,34 %
NG	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	32,40 %	27,11 %	26,86 %	-3,12 %	-4,05 %
XU	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	18,12 %	27,11 %	26,32 %	-3,12 %	-0,49 %
ZEH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	14,45 %	27,11 %	23,83 %	-3,12 %	-2,96 %
ZFH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	13,72 %	27,11 %	23,58 %	-3,12 %	-3,15 %
ZGH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	15,60 %	27,11 %	24,31 %	-3,12 %	-2,85 %
ZU	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	17,14 %	27,11 %	25,19 %	-3,12 %	-1,38 %

Note : la performance totale est historique et ne constitue pas une garantie des résultats futurs. La valeur nette d'inventaire des Classes d'actions peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. La performance est nette de toutes les commissions applicables et des distributions effectuées lors de l'exercice civil clos le 31 décembre 2022 (mais ne tient pas compte de la commission de vente mentionnée à l'annexe 5 des comptes). La performance varie d'une classe d'actions à l'autre en fonction des commissions de gestion et de service aux actionnaires applicables, telles que mentionnées à l'annexe 5 des comptes. En outre, les fluctuations des devises peuvent également influencer sur la performance en fonction de la devise de dénomination de la classe d'actions et de la devise de référence du Portefeuille. Les performances sont indiquées dans la devise de dénomination des portefeuilles.

Règlement relatif aux opérations de financement sur titres (non audité)

Le Règlement relatif aux opérations de financement sur titres (Securities Financing Transaction Regulation ou « SFTR ») introduit des obligations de déclaration concernant les opérations de financement sur titres et les swaps de rendement total. Une opération de financement sur titres est définie conformément à l'Article 3(11) du SFTR comme :

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

Au 31 mars 2023, la SICAV détenait des swaps de rendement total (« TRS ») parmi les types d'instruments dans le périmètre du SFTR.

Informations générales

Nom du Portefeuille	Type d'actif	Plus-value et moins-value latente dans la devise de référence du portefeuille et en valeur absolue		% de l'Actif net
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	263.301		1,34
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	TRS	1.838.347		2,36
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	TRS	570.509		0,64
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	TRS	1.632.152		2,01
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	2.142.039		1,07

Données sur la réutilisation des garanties

Aucune réutilisation des garanties n'est intervenue au cours de l'exercice clos le 31 mars 2023.

Données sur la concentration

Toutes les garanties reçues au titre des swaps de rendement total au 31 mars 2023 étaient des garanties en espèces. La communication des dix plus gros émetteurs n'est donc pas applicable.

Le tableau suivant fournit le détail des dix principales contreparties (sur la base du volume brut d'opérations en circulation) au titre des swaps de rendement total détenus par Portefeuille au 31 mars 2023 :

Nom du Portefeuille	Type d'actif	Contrep partie	Plus-value et moins-value latente dans la devise de référence du portefeuille et en valeur absolue
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	UBS	221.525
		Bank of America Merrill Lynch	41.776
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	TRS	UBS	1.817.025
		Goldman Sachs	21.322
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	TRS	UBS	549.776
		Bank of America Merrill Lynch	20.733
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	TRS	UBS	1.632.152
		Goldman Sachs	1.086.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	Macquarie	532.045
		JPMorgan	523.994

Conservation des garanties reçues

Les garanties en espèces sont reçues sur le compte de trésorerie de chaque Portefeuille ouvert auprès de Citibank Europe plc, succursale de Luxembourg.

Le tableau ci-dessous présente les montants des dépôts à terme détenus par la SICAV au 31 mars 2023 :

Nom du Portefeuille	Type de garantie	Contrep partie	Devise de la garantie	Montant des garanties
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Espèces	UBS	EUR	530.000
		Total	EUR	530.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Espèces	Bank of America Merrill Lynch	USD	50.000
		Total	USD	50.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Espèces	UBS	USD	830.000
		Total	USD	830.000

Règlement relatif aux opérations de financement sur titres (non audité)

(suite)

Nom du Portefeuille	Type de garantie	Contrepartie	Devise de la garantie	Montant des garanties
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Espèces	Goldman Sachs	USD	1.920.000
		Macquarie	USD	1.070.000
		JPMorgan	USD	2.750.000*
		Total	USD	5.740.000

*Ce montant des garanties peut être lié à des opérations autres que des swaps de rendement total qui ne sont pas couvertes par les déclarations relatives au SFTR.

Données d'opération agrégées

Nom du Portefeuille	Type de garantie	Échéance (de la garantie)	Devise de la garantie	Échéance (des opérations de financement sur titres et des swaps sur d'établissement de rendement total)	Pays (des contreparties)	Règlement et compensation	Qualité de la garantie
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Espèces	Opérations ouvertes	USD	1 jour à 1 mois/ 1 à 3 mois	Royaume-Uni	Bilatéraux	S.O. – Espèces
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Espèces	Opérations ouvertes	EUR	3 mois à 1 an/ plus d'un an	Royaume-Uni	Bilatéraux	S.O. – Espèces
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Espèces	Opérations ouvertes	USD	1 jour à 1 mois/1 à 3 mois	Royaume-Uni	Bilatéraux	S.O. – Espèces
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Espèces	Opérations ouvertes	USD	plus d'un an	Royaume-Uni	Bilatéraux	S.O. – Espèces
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Espèces	Opérations ouvertes	USD	1 jour à 1 mois	Royaume-Uni	Bilatéraux	S.O. – Espèces

Conservation des garanties fournies

Les garanties en espèces et avec constitution de sûreté payées aux contreparties sont remises sur des comptes séparés auprès de la contrepartie.

Le montant de garanties reçues au titre des swaps de rendement total au 31 mars 2023 est le suivant :

Nom du Portefeuille	Type de garantie	Contrepartie	Devise de la garantie	Montant des garanties	% des garanties détenues en fin d'exercice par catégorie
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Espèces	UBS	USD	170.000	0,87
		Total	USD	170.000	0,87
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Espèces	UBS	USD	450.000	0,51
		Total	USD	450.000	0,51

Rendement/coûts

Le rendement et les coûts des opérations sur swaps de rendement total au 31 mars 2023 sont stipulés dans l'État des opérations et de la variation de l'actif net du Portefeuille concerné aux sections intitulées « Charges d'intérêt sur swaps », « Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur swaps » et « Variation de la plus-value/(moins-value) nette latente sur swaps ».

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) European High Yield Bond Fund

Identifiant d'entité juridique : 54930067E3IWWEY1X181

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.
- Conserver au moins 50 % des participations du Portefeuille dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG Columbia Threadneedle de 1 à 3. Le cas échéant, évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou s'engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %.
- Exclure les émetteurs qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les émetteurs impliqués dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les émetteurs directement impliqués dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained, évaluée sur des périodes glissantes de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période. Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,51 et la notation de l'indice de référence était de 2,74 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous investissons au moins 50 % du Portefeuille dans des sociétés affichant une notation élevée de la matérialité des facteurs ESG. Le cas échéant, nous pouvons évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou nous engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %. Le produit financier a conservé plus de 50 % de ses participations dans des émetteurs ayant une notation de 1 à 3 sur la période.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.
- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les émetteurs ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les éléments contraignants de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

*Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ?
Description détaillée :*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

La taxinomie de l’UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l’UE et s’accompagne de critères spécifiques de l’Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s’applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l’homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Nom de l'émetteur	Moyenne pondérée	secteur	pays
Ford	2,87 %	automobile	États-Unis
Électricité de France	2,64 %	services publics	France
Telefonica	2,36 %	télécommunications	Espagne
Telecom Italia	2,08 %	télécommunications	Italie
Cellnex	1,99 %	télécommunications	Espagne
Virgin Media	1,88 %	télécommunications	Royaume-Uni
SFR	1,86 %	télécommunications	France
Vodafone	1,85 %	télécommunications	Royaume-Uni
Iliad	1,83 %	télécommunications	France
Faurecia	1,77 %	automobile	France
Deutsche Lufthansa	1,75 %	transport	Allemagne
Repsol	1,50 %	énergie	Espagne
Iqvia	1,46 %	santé	États-Unis
Teva	1,40 %	produits pharmaceutiques	Israël
Autostrade per L'Italia	1,33 %	transport	Italie

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir :



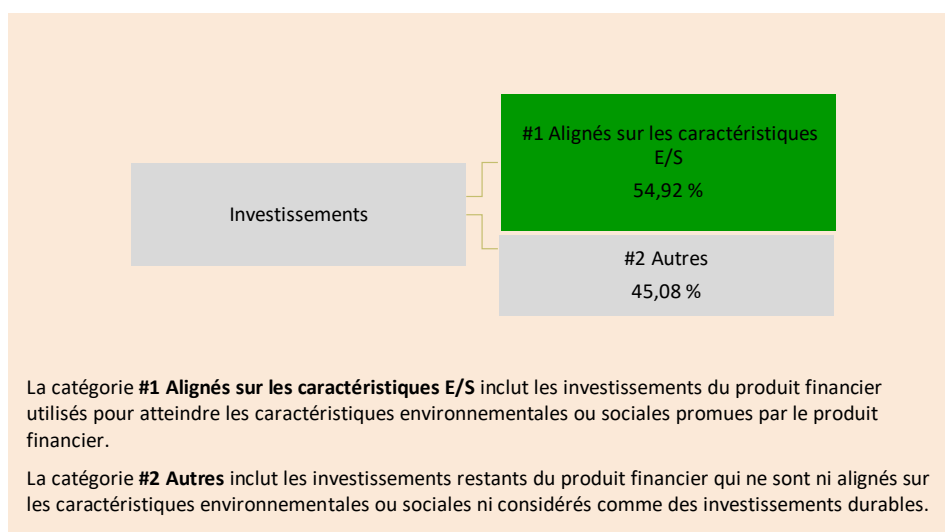
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

- *Quelle était l'allocation des actifs ?*

L'**allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

54,92 % du produit financier a été investi dans des émetteurs ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 1 à 3 et donc alignés sur les caractéristiques E/S.

45,08 % du produit financier a été investi dans : (1) des émetteurs ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 4 ou 5 et n'étaient donc pas alignés sur les caractéristiques E/S, (2) des émetteurs non couverts par le modèle de matérialité des facteurs ESG et (3) des liquidités et des instruments dérivés.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Télécommunications	16,05 %
Automobile	11,21 %
Services	7,94 %
Santé	7,90 %
Industrie de base	6,56 %
Loisirs	5,91 %
Services publics	5,14 %
Transport	4,81 %
Services financiers	4,42 %
Médias	3,91 %
Vente au détail	3,59 %
Banque	3,48 %
Biens d'équipement	3,45 %
Énergie	3,34 %
Immobilier	2,84 %
Technologie et électronique	2,43 %
Biens de consommation	1,98 %

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

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



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

Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

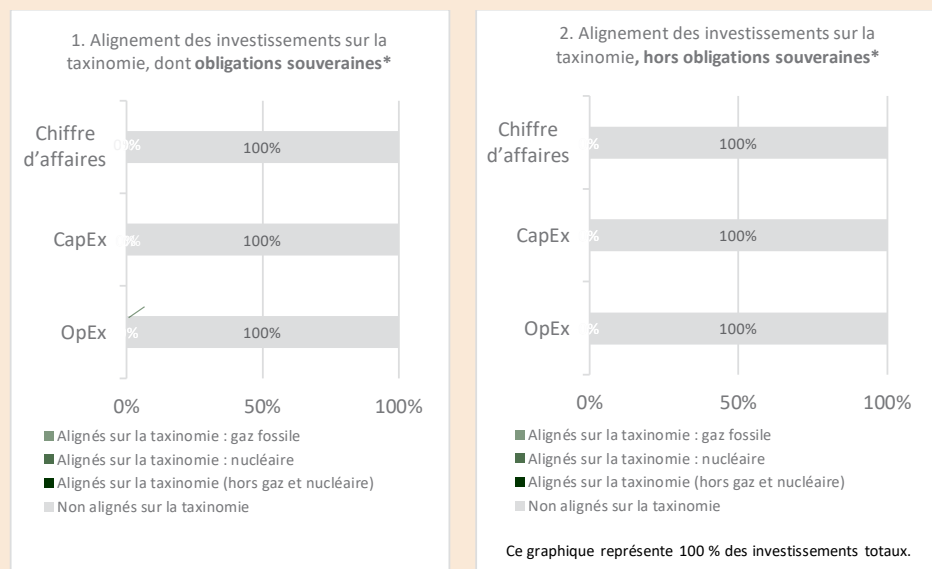
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social




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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; (iii) des produits dérivés à des fins de couverture ; (iv) des sociétés dont la notation de la matérialité des facteurs ESG est de 4 ou 5 ; ou (v) des sociétés qui ne sont pas couvertes par le modèle de la matérialité des facteurs ESG.

Ces investissements ne sont pas utilisés pour respecter les caractéristiques environnementales et sociales du Portefeuille. L'objectif de ces titres est de fournir un portefeuille diversifié capable d'atteindre l'objectif financier.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties en appliquant le filtrage d'exclusion à toutes les participations dans les sociétés en portefeuille. Pour les trésoreries et les instruments dérivés, les considérations ESG sont intégrées à l'évaluation du risque de contrepartie.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG. Par exemple, au cours de la période, nous avons discuté avec la société automobile Ford de la stratégie climatique, des chaînes d'approvisionnement et de l'approvisionnement en matières premières. La Société s'est montrée réceptive à nos remarques et nous avons encouragé l'adoption d'objectifs plus ambitieux en matière de réduction des émissions de carbone (scope 3) et de rapports sur la taxinomie de l'UE comme domaines clés d'amélioration, tout en soulignant l'importance de s'efforcer d'obtenir de meilleures notations ESG par des tiers.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'Indice ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained, tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) European Social Bond

Identifiant d'entité juridique : 549300071NVI9LFDKW96

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

Le produit financier promouvait les caractéristiques sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

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

- Investir dans des titres de créance considérés comme soutenant ou finançant des activités et développements d'utilité sociale.
- Exclure les émetteurs qui enfreignent les normes et principes de gouvernance internationaux acceptés.
- Exclure les émetteurs dont le revenu provient, au-delà de certains seuils, de secteurs ou d'activités (tels que, mais sans s'y limiter, le tabac, l'alcool, les divertissements pour adultes et les jeux d'argent, le charbon thermique et les armes nucléaires ou conventionnelles).

Toutes les obligations détenues au sein du portefeuille répondaient aux critères ci-dessus au cours de la période considérée.

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

Le Portefeuille dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- Investissement dans des titres de créance soutenant ou finançant des activités et développements d'utilité sociale, et soumis à notre Méthodologie de notation sociale. En vertu de cette méthodologie, chaque investissement sera analysé selon un processus à deux flux qui :
 - i) évalue l'intentionnalité sociale associée à l'utilisation des produits d'une obligation, afin de la classer comme un investissement à impact, un investissement avec impact ou un financement de développement ; l'investissement sera autrement évalué comme un financement général qui n'appartient pas à l'univers social éligible à l'investissement ;
 - ii) évalue l'intensité sociale générale en appliquant un modèle d'évaluation en trois étapes. Ce modèle examine neuf caractéristiques des résultats sociaux attribuables à une obligation afin d'obtenir un score numérique sur 31. Une note minimale de 5 est requise pour qu'une obligation soit considérée comme éligible. Les obligations ayant un score numérique éligible sont divisées en quartiles d'intensité sociale : mineure, modérée, bonne ou forte (1 à 4). Bien qu'aucun objectif formel ne soit fixé pour le fonds, l'objectif est de maximiser l'impact social, ce qui peut être observé avec la notation sociale moyenne du Portefeuille au fil du temps.

Dans l'ensemble, le processus génère un score social discret (A1 à C4), qui est utilisé pour comparer les obligations répondant à différents besoins sociaux et suivre le degré d'intensité sociale du portefeuille au fil du temps.

Notation sociale, % du Portefeuille

	1 - Très bonne	2 - Bonne	3 - Modérée	4 - Mineure
A	37,0 %	1,9 %	–	–
B	6,3 %	17,6 %	13,8 %	0,7 %
C	7,0 %	4,0 %	5,5 %	5,1 %

Le partenaire social du fonds publie un rapport annuel d'impact social qui présente son évaluation des caractéristiques sociales promues par le fonds.

Pour soutenir la promotion positive des caractéristiques des résultats sociaux et de l'impact du fonds, le fonds a maintenu et respecté les principes suivants :

- L'exclusion des émetteurs dont le revenu provient, au-delà de certains seuils, de secteurs ou d'activités qui offrent des avantages sociaux ou durables minimes ou représentent un risque élevé d'incidences négatives.

Les exclusions fondées sur des seuils de revenus sont surveillées de manière continue afin de garantir la conformité du Portefeuille.

- L'exclusion des émetteurs qui sont en infraction des normes et principes internationaux acceptés, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies.

Au cours de la période, la politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu. Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et n'avons pas investi dans des émetteurs directement impliqués dans les armes nucléaires.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – aux fins du SFDR, le produit financier ne s'engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s'engage pas à investir dans des investissements durables.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Non applicable – le produit financier ne s'engage pas à investir dans des investissements durables.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?
Description détaillée :

Non applicable – le produit financier ne s'engage pas à investir dans des investissements durables.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d’investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir :

Investissements les plus importants	Secteur	Moyenne pondérée	Pays
Crédit Agricole	Banque	2,84 %	France
Conseil de l’Europe	Supranational	2,75 %	Supranational
Wellcome Trust	Services financiers	2,29 %	Royaume-Uni
Union européenne	Supranational	1,99 %	Supranational
UNEDIC	Agence souveraine	1,88 %	France
BPCE	Banque	1,65 %	France
Vonovia	Immobilier	1,64 %	Allemagne
NatWest	Banque	1,62 %	Royaume-Uni
Instituto De Credito Oficial	Agence souveraine	1,56 %	Espagne
International Finance Facility	Supranational	1,52 %	Supranational
Cassa Depositi E Prestiti	Agence souveraine	1,51 %	Italie
E.ON	Services publics	1,51 %	Allemagne
Caisse Amortissement De La Dette	Agence souveraine	1,49 %	France
ING	Banque	1,40 %	Pays-Bas
Orange	Télécommunications	1,40 %	France



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

● Quelle était l’allocation des actifs ?

98,8 % du produit financier a été investi dans des titres de créance, tous soumis à l’application de la méthodologie de notation sociale et aux critères d’exclusion.

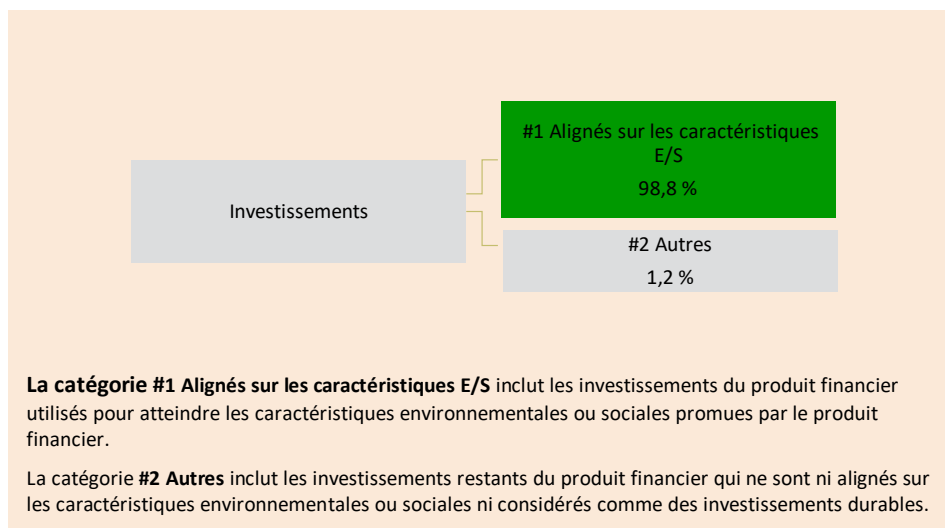
1,2 % du produit financier a été investi en liquidités ou quasi-liquidités.

L’allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Pour se conformer à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Collectivités territoriales	26,66 %
Banques	24,81 %
Services publics	12,73 %
Immobilier	6,13 %
Télécommunications	5,39 %
Assurance	4,55 %
Biens de consommation	3,66 %



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

Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

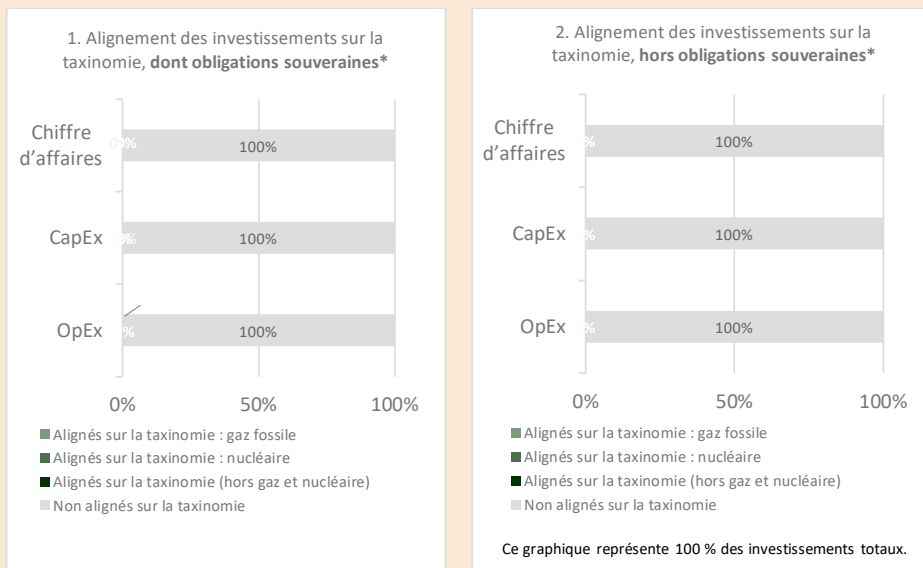
● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

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

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social



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

Les « autres » investissements peuvent inclure (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; et (iii) des produits dérivés à des fins de couverture.

Ces investissements ne sont pas utilisés pour respecter les caractéristiques environnementales et sociales du Portefeuille.

Des garanties environnementales ou sociales minimales sont garanties pour les trésoreries et les produits dérivés en intégrant des considérations ESG dans l'évaluation du risque de contrepartie.



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

En tant que détenteur d'obligations, nous recherchons activement des opportunités d'engagement auprès des émetteurs afin de mieux comprendre et d'influencer positivement leur valeur sociale. En outre, nous nous engagerons auprès des émetteurs pour développer le marché en vue d'une utilisation spécifique des produits de l'émission, notamment en présentant les meilleures pratiques, la structure obligataire et les rapports d'impact.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Nous tenons à nous assurer que les impacts sociaux négatifs de la transition sont minimisés, et visons à relever ces défis en nous engageant activement auprès des émetteurs sur ce sujet afin de promouvoir une croissance inclusive.

En promouvant les caractéristiques sociales visées par le produit, les thèmes d'engagement au cours de la période considérée ont également compris le changement climatique, les normes environnementales, les droits de l'homme, les normes de travail et la gouvernance d'entreprise. L'entreprise portugaise de services publics EDP est un exemple d'engagement d'un émetteur. Nous nous sommes engagés avec EDP en mai 2022 concernant leur émission actuelle d'obligations vertes et la façon dont ils envisageaient la juste transition. Nous avons discuté des émissions futures et des structures probables. EDP envisageait une obligation liée au développement durable (« SLB »). Nous avons indiqué notre préférence pour une utilisation spécifique des produits plutôt que pour une SLB en raison d'une additionnalité et d'une intentionnalité plus grandes, et d'objectifs ICP généralement peu exigeants. Nous leur avons suggéré d'intégrer les indicateurs clés de performance dans une structure d'obligations vertes ou de développement durable et d'envisager l'utilisation d'ICP sociaux. Nous avons convaincu EDP de poursuivre l'utilisation spécifique du produit de l'émission et, depuis cette réunion, nous avons acheté leur nouvelle émission d'obligations vertes.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable - le produit financier n'utilise pas d'indice de référence désigné pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Non applicable – l'indice de marché n'est utilisé qu'à des fins de comparaison des rendements financiers.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) Emerging Market ESG Equities

Identifiant d'entité juridique : 5493003JWKERJYXOI785

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

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

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.
- Nous avons investi au moins 80 % du portefeuille dans des sociétés présentant des caractéristiques ESG solides ou en amélioration, mesurées par une combinaison de la notation de la matérialité des facteurs ESG et de la recherche fondamentale des sociétés en portefeuille. Le Portefeuille aura tendance à privilégier les sociétés pour lesquelles la Notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle est solide, ce qui donnera au Portefeuille une inclinaison positive en faveur des caractéristiques ESG par rapport aux sociétés de l'Indice MSCI Europe, sur une base glissante de 12 mois. Toutes les sociétés très bien notées sont considérées comme étant alignées sur les caractéristiques E/S promues par le Portefeuille. Toutefois, le Portefeuille peut investir dans des sociétés affichant une moins bonne notation, mais qui sont considérées comme étant alignées sur les caractéristiques E/S promues par le Portefeuille, du fait que ces titres, nonobstant cette notation : (i) sont définis par le Sous-Conseiller par le biais d'une recherche fondamentale comme présentant déjà de solides pratiques ESG ; ou (ii) ont la possibilité d'améliorer leurs pratiques ESG. Le Sous-Conseiller cherche à encourager de telles améliorations par la mise en œuvre de sa politique d'engagement.
- Exclure les sociétés qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les sociétés impliquées dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les sociétés directement impliquées dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice MSCI Emerging Markets, évaluée sur des périodes glissantes de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période.
Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,00 et la notation de l'indice de référence était de 2,34 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous avons investi au moins 80 % du portefeuille dans des sociétés présentant des caractéristiques ESG solides ou en amélioration, mesurées par une combinaison de la notation de la matérialité des facteurs ESG et de la recherche fondamentale des sociétés en portefeuille.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.

- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les sociétés ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les contraintes de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

--- *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

--- *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ?
Description détaillée :*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l’homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence.

Investissements les plus importants	Secteur	Moyenne pondérée	Pays
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	Technologies de l'information	7,77 %	Taiwan
TENCENT HOLDINGS LTD	Services de communication	5,73 %	Chine
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	Technologies de l'information	5,56 %	Corée du Sud
JD.COM	Consommation discrétionnaire	4,77 %	Chine
MEITUAN	Consommation discrétionnaire	4,36 %	Chine
BANK RAKYAT INDONESIA	Finance	4,28 %	Indonésie
BANK CENTRAL ASIA	Finance	2,90 %	Indonésie
HDFC BANK	Finance	2,55 %	Inde
ICICI BANK	Finance	2,50 %	Inde
LOCALIZA RENT A CAR	Produits industriels	2,40 %	Brésil
ITAU UNIBANCO HOLDING	Finance	1,95 %	Brésil
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS	Santé	1,93 %	Chine
MERCADOLIBRE INC	Consommation discrétionnaire	1,90 %	Argentine
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	Santé	1,84 %	Inde
INFOSYS ADR REPRESENTING ONE LTD	Technologies de l'information	1,78 %	Inde



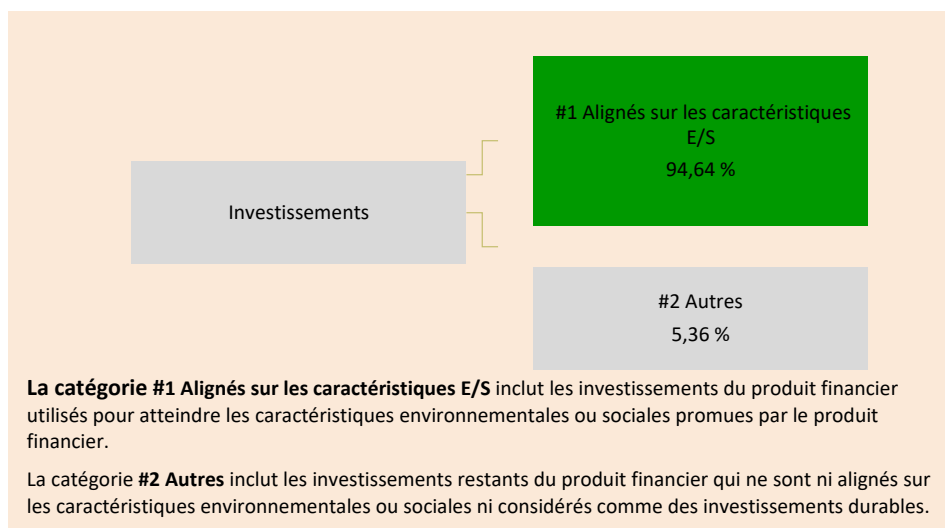
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

L'**allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

94,64 % Nous avons investi au moins 80 % du portefeuille dans des sociétés présentant des caractéristiques ESG solides ou en amélioration, mesurées par une combinaison de la notation de la matérialité des facteurs ESG et de la recherche fondamentale des sociétés en portefeuille.

5,36 % comprend les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Finance	30,81 %
Technologies de l'information	24,94 %
Consommation discrétionnaire	15,73 %
Santé	7,16 %
Services de communication	6,74 %
Produits industriels	5,68 %
Consommation de base	3,34 %
Énergie	1,64 %
Immobilier	0,69 %



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

Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Pour se conformer à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

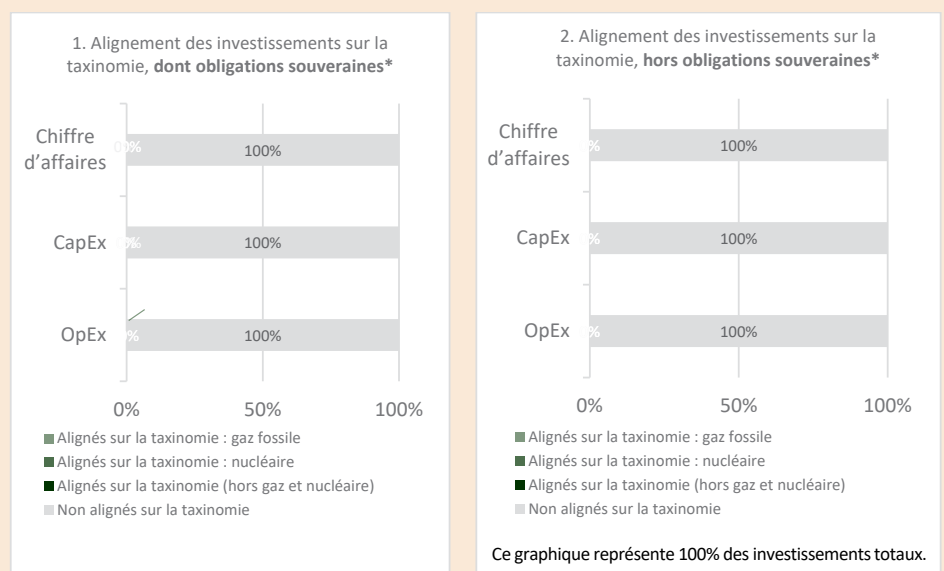
Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

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

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
 - Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme à la taxinomie de l'UE.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social



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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; ou (iii) des produits dérivés à des fins de couverture.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties pour les trésoreries et les produits dérivés en intégrant des considérations ESG dans l'évaluation du risque de contrepartie.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG. Par exemple, au cours de la période, nous avons discuté avec : la Banque centrale pour évoquer sa stratégie de financement durable et d'inclusion financière ; Bank Rakyat Indonesia au sujet du financement durable ; Tencent sur l'efficacité du conseil d'administration et divers sujets ESG ; HDFC Bank au sujet de son enquête de matérialité axée sur la publication d'informations climatiques ; et WEG pour définir les priorités liées au climat, à la circularité et à la gestion de la main-d'œuvre.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'Indice MSCI Emerging Markets, tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) Global Focus

Identifiant d'entité juridique : 549300N6B2IZVI8Z4Q40

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ? *[cocher et compléter comme il convient ; le pourcentage représente les investissements durables]*

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ____ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ____ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ____ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

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

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.
- Conserver au moins 50 % des participations du Portefeuille dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG Columbia Threadneedle de 1 à 3. Le cas échéant, évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou s'engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %.
- Exclure les sociétés qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les sociétés impliquées dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les sociétés directement impliquées dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice MSCI All Countries World, évaluée sur des périodes glissantes de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période.
Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,44 et la notation de l'indice de référence était de 2,78 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous investissons au moins 50 % du Portefeuille dans des sociétés affichant une notation élevée de la matérialité des facteurs ESG. Le cas échéant, nous pouvons évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou nous engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %. Le produit financier a conservé plus de 50 % de ses participations dans des sociétés ayant une notation de 1 à 3 sur la période.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.
- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les sociétés ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les éléments contraignants de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— — **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— — **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ? Description détaillée :**

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

La taxinomie de l’UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l’UE et s’accompagne de critères spécifiques de l’Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s’applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l’homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d’investissements** du produit financier au cours de la période de référence.

Investissements les plus importants	Secteur	Moyenne pondérée	Pays
MICROSOFT CORP	Technologies de l’information	7,98 %	États-Unis
MASTERCARD INC CLASS A	Finance	5,41 %	États-Unis
INTUIT INC	Technologies de l’information	4,24 %	États-Unis
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Santé	3,98 %	États-Unis
ALPHABET INC CLASS A	Services de communication	3,98 %	États-Unis
LINDE PLC	Matériaux	3,12 %	Royaume-Uni
LAM RESEARCH CORP	Technologies de l’information	3,06 %	États-Unis
KEYENCE CORP	Technologies de l’information	2,56 %	Japon
LONZA GROUP AG	Santé	2,53 %	Suisse
LVMH	Consommation discrétionnaire	2,47 %	France
AMAZON COM INC	Consommation discrétionnaire	2,34 %	États-Unis
CONOCOPHILLIPS	Énergie	2,32 %	États-Unis
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	Technologies de l’information	2,25 %	Taiwan (République de Chine)
ELEVANCE HEALTH INC	Santé	2,24 %	États-Unis
RECRUIT HOLDINGS LTD	Produits industriels	2,14 %	Japon



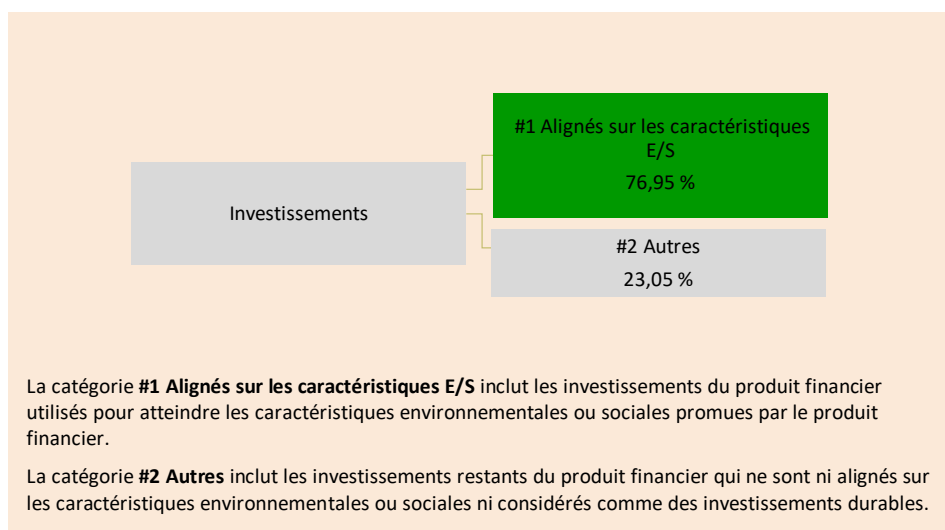
Quelle était la proportion d’investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l’allocation des actifs ?

76,95 % du produit financier a été investi dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 1 à 3 et donc alignées sur les caractéristiques E/S.

L’**allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

23,05 % du produit financier a été investi dans : (1) des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 4 ou 5 et n'étaient donc pas alignées sur les caractéristiques E/S, (2) des sociétés non couvertes par le modèle de matérialité des facteurs ESG et (3) des liquidités et des instruments dérivés.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Technologies de l'information	26,13 %
Santé	17,48 %
Finance	15,99 %
Produits industriels	9,51 %
Consommation de base	8,01 %
Consommation discrétionnaire	7,08 %
Services de communication	6,21 %
Matériaux	4,81 %
Énergie	2,59 %
Services publics	0,63 %
Liquidité	1,58 %

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies.
- **capital expenditure (CapEx)** showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure (OpEx)** reflecting green operational activities of investee companies.



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

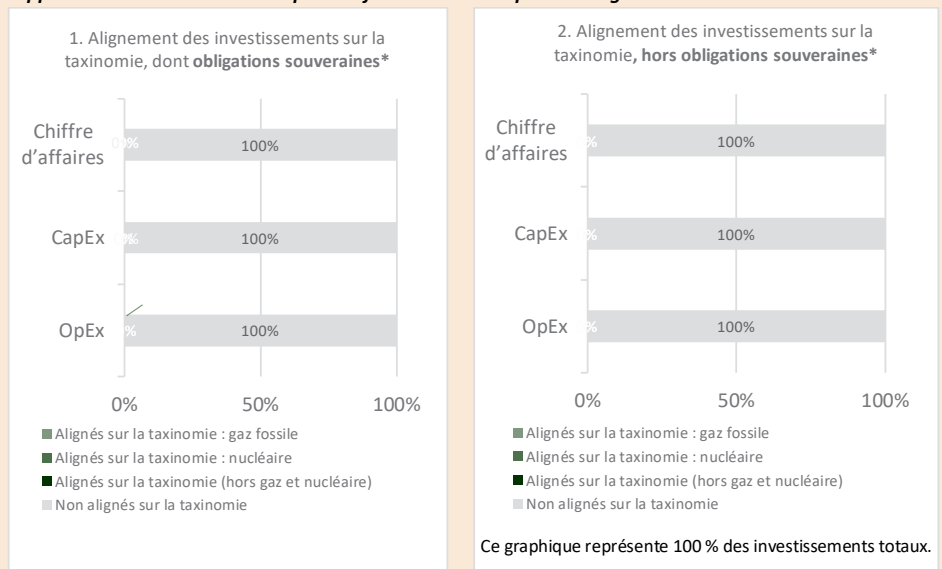
Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social



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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; (iii) des produits dérivés à des fins de couverture ; (iv) des sociétés dont la notation de la matérialité des facteurs ESG est de 4 ou 5 ; ou (v) des sociétés qui ne sont pas couvertes par le modèle de la matérialité des facteurs ESG.

Ces investissements ne sont pas utilisés pour respecter les caractéristiques environnementales et sociales du Portefeuille. L'objectif de ces titres est de fournir un portefeuille diversifié capable d'atteindre l'objectif financier.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties en appliquant le filtrage d'exclusion à toutes les participations dans les sociétés en portefeuille. Pour les trésoreries et les instruments dérivés, les considérations ESG sont intégrées à l'évaluation du risque de contrepartie.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG. Par exemple, au cours de la période, nous avons engagé des participations dans le portefeuille sur un éventail de sujets. Cela inclut, sans s'y limiter, des engagements avec : une banque des marchés émergents pour mieux comprendre son approche de la durabilité, de la gouvernance et de la gestion des risques climatiques ; une société de soins de santé sur le thème du marketing éthique et de la prescription hors AMM d'un de ses médicaments.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'indice MSCI All Countries World, tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) Global Equity Income

Identifiant d'entité juridique : 549300WX6ZDL2WOHJS77

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.
- Conserver au moins 50 % des participations du Portefeuille dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG Columbia Threadneedle de 1 à 3. Le cas échéant, évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou s'engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %.
- Exclure les sociétés qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les sociétés impliquées dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les sociétés directement impliquées dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice MSCI All Countries World, évaluée sur des périodes glissantes de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période.
Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,38 et la notation de l'indice de référence était de 2,78 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous investissons au moins 50 % du Portefeuille dans des sociétés affichant une notation élevée de la matérialité des facteurs ESG. Le cas échéant, nous pouvons évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou nous engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %. Le produit financier a conservé plus de 50 % de ses participations dans des sociétés ayant une notation de 1 à 3 sur la période.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.
- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les sociétés ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les éléments contraignants de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

*Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ?
Description détaillée :*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

La taxinomie de l’UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l’UE et s’accompagne de critères spécifiques de l’Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s’applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l’homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d’investissements du produit financier au cours de la période de référence.

Investissements les plus importants	Moyenne pondérée	Secteur	Pays
MICROSOFT CORP	3,67 %	Technologies de l’information	États-Unis
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	2,43 %	Technologies de l’information	Corée (du Sud), République de
SIEMENS N AG	2,31 %	Produits industriels	Allemagne
STATE STREET CORP	2,22 %	Finance	États-Unis
ANGLO AMERICAN PLC	2,17 %	Matériaux	Afrique du Sud
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,08 %	Finance	États-Unis
TOTALENERGIES	2,05 %	Énergie	France
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,96 %	Santé	États-Unis
ELI LILLY	1,93 %	Santé	États-Unis
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,91 %	Technologies de l’information	Taiïwan (République de Chine)
XCEL ENERGY INC	1,89 %	Services publics	États-Unis
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,89 %	Consommation de base	Royaume-Uni
EXPERIAN PLC	1,86 %	Produits industriels	Royaume-Uni
ELEVANCE HEALTH INC	1,86 %	Santé	États-Unis
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,84 %	Services de communication	Allemagne

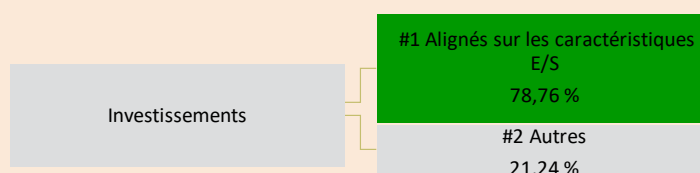


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

78,76 % du produit financier a été investi dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 1 à 3 et donc alignées sur les caractéristiques E/S.

21,24 % du produit financier a été investi dans : (1) des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 4 ou 5 et n'étaient donc pas alignées sur les caractéristiques E/S, (2) des sociétés non couvertes par le modèle de matérialité des facteurs ESG et (3) des liquidités et des instruments dérivés.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteur	Moyenne pondérée
Finance	16,90 %
Technologies de l'information	14,91 %
Santé	12,32 %
Produits industriels	11,76 %
Consommation de base	9,04 %
Consommation discrétionnaire	7,25 %
Matériaux	6,78 %
Énergie	6,20 %
Services de communication	6,03 %

Services publics	4,80 %
Immobilier	2,02 %
Liquidité	2,00 %



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

Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

● Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

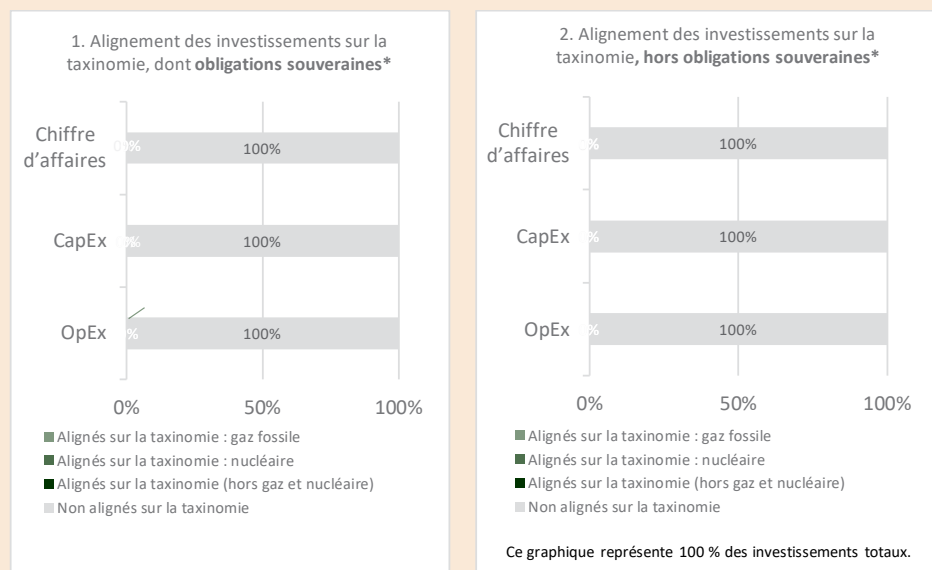
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

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

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social



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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; (iii) des produits dérivés à des fins de couverture ; (iv) des sociétés dont la notation de la matérialité des facteurs ESG est de 4 ou 5 ; ou (v) des sociétés qui ne sont pas couvertes par le modèle de la matérialité des facteurs ESG.

Ces investissements ne sont pas utilisés pour respecter les caractéristiques environnementales et sociales du Portefeuille. L'objectif de ces titres est de fournir un portefeuille diversifié capable d'atteindre l'objectif financier.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties en appliquant le filtrage d'exclusion à toutes les participations dans les sociétés en portefeuille. Pour les trésoreries et les instruments dérivés, les considérations ESG sont intégrées à l'évaluation du risque de contrepartie.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG. Par exemple, au cours de la période, nous avons engagé des participations dans le portefeuille sur un éventail de sujets. Cela inclut, sans s'y limiter, l'engagement auprès d'une société de soins de santé sur le thème du marketing éthique et de la prescription hors AMM d'un de ses médicaments.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

● ***En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'Indice MSCI All Countries World, tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) Global Select

Identifiant d'entité juridique : 5493004VNS7Y85HXL113

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.
- Conserver au moins 50 % des participations du Portefeuille dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG Columbia Threadneedle de 1 à 3. Le cas échéant, évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou s'engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %.
- Exclure les sociétés qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les sociétés impliquées dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les sociétés directement impliquées dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice MSCI All Countries World, évaluée sur des périodes glissantes de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période.
Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,54 et la notation de l'indice de référence était de 2,78 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous investissons au moins 50 % du Portefeuille dans des sociétés affichant une notation élevée de la matérialité des facteurs ESG. Le cas échéant, nous pouvons évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou nous engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %. Le produit financier a conservé plus de 50 % de ses participations dans des sociétés ayant une notation de 1 à 3 sur la période.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.
- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les sociétés ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les éléments contraignants de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ?
Description détaillée :

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

La taxinomie de l’UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l’UE et s’accompagne de critères spécifiques de l’Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s’applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l’homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d’investissements** du produit financier au cours de la période de référence.

Investissements les plus importants	Secteur	Moyenne pondérée	Pays
MICROSOFT CORP	5,84 %	Technologies de l’information	États-Unis
ALPHABET INC CLASS A	4,21 %	Services de communication	États-Unis
AMAZON COM INC	3,97 %	Consommation discrétionnaire	États-Unis
MASTERCARD INC CLASS A	3,21 %	Finance	États-Unis
T MOBILE US INC	2,80 %	Services de communication	États-Unis
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,64 %	Technologies de l’information	Taiwan (République de Chine)
TOTALENERGIES	2,14 %	Énergie	France
JPMORGAN CHASE	2,09 %	Finance	États-Unis
INTUIT INC	1,93 %	Technologies de l’information	États-Unis
HDFC BANK LTD	1,92 %	Finance	Inde
NESTLE SA	1,85 %	Consommation de base	Suisse
SCHNEIDER ELECTRIC	1,77 %	Produits industriels	France
NOVO NORDISK CLASS B	1,72 %	Santé	Danemark
QUALCOMM INC	1,71 %	Technologies de l’information	États-Unis
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,64 %	Santé	États-Unis



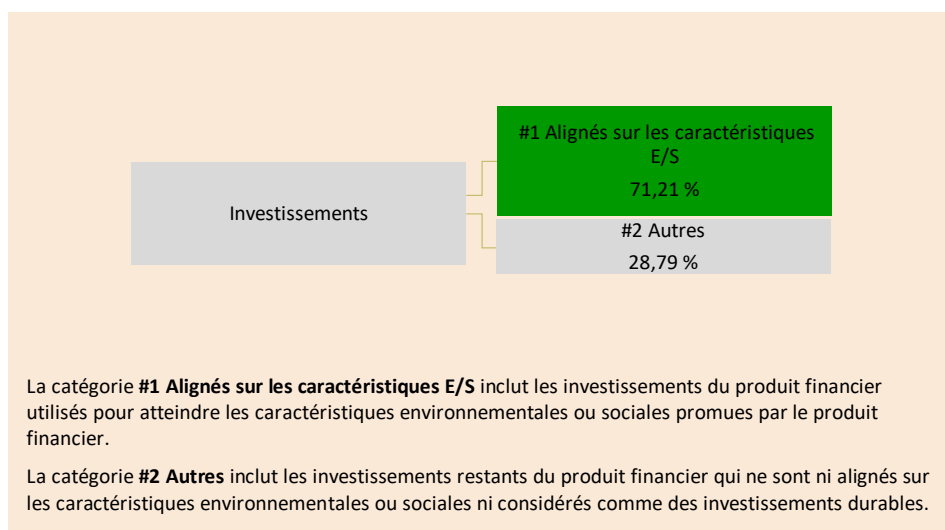
Quelle était la proportion d’investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l’allocation des actifs ?

71,21 % du produit financier a été investi dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 1 à 3 et donc alignées sur les caractéristiques E/S.

L’allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

28,79 % du produit financier a été investi dans : (1) des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 4 ou 5 et n'étaient donc pas alignées sur les caractéristiques E/S, (2) des sociétés non couvertes par le modèle de matérialité des facteurs ESG et (3) des liquidités et des instruments dérivés.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Technologies de l'information	23,24 %
Finance	16,50 %
Santé	12,84 %
Services de communication	10,32 %
Produits industriels	7,99 %
Consommation discrétionnaire	7,54 %
Matériaux	5,57 %
Consommation de base	4,30 %
Énergie	4,17 %
Services publics	3,11 %
Immobilier	2,22 %
Néant	2,19 %

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

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



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

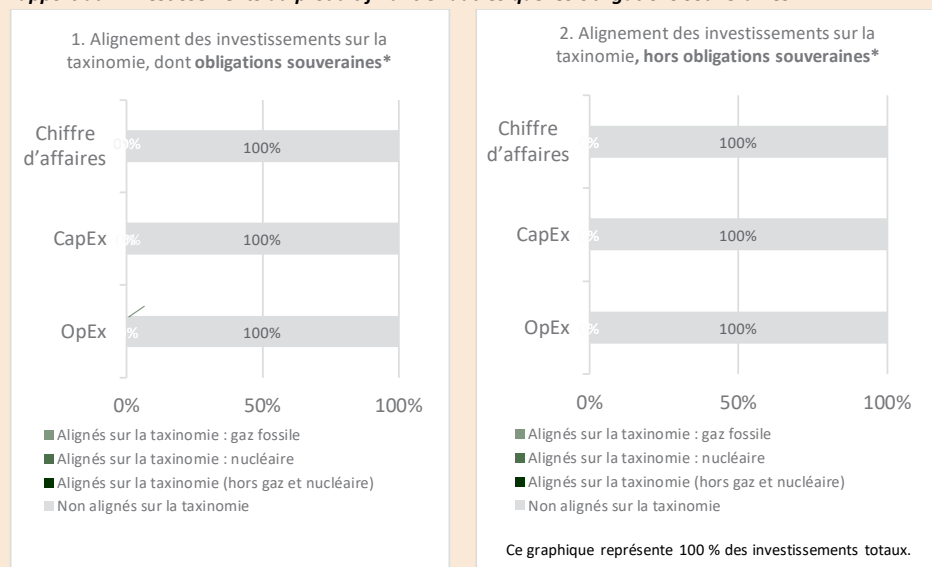
Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

● Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social




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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; (iii) des produits dérivés à des fins de couverture ; (iv) des sociétés dont la notation de la matérialité des facteurs ESG est de 4 ou 5 ; ou (v) des sociétés qui ne sont pas couvertes par le modèle de la matérialité des facteurs ESG.

Ces investissements ne sont pas utilisés pour respecter les caractéristiques environnementales et sociales du Portefeuille. L'objectif de ces titres est de fournir un portefeuille diversifié capable d'atteindre l'objectif financier.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties en appliquant le filtrage d'exclusion à toutes les participations dans les sociétés en portefeuille. Pour les trésoreries et les instruments dérivés, les considérations ESG sont intégrées à l'évaluation du risque de contrepartie.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG. Par exemple, au cours de la période, nous avons engagé des participations dans le portefeuille sur un éventail de sujets. Cela inclut, sans s'y limiter, des engagements avec : une société immobilière pour mieux comprendre ses mesures d'atténuation des émissions et de l'eau ; une société de soins de santé sur le thème du marketing éthique et de la prescription hors AMM d'un de ses médicaments.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'indice MSCI All Countries World, tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) Global Smaller Companies

Identifiant d'entité juridique : 549300U3LV1YG52NP397

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

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

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.
- Conserver au moins 50 % des participations du Portefeuille dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG Columbia Threadneedle de 1 à 3. Le cas échéant, évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou s'engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %.
- Exclure les sociétés qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les sociétés impliquées dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les sociétés directement impliquées dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice MSCI World Small Cap, évaluée sur des périodes glissantes de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période.
Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,70 et la notation de l'indice de référence était de 2,99 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous investissons au moins 50 % du Portefeuille dans des sociétés affichant une notation élevée de la matérialité des facteurs ESG. Le cas échéant, nous pouvons évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou nous engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %. Le produit financier a conservé plus de 50 % de ses participations dans des sociétés ayant une notation de 1 à 3 sur la période.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.
- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les sociétés ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les éléments contraignants de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

*Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ?
Description détaillée :*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

La taxinomie de l’UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l’UE et s’accompagne de critères spécifiques de l’Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s’applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l’homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d’investissements** du produit financier au cours de la période de référence.

Investissements les plus importants	Secteur	Moyenne pondérée	Pays
KADANT INC	2,05 %	Produits industriels	États-Unis
WILLSCOT MOBILE MINI HOLDINGS CORP	2,02 %	Produits industriels	États-Unis
ALTAIR ENGINEERING INC CLASS A	1,98 %	Technologies de l’information	États-Unis
CONMED CORP	1,79 %	Santé	États-Unis
MSA SAFETY INC	1,74 %	Produits industriels	États-Unis
ARMSTRONG WORLD INDUSTRIES INC	1,73 %	Produits industriels	États-Unis
WORKIVA INC CLASS A	1,65 %	Technologies de l’information	États-Unis
AAON INC	1,55 %	Produits industriels	États-Unis
SIMPSON MANUFACTURING INC	1,54 %	Produits industriels	États-Unis
CARGOJET INC	1,53 %	Produits industriels	Canada
SIG GROUP N AG	1,50 %	Matériaux	Suisse
GAMES WORKSHOP GROUP PLC	1,49 %	Consommation discrétionnaire	Royaume-Uni
LESLIES INC	1,48 %	Consommation discrétionnaire	États-Unis
SQUARE ENIX HLDG LTD	1,47 %	Services de communication	Japon
ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS INC	1,44 %	Produits industriels	États-Unis



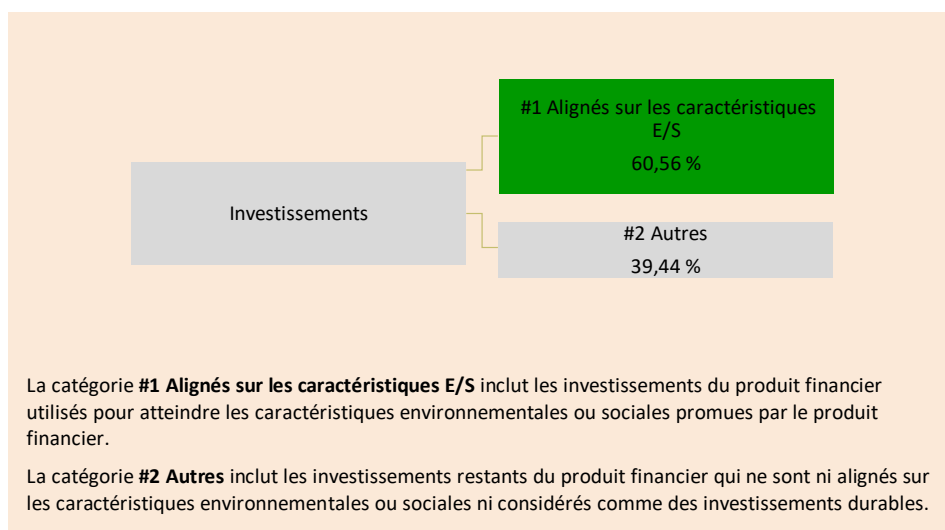
Quelle était la proportion d’investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l’allocation des actifs ?

60,56 % du produit financier a été investi dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 1 à 3 et donc alignées sur les caractéristiques E/S.

39,44 % du produit financier a été investi dans : (1) des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 4 ou 5 et n’étaient donc pas alignées sur les caractéristiques E/S, (2) des sociétés non couvertes par le modèle de matérialité des facteurs ESG et (3) des liquidités et des instruments dérivés.

L’**allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Produits industriels	30,21 %
Technologies de l'information	18,71 %
Santé	15,27 %
Consommation discrétionnaire	13,50 %
Finance	6,74 %
Services de communication	6,58 %
Consommation de base	3,42 %
Matériaux	2,82 %
Immobilier	0,65 %
Liquidité	2,09 %

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

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



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

Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

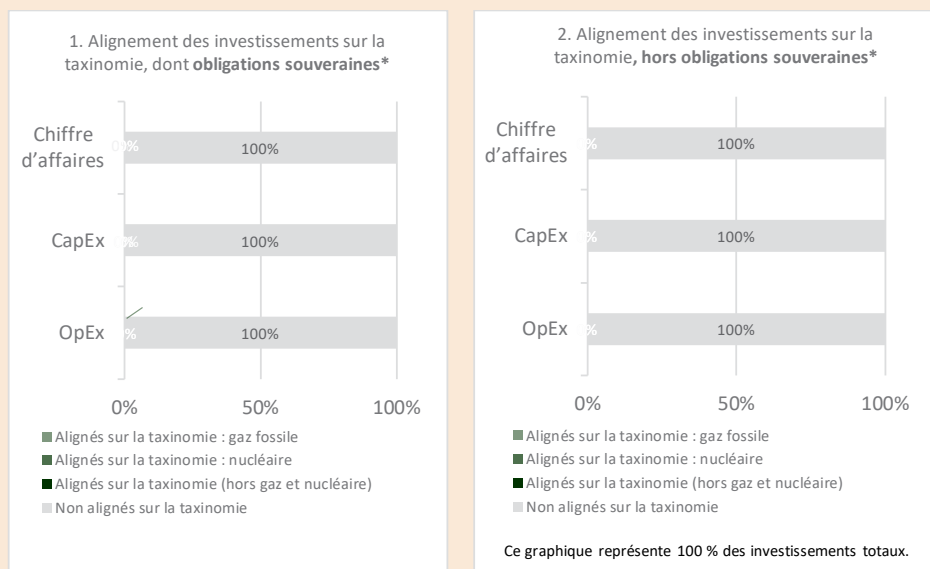
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social




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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; (iii) des produits dérivés à des fins de couverture ; (iv) des sociétés dont la notation de la matérialité des facteurs ESG est de 4 ou 5 ; ou (v) des sociétés qui ne sont pas couvertes par le modèle de la matérialité des facteurs ESG.

Ces investissements ne sont pas utilisés pour respecter les caractéristiques environnementales et sociales du Portefeuille. L'objectif de ces titres est de fournir un portefeuille diversifié capable d'atteindre l'objectif financier.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties en appliquant le filtrage d'exclusion à toutes les participations dans les sociétés en portefeuille. Pour les trésoreries et les instruments dérivés, les considérations ESG sont intégrées à l'évaluation du risque de contrepartie.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG. Par exemple, au cours de la période, nous avons engagé des participations dans le portefeuille sur un éventail de sujets. Cela comprend, sans s'y limiter, un engagement avec une banque américaine pour mieux comprendre la structure de gouvernance de l'entreprise, en particulier en ce qui concerne la structure du conseil d'administration et la rémunération.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'Indice MSCI World Small Cap, tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) American Smaller Companies

Identifiant d'entité juridique : 549300FL849SFZ3EMB26

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.
- Conserver au moins 50 % des participations du Portefeuille dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG Columbia Threadneedle de 1 à 3. Le cas échéant, évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou s'engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %.
- Exclure les sociétés qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les sociétés impliquées dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les sociétés directement impliquées dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice Russell 2500, évaluée sur une période glissante de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période.
Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,41 et la notation de l'indice de référence était de 2,97 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous avons investi au moins 50 % du Portefeuille dans des sociétés affichant une notation élevée de la matérialité des facteurs ESG. Le cas échéant, nous pouvons évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou nous engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %. Le produit financier a conservé plus de 50 % de ses participations dans des sociétés ayant une notation de 1 à 3 sur la période.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.
- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les sociétés ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les éléments contraignants de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ? Description détaillée :*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

La taxinomie de l’UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l’UE et s’accompagne de critères spécifiques de l’Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s’applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l’homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d’investissements** du produit financier au cours de la période de référence.

Investissements les plus importants	Secteur	Moyenne pondérée	Pays
WILLSCOT MOBILE MINI HOLDINGS CORP	Produits industriels	3,83 %	États-Unis
AVISTA CORP	Services publics	3,76 %	États-Unis
CONMED CORP	Santé	3,54 %	États-Unis
CARRIAGE SERVICES INC	Consommation discrétionnaire	3,32 %	États-Unis
NEWPARK RESOURCES INC	Énergie	3,12 %	États-Unis
VOYA FINANCIAL INC	Finance	2,97 %	États-Unis
KONTOOR BRANDS INC	Consommation discrétionnaire	2,90 %	États-Unis
MOELIS CLASS A	Finance	2,53 %	États-Unis
HOULIHAN LOKEY INC CLASS A	Finance	2,47 %	États-Unis
VIRTU FINANCIAL INC CLASS A	Finance	2,41 %	États-Unis
NOV INC	Énergie	2,35 %	États-Unis
FTI CONSULTING INC	Produits industriels	2,29 %	États-Unis
SCHNITZER STEEL INDUSTRIES INC CLA	Matériaux	2,16 %	États-Unis
MATTHEWS INTERNATIONAL CORP CLASS	Produits industriels	2,15 %	États-Unis
ESSENT GROUP LTD	Finance	1,92 %	États-Unis



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

● Quelle était l’allocation des actifs ?

L’**allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

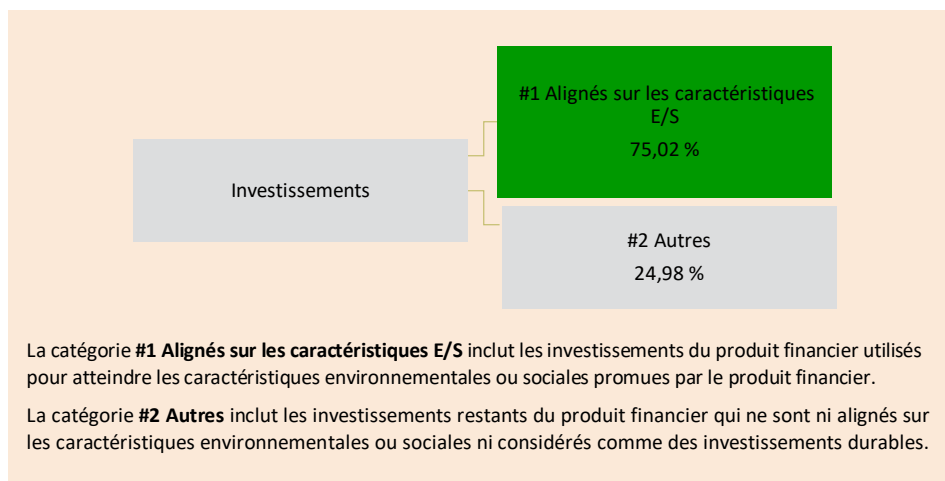
75,02 % du produit financier a été investi dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 1 à 3 et donc alignées sur les caractéristiques E/S.

24,98 % du produit financier a été investi dans : (1) des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 4 ou 5 et n’étaient donc pas alignées sur les caractéristiques E/S, (2) des sociétés non couvertes par le modèle de matérialité des facteurs ESG et (3) des liquidités et des instruments dérivés.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Produits industriels	18,55 %
Finance	15,65 %
Consommation discrétionnaire	13,46 %
Santé	11,91 %
Technologies de l'information	11,28 %
Matériaux	6,48 %
Consommation de base	6,27 %
Énergie	5,66 %
Services publics	3,76 %
Immobilier	3,02 %
Liquidité	2,54 %
Services de communication	1,43 %



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

Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

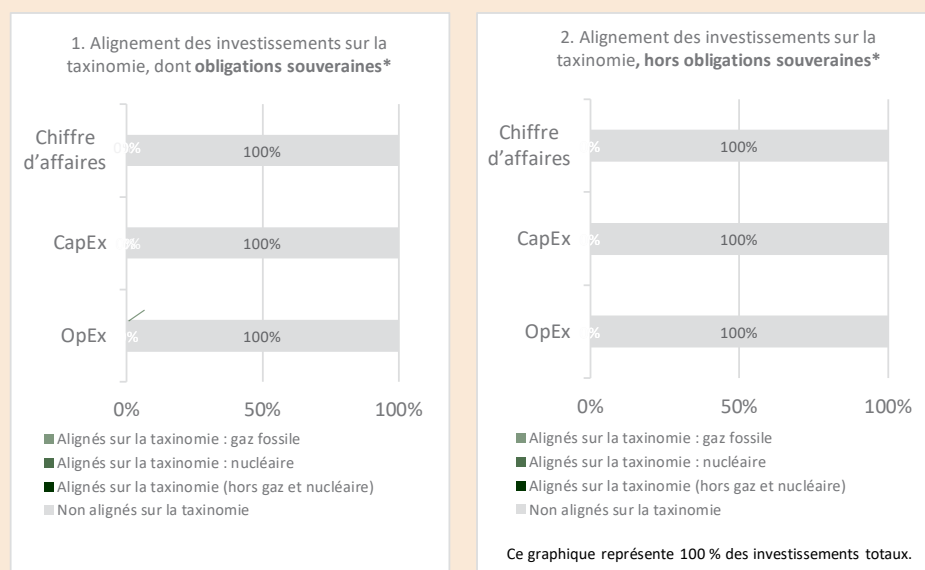
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social



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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; (iii) des produits dérivés à des fins de couverture ; (iv) des sociétés dont la notation de la matérialité des facteurs ESG est de 4 ou 5 ; ou (v) des sociétés qui ne sont pas couvertes par le modèle de la matérialité des facteurs ESG.

Ces investissements ne sont pas utilisés pour respecter les caractéristiques environnementales et sociales du Portefeuille. L'objectif de ces titres est de fournir un portefeuille diversifié capable d'atteindre l'objectif financier.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties en appliquant le filtrage d'exclusion à toutes les participations dans les sociétés en portefeuille. Pour les trésoreries et les instruments dérivés, les considérations ESG sont intégrées à l'évaluation du risque de contrepartie.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG.

Par exemple, au cours de la période, nous avons discuté avec Livent des principaux thèmes E&S qui l'affectent et de sa capacité à conserver une licence d'exploitation. L'entreprise est consciente que l'autorisation d'exercer est essentielle et affirme donner la priorité aux droits de l'homme, à l'établissement de relations avec les communautés et à la satisfaction des exigences des clients en matière de chaînes d'approvisionnement bien contrôlées et à faible impact. Le site le plus connu de l'entreprise se trouve en Argentine, où elle a toujours été confrontée à des manifestations contre l'exploitation minière. Elle a collaboré avec une ONG affiliée aux Nations unies pour organiser des réunions publiques à l'intention de la population locale et est consciente de la nécessité de maintenir en permanence le principe du consentement préalable, libre et éclairé. La volonté de poursuivre les opérations d'une manière qui profite également aux communautés est l'un des principaux moteurs de la demande de certification IRMA. Un autre facteur est que les principaux constructeurs OEM (clients de Livent) font partie du conseil d'administration de l'IRMA et incitent les fournisseurs dans cette direction en raison de leur importance accordée à la traçabilité de la chaîne d'approvisionnement et à la réduction des émissions de carbone. L'eau est un sujet important dans l'extraction du lithium, c'est pourquoi l'entreprise s'est concertée avec les autorités locales et les universités américaines pour réaliser une étude hydrogéologique de la région, qui a montré que l'entreprise n'était pas aussi exposée au stress hydrique que ses homologues en raison de particularités géographiques locales. L'entreprise fait l'objet d'une surveillance étroite dans la région et communique avec les communautés locales ainsi qu'avec les autorités sur la consommation d'eau. Livent s'est fixé pour objectif d'atteindre une consommation nette nulle d'ici à 2040, mais ne vise qu'une réduction de 30 % de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'ici à 2030, ce qui implique d'importantes réductions après 2030. À court terme, l'entreprise travaille sur l'optimisation des processus et est convaincue de pouvoir atteindre l'objectif de 2030. Toutefois, à plus long terme, elle pourrait être confrontée à des difficultés d'approvisionnement en énergies renouvelables. Les informations communiquées par l'entreprise restent légères et les plans de réduction de l'impact sur la nature ne sont pas clairs. Dans l'ensemble, Livent a une approche solide des questions E&S pour une société de sa taille, mais des plans et des informations plus tangibles sur la manière dont elle réduit les émissions, la consommation d'eau et les impacts sur la nature seront nécessaires, ainsi que des approches renforcées et plus claires en matière de droits de l'homme et de relations avec les communautés.

Nous avons également pris contact avec Medpace par écrit en exposant l'importance de la diversité dans les essais cliniques pour nous, en tant qu'investisseurs. Nous avons fait part de notre souhait d'en savoir plus sur la stratégie de l'entreprise tout en encourageant l'industrie à faire preuve d'une plus grande transparence sur des sujets tels que l'instauration d'un climat de confiance avec les participants aux essais (historiquement) sous-représentés, l'incitation à la participation aux essais (par exemple, récompenses, questions d'infrastructure, essais décentralisés), les pratiques d'embauche, la sensibilisation interne et le renforcement des capacités, la collaboration avec les groupes de parties prenantes concernés tels que les groupes de patients et les initiatives de l'industrie, et le suivi de l'efficacité de la stratégie de diversité dans les essais cliniques, y compris la collecte de données et l'utilisation des résultats pour adapter les approches. Nous avons conclu cet e-mail en sollicitant un appel à l'engagement.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'Indice Russell 2500, tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) Asia Equities

Identifiant d'entité juridique : 549300NJZIV56FVQ648

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.
- Conserver au moins 50 % des participations du Portefeuille dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG Columbia Threadneedle de 1 à 3. Le cas échéant, évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou s'engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %.
- Exclure les émetteurs qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les émetteurs impliqués dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les émetteurs directement impliqués dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice MSCI AC Asia Pacific ex Japan, évaluée sur des périodes glissantes de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période.
Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,12 et la notation de l'indice de référence était de 2,30 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous investissons au moins 50 % du Portefeuille dans des sociétés affichant une notation élevée de la matérialité des facteurs ESG. Le cas échéant, nous pouvons évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou nous engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %. Le produit financier a conservé plus de 50 % de ses participations dans des émetteurs ayant une notation de 1 à 3 sur la période.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.
- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les émetteurs ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les éléments contraignants de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ? Description détaillée :*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

La taxinomie de l’UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l’UE et s’accompagne de critères spécifiques de l’Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s’applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l’homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d’investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir :

Investissements les plus importants	Moyenne pondérée	Pays	Secteur
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	7,55 %	Taiwan (République de Chine)	Technologies de l’information
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	4,18 %	Corée (du Sud), République de	Technologies de l’information
TENCENT HOLDINGS LTD	3,80 %	Chine	Services de communication
AIA GROUP LTD	3,57 %	Hong Kong	Finance
RELIANCE INDUSTRIES LTD	3,00 %	Inde	Énergie
MACQUARIE GROUP LTD DEF	2,65 %	Australie	Finance
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	2,63 %	Australie	Finance
JD.COM CLASS A INC	2,51 %	Chine	Consommation discrétionnaire
CSL LTD	2,32 %	Australie	Santé
BANK RAKYAT INDONESIA (PERSERO)	2,32 %	Indonésie	Finance
MEITUAN	2,29 %	Chine	Consommation discrétionnaire
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,26 %	Chine	Consommation discrétionnaire
UNITED OVERSEAS BANK LTD	2,21 %	Singapour	Finance
HDFC BANK LTD	2,18 %	Inde	Finance
SANTOS LTD	2,16 %	Australie	Énergie



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

● Quelle était l’allocation des actifs ?

80,8 % du produit financier a été investi dans des émetteurs ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 1 à 3 et donc alignés sur les caractéristiques E/S.

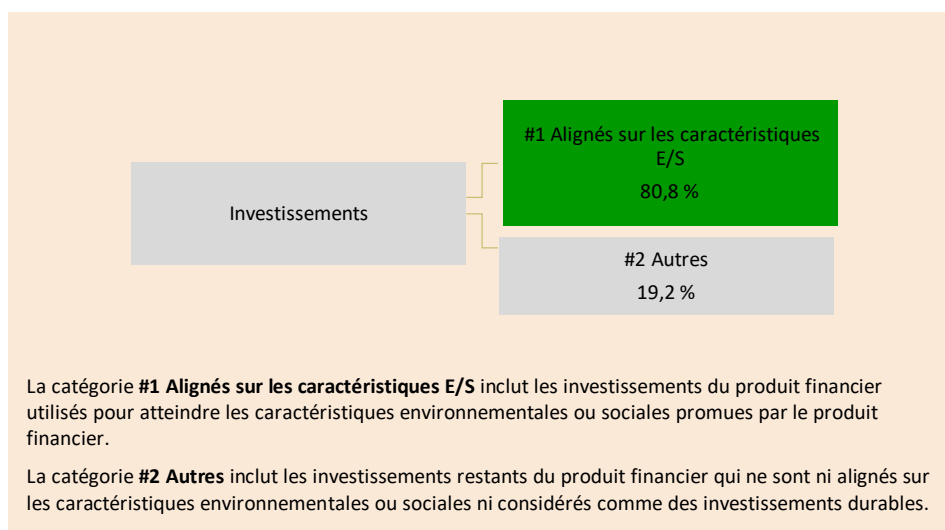
L’allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

19,2 % du produit financier a été investi dans : (1) des émetteurs ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 4 ou 5 et n'étaient donc pas alignés sur les caractéristiques E/S, et (2) des émetteurs non couverts par le modèle de matérialité des facteurs ESG et (3) des liquidités et des instruments dérivés.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Finance	25,16 %
Technologies de l'information	18,88 %
Consommation discrétionnaire	13,54 %
Services de communication	9,67 %
Matériaux	6,84 %
Énergie	6,02 %
Produits industriels	4,73 %
Consommation de base	4,67 %
Santé	4,50 %
Immobilier	4,07 %



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

Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

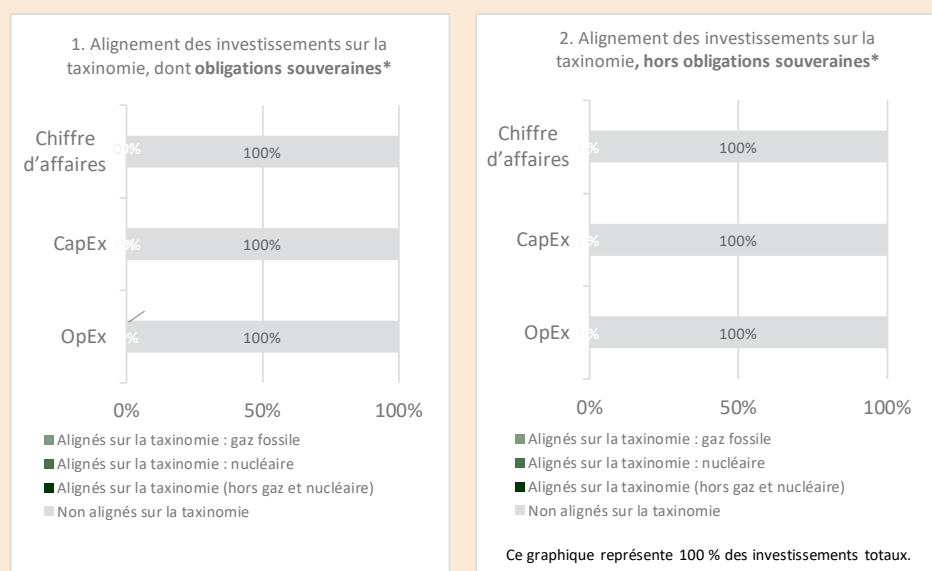
● Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

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

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social



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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; (iii) des produits dérivés à des fins de couverture ; (iv) des sociétés dont la notation de la matérialité des facteurs ESG est de 4 ou 5 ; ou (v) des sociétés qui ne sont pas couvertes par le modèle de la matérialité des facteurs ESG.

Ces investissements ne sont pas utilisés pour respecter les caractéristiques environnementales et sociales du Portefeuille. L'objectif de ces titres est de fournir un portefeuille diversifié capable d'atteindre l'objectif financier.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties en appliquant le filtrage d'exclusion à toutes les participations dans les sociétés en portefeuille. Pour les trésoreries et les instruments dérivés, les considérations ESG sont intégrées à l'évaluation du risque de contrepartie.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG. Par exemple, nous nous sommes engagés avec Samsung Electronics en Corée pour assurer le suivi de l'équipe RSE/RI de la société, en soulignant nos attentes par rapport au précédent dialogue. Nous avons encouragé plusieurs recommandations, y compris des exemples d'études de cas spécifiques concernant son processus de gestion chimique, ainsi que la divulgation plus détaillée de ses mesures de santé et de sécurité au travail. En outre, la société s'est engagée à participer au « Clean Electronics Production Network » et à former les travailleurs à la liberté d'association, en particulier dans les pays où la réglementation en matière de droits du travail est plus laxiste. Nous avons également fourni des exemples de meilleures pratiques pour chacune de nos recommandations décrites ci-dessus.

Nous nous sommes engagés avec Bank Rakyat. Il s'agissait d'un appel en collaboration avec le responsable des relations investisseurs et le responsable ESG. L'appel portait sur leur approche plus large en matière de gouvernance du développement durable et de gestion des risques, ainsi que sur la gestion des risques climatiques. Nous avons discuté de leur nouvelle feuille de route ESG et mis à jour leur processus de gouvernance ESG. Des progrès ont été accomplis dans ce domaine, avec la création d'une nouvelle équipe ESG dédiée. Dans l'ensemble, l'appel a été positif et Bank Rakyat fait de bons progrès. Ils se sont engagés à mettre à jour leur rapport TCFD, à publier les informations pour les émissions financées et à obtenir un engagement net zéro d'ici début 2024. Ils ont mentionné vouloir soumettre des cibles fondées sur la science. Il s'agit d'un objectif ambitieux par rapport à leur situation actuelle, nous continuerons donc à surveiller et à nous engager sur leurs progrès dans ces domaines.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'Indice MSCI AC Asia Pacific ex Japan, tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) Pan European ESG Equities

Identifiant d'entité juridique : 5493003HOJGB5U7D3492

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?	
●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.

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

- Nous avons investi au moins 80 % du portefeuille dans des sociétés présentant des caractéristiques ESG solides ou en amélioration, mesurées par une combinaison de la notation de la matérialité des facteurs ESG et de la recherche fondamentale des sociétés en portefeuille. Le Portefeuille aura tendance à privilégier les sociétés pour lesquelles la Notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle est solide, ce qui donnera au Portefeuille une inclinaison positive en faveur des caractéristiques ESG par rapport aux sociétés de l'Indice MSCI Europe, sur une base glissante de 12 mois. Toutes les sociétés très bien notées sont considérées comme étant alignées sur les caractéristiques E/S promues par le Portefeuille. Toutefois, le Portefeuille peut investir dans des sociétés affichant une moins bonne notation, mais qui sont considérées comme étant alignées sur les caractéristiques E/S promues par le Portefeuille, du fait que ces titres, nonobstant cette notation : (i) sont définis par le biais d'une recherche fondamentale comme présentant déjà de solides pratiques ESG ; ou (ii) ont la possibilité d'améliorer leurs pratiques ESG. Nous cherchons à encourager de telles améliorations par la mise en œuvre de sa politique d'engagement.
- Exclure les sociétés qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les sociétés impliquées dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les sociétés directement impliquées dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice MSCI Europe (Gross TR), évaluée sur des périodes glissantes de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période.
Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,70 et la notation de l'indice de référence était de 2,79 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous avons investi au moins 80 % du portefeuille dans des sociétés présentant des caractéristiques ESG solides ou en amélioration, mesurées par une combinaison de la notation de la matérialité des facteurs ESG et de la recherche fondamentale de sociétés.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les sociétés ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les éléments contraignants de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ? Description détaillée :*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



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

Non applicable – le produit financier ne s'engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence.

Investissements les plus importants	Secteur	Moyenne pondérée	Pays
NOVO NORDISK CLASS B	Santé	4,01 %	Danemark
ASML HOLDING NV	Technologies de l'information	3,84 %	Pays-Bas
LVMH	Consommation discrétionnaire	3,82 %	France
NESTLE SA	Consommation de base	3,73 %	Suisse
ROCHE HOLDING PAR AG	Santé	3,70 %	États-Unis
ASTRAZENECA PLC	Santé	3,38 %	Royaume-Uni
TOTALENERGIES	Énergie	3,15 %	France
LOREAL SA	Consommation de base	2,90 %	France
ASHTHEAD GROUP PLC	Produits industriels	2,29 %	Royaume-Uni
UBS GROUP AG	Finance	2,28 %	Suisse
CRH PLC	Matériaux	2,18 %	Irlande
SIKA AG	Matériaux	2,12 %	Suisse
3I GROUP PLC	Finance	2,10 %	Royaume-Uni
VODAFONE GROUP PLC	Services de communication	2,07 %	Royaume-Uni
RIO TINTO PLC	Matériaux	2,00 %	Royaume-Uni



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

● Quelle était l'allocation des actifs ?

L'**allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

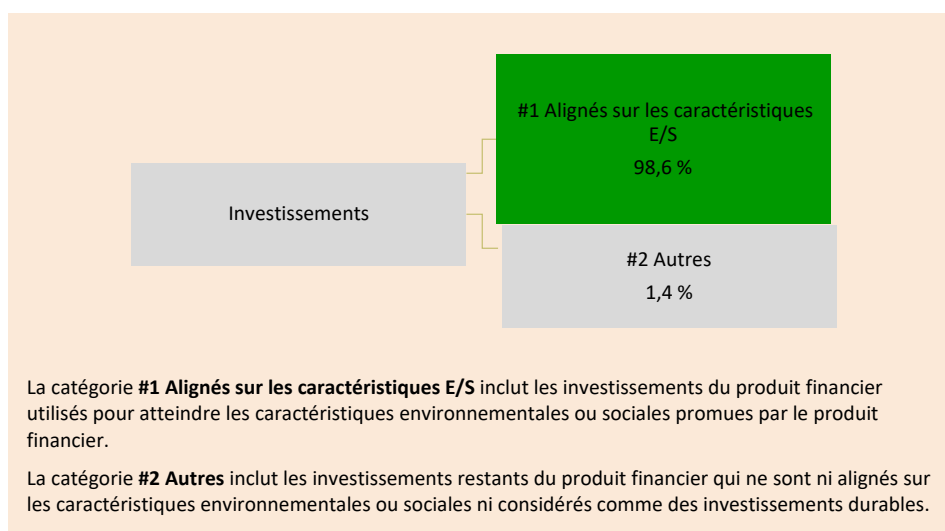
98,6 % du portefeuille a été investi dans des sociétés présentant des caractéristiques ESG solides ou en amélioration, mesurées par une combinaison de la notation de la matérialité de facteurs ESG et de la recherche fondamentale des sociétés en portefeuille.

1,4 % comprend les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Services de communication	3,7 %
Consommation discrétionnaire	13,5 %
Consommation de base	9,2 %
Énergie	3,4 %
Finance	18,3 %
Santé	14,3 %
Produits industriels	18,0 %
Technologies de l'information	7,3 %
Matériaux	9,7 %
Services publics	1,3 %
Liquidité	1,4 %



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

Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

Oui :

Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

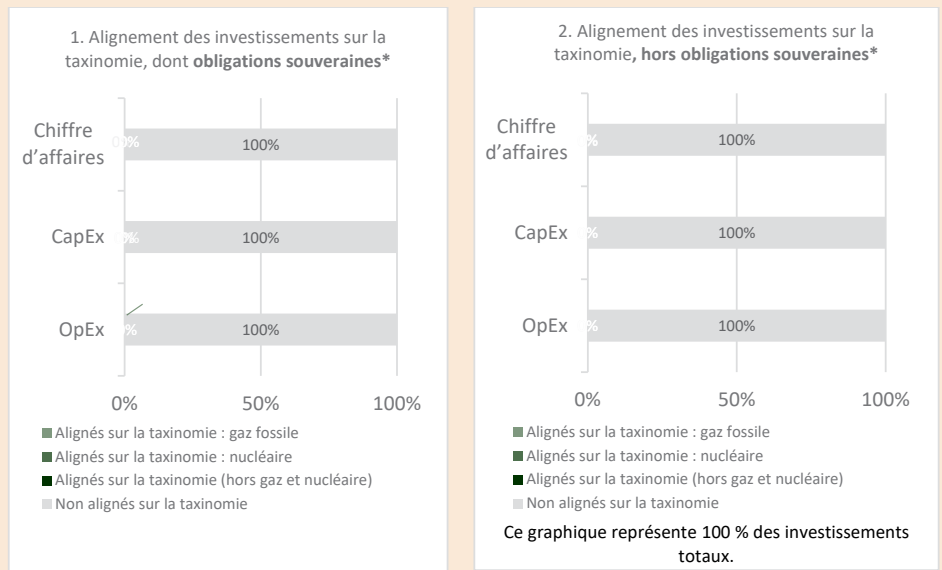
Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

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

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



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

- Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social



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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; ou (iii) des produits dérivés à des fins de couverture.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties pour les trésoreries et les produits dérivés en intégrant des considérations ESG dans l'évaluation du risque de contrepartie.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG.

Par exemple, au cours de la période, nous avons fait appel à ASM International pour discuter de la gouvernance et de l'intégration des indicateurs ESG dans la rémunération des dirigeants. Cela permettra de responsabiliser les dirigeants. Suite à notre engagement, l'entreprise a accepté de mettre en œuvre ce projet. En outre, suite aux engagements pris en 2022, l'entreprise a amélioré la diversité sur le lieu de travail et s'est fixé des objectifs d'embauche en matière de parité hommes-femmes. Enfin, l'entreprise s'est fixé un objectif d'émissions conforme à la perspective mondiale de 1,5°C.

Nous avons également discuté de la stratégie nutritionnelle avec Nestlé. L'entreprise a partagé son ambition d'être un leader dans la vente de produits alimentaires sains. Nous avons exprimé notre inquiétude : contrairement à leurs pairs, Nestlé n'a pas d'objectifs spécifiques. Nous avons déclaré que tout objectif enverrait un message fort à l'ensemble de l'industrie. Nous continuerons à nous engager sur ce sujet.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'Indice MSCI Europe (Gross TR), tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) Pan European Smaller Companies

Identifiant d'entité juridique : 549300FG0S32L53EKJ87

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ? [cocher et compléter comme il convient ; le pourcentage représente les investissements durables]

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Oui	<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social <input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.
- Conserver au moins 50 % des participations du Portefeuille dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG Columbia Threadneedle de 1 à 3. Le cas échéant, évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou s'engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %.
- Exclure les sociétés qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les sociétés impliquées dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les sociétés directement impliquées dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice EMIX Smaller Europe (inc UK), évaluée sur des périodes glissantes de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période.
Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,76 et la notation de l'indice de référence était de 2,97 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous investissons au moins 50 % du Portefeuille dans des sociétés affichant une notation élevée de la matérialité des facteurs ESG. Le cas échéant, nous pouvons évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou nous engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %. Le produit financier a conservé plus de 50 % de ses participations dans des sociétés ayant une notation de 1 à 3 sur la période.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.
- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les sociétés ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les éléments contraignants de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ? Description détaillée :*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

La taxinomie de l’UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l’UE et s’accompagne de critères spécifiques de l’Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s’applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l’homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d’investissements** du produit financier au cours de la période de référence.

Investissements les plus importants	Secteur	Moyenne pondérée	Pays
SIG GROUP N AG	Matériaux	2,60 %	Suisse
CVS GROUP PLC	Santé	2,50 %	Royaume-Uni
CTS EVENTIM AG	Services de communication	2,41 %	Allemagne
WATCHES OF SWITZERLAND GROUP PLC	Consommation discrétionnaire	2,20 %	Royaume-Uni
EUROFINS SCIENTIFIC	Santé	2,09 %	Luxembourg
FINECOBANK BANCA FINECO	Finance	2,08 %	Italie
GENUS PLC	Santé	2,06 %	Royaume-Uni
AVANZA BANK HOLDING	Finance	2,05 %	Suède
ST.JAMES PLACE PLC	Finance	2,04 %	Royaume-Uni
HOWDEN JOINERY GROUP PLC	Produits industriels	2,01 %	Royaume-Uni
BIG YELLOW GROUP PLC	Immobilier	2,00 %	Royaume-Uni
COMPUGROUP MEDICAL N	Santé	1,97 %	Allemagne
BELIMO N AG	Produits industriels	1,96 %	Suisse
FLUIDRA SA	Produits industriels	1,94 %	Espagne
ASM INTERNATIONAL NV	Technologies de l’information	1,88 %	Pays-Bas



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

● Quelle était l’allocation des actifs ?

57,5 % du produit financier a été investi dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 1 à 3 et donc alignées sur les caractéristiques E/S.

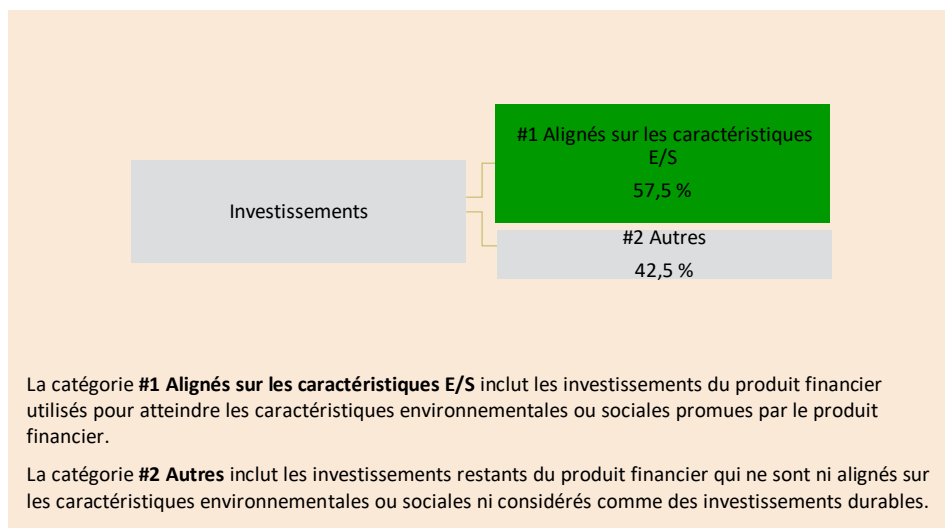
L’**allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

42,5 % du produit financier a été investi dans : (1) des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 4 ou 5 et n'étaient donc pas alignées sur les caractéristiques E/S, (2) des sociétés non couvertes par le modèle de matérialité des facteurs ESG et (3) des liquidités et des instruments dérivés.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Produits industriels	20,71 %
Santé	18,02 %
Technologies de l'information	14,10 %
Finance	12,31 %
Consommation discrétionnaire	10,49 %
Matériaux	9,52 %
Services de communication	8,19 %
Consommation de base	3,38 %
Immobilier	2,65 %
Énergie	0,08 %
Liquidité	0,56 %



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

Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

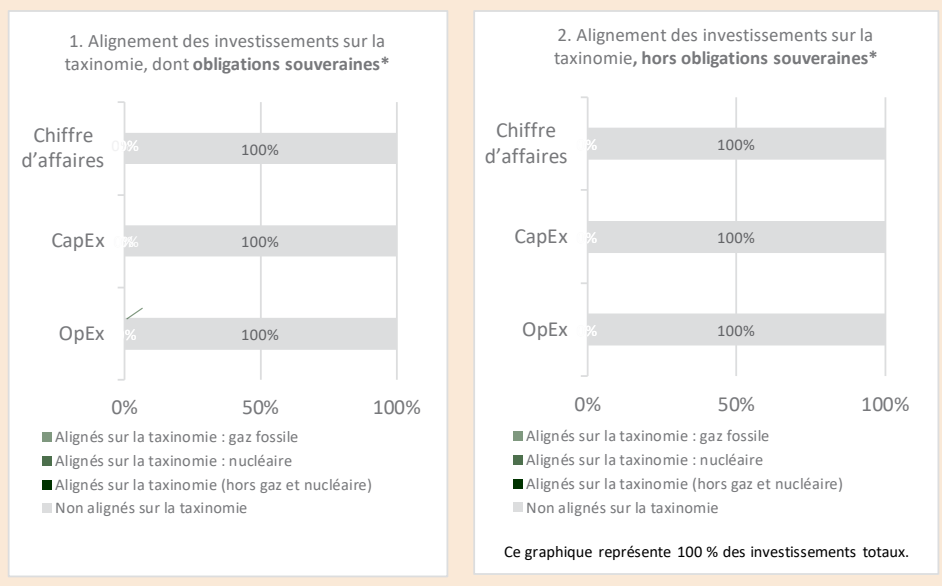
● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

Oui :

Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social



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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; (iii) des produits dérivés à des fins de couverture ; (iv) des sociétés dont la notation de la matérialité des facteurs ESG est de 4 ou 5 ; ou (v) des sociétés qui ne sont pas couvertes par le modèle de la matérialité des facteurs ESG.

Ces investissements ne sont pas utilisés pour respecter les caractéristiques environnementales et sociales du Portefeuille. L'objectif de ces titres est de fournir un portefeuille diversifié capable d'atteindre l'objectif financier.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties en appliquant le filtrage d'exclusion à toutes les participations dans les sociétés en portefeuille. Pour les trésoreries et les instruments dérivés, les considérations ESG sont intégrées à l'évaluation du risque de contrepartie.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG.

Par exemple, au cours de la période, nous avons fait appel à ASM International pour discuter de la gouvernance et de l'intégration des indicateurs ESG dans la rémunération des dirigeants. Cela permettra de responsabiliser les dirigeants. Suite à notre engagement, l'entreprise a accepté de mettre en œuvre ce projet. En outre, suite aux engagements pris en 2022, l'entreprise a amélioré la diversité sur le lieu de travail et s'est fixé des objectifs d'embauche en matière de parité hommes-femmes. Enfin, l'entreprise s'est fixé un objectif d'émissions conforme à la perspective mondiale de 1,5°C.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'Indice EMIX Smaller Europe (inc UK), tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) European Select

Identifiant d'entité juridique : 549300MKHX2X26Q8CM51

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables
<input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	<input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
<input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	<input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input type="checkbox"/> ayant un objectif social
	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.
- Conserver au moins 50 % des participations du Portefeuille dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG Columbia Threadneedle de 1 à 3. Le cas échéant, évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou s'engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %.
- Exclure les sociétés qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les sociétés impliquées dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les sociétés directement impliquées dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice FTSE World Europe ex UK, évaluée sur des périodes glissantes de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période.
Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,34 et la notation de l'indice de référence était de 2,73 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous investissons au moins 50 % du Portefeuille dans des sociétés affichant une notation élevée de la matérialité des facteurs ESG. Le cas échéant, nous pouvons évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou nous engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %. Le produit financier a conservé plus de 50 % de ses participations dans des sociétés ayant une notation de 1 à 3 sur la période.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.
- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les sociétés ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les éléments contraignants de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ?
Description détaillée :

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

La taxinomie de l’UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l’UE et s’accompagne de critères spécifiques de l’Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s’applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l’homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d’investissements du produit financier au cours de la période de référence.

Investissements les plus importants	Secteur	Moyenne pondérée	Pays
NESTLE SA	Consommation de base	6,22 %	Suisse
ASML HOLDING NV	Technologies de l’information	5,42 %	Pays-Bas
LVMH	Consommation discrétionnaire	5,41 %	France
SCHNEIDER ELECTRIC	Produits industriels	4,49 %	France
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL INDITEX	Consommation discrétionnaire	4,28 %	Espagne
LOREAL SA	Consommation de base	4,01 %	France
TRYG	Finance	3,90 %	Danemark
NOVO NORDISK CLASS B	Santé	3,82 %	Danemark
BRENNTAG	Produits industriels	3,81 %	Allemagne
LONZA GROUP AG	Santé	3,72 %	Suisse
SAP	Technologies de l’information	3,65 %	Allemagne
PERNOD RICARD SA	Consommation de base	3,55 %	France
DAVIDE CAMPARI MILANO NV	Consommation de base	3,42 %	Italie
SIKA AG	Matériaux	3,17 %	Suisse
IMCD NV	Produits industriels	2,77 %	Pays-Bas



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

- *Quelle était l’allocation des actifs ?*

L’allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

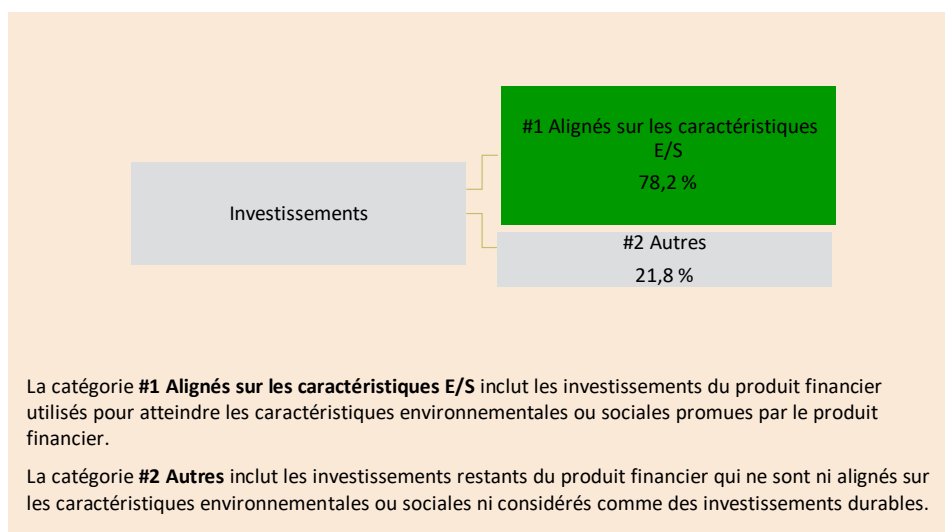
78,2 % du produit financier a été investi dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 1 à 3 et donc alignées sur les caractéristiques E/S.

21,8 % du produit financier a été investi dans : (1) des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 4 ou 5 et n'étaient donc pas alignées sur les caractéristiques E/S, (2) des sociétés non couvertes par le modèle de matérialité des facteurs ESG et (3) des liquidités et des instruments dérivés.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Produits industriels	22,26 %
Consommation de base	17,21 %
Consommation discrétionnaire	16,75 %
Technologies de l'information	12,77 %
Finance	12,13 %
Santé	10,80 %
Matériaux	6,03 %
Liquidité	2,04 %



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

Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

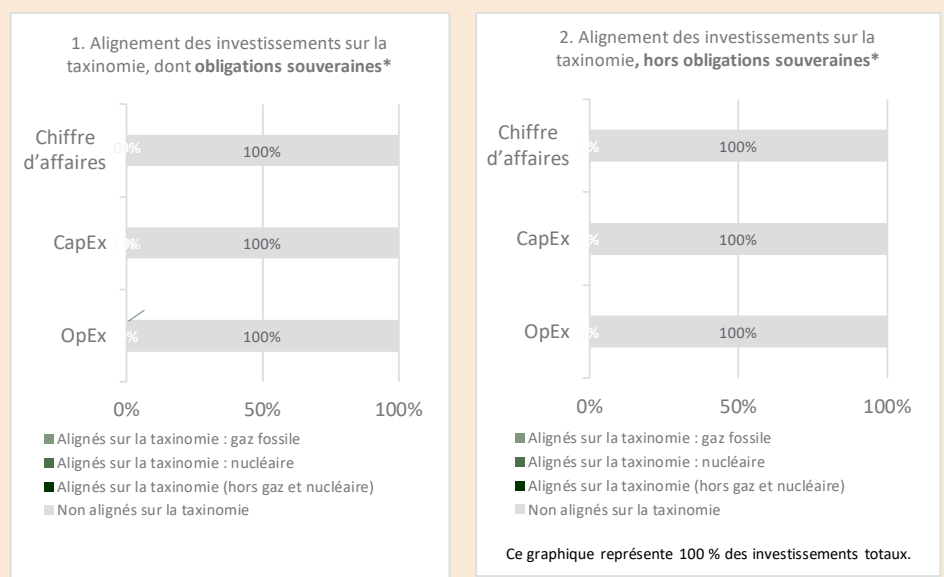
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
 - Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social



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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; (iii) des produits dérivés à des fins de couverture ; (iv) des sociétés dont la notation de la matérialité des facteurs ESG est de 4 ou 5 ; ou (v) des sociétés qui ne sont pas couvertes par le modèle de la matérialité des facteurs ESG.

Ces investissements ne sont pas utilisés pour respecter les caractéristiques environnementales et sociales du Portefeuille. L'objectif de ces titres est de fournir un portefeuille diversifié capable d'atteindre l'objectif financier.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties en appliquant le filtrage d'exclusion à toutes les participations dans les sociétés en portefeuille. Pour les trésoreries et les instruments dérivés, les considérations ESG sont intégrées à l'évaluation du risque de contrepartie.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Par exemple, au cours de la période, nous avons fait appel à ASM International pour discuter de la gouvernance et de l'intégration des indicateurs ESG dans la rémunération des dirigeants. Cela permettra de responsabiliser les dirigeants. Suite à notre engagement, l'entreprise a accepté de mettre en œuvre ce projet. En outre, suite aux engagements pris en 2022, l'entreprise a amélioré la diversité sur le lieu de travail et s'est fixé des objectifs d'embauche en matière de parité hommes-femmes. Enfin, l'entreprise s'est fixé un objectif d'émissions conforme à la perspective mondiale de 1,5°C.

Nous avons également discuté de la stratégie nutritionnelle avec Nestlé. L'entreprise a partagé son ambition d'être un leader dans la vente de produits alimentaires sains. Nous avons exprimé notre inquiétude : contrairement à leurs pairs, Nestlé n'a pas d'objectifs spécifiques. Nous avons déclaré que tout objectif enverrait un message fort à l'ensemble de l'industrie. Nous continuerons à nous engager.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'Indice FTSE World Europe ex UK, tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Threadneedle (Lux) European Smaller Companies

Identifiant d'entité juridique : 54930003VV6JZQNNIC16

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



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

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

Le produit financier promouvait les caractéristiques environnementales et sociales en intégrant les mesures d'investissement responsable suivantes dans le processus de prise de décision d'investissement :

- Comparer favorablement à l'indice sur des critères de la matérialité des facteurs ESG, mesurés par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle, sur des périodes glissantes de 12 mois.
- Conserver au moins 50 % des participations du Portefeuille dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG Columbia Threadneedle de 1 à 3. Le cas échéant, évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou s'engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %.
- Exclure les sociétés qui enfreignent les normes et principes internationaux, tels que le Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.
- Exclure les sociétés impliquées dans des armes controversées, conformément à la politique relative aux armes controversées de Columbia Threadneedle, et les sociétés directement impliquées dans des armes nucléaires.
- Pour soutenir la promotion des caractéristiques environnementales et sociales, engager auprès des sociétés en vue d'influencer les équipes de direction afin d'améliorer leurs pratiques, par exemple en matière d'émissions de carbone.

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

Le produit financier dispose des indicateurs de durabilité suivants :

- L'indicateur principal est la notation de la matérialité des facteurs ESG moyenne pondérée positive du Portefeuille par rapport à l'Indice Euromoney Small Europe ex-UK, évaluée sur des périodes glissantes de 12 mois. La notation de la matérialité des facteurs ESG positive par rapport à l'indice a été contrôlée quotidiennement par nos systèmes de conformité. Le portefeuille a maintenu une meilleure notation de la matérialité des facteurs ESG que l'indice de référence tout au long de la période.
Au 31 mars 2023, la notation du portefeuille était de 2,89 et la notation de l'indice de référence était de 2,86 (sur une échelle de 1 à 5, où la note la plus basse est la meilleure).
- Nous investissons au moins 50 % du Portefeuille dans des sociétés affichant une notation élevée de la matérialité des facteurs ESG. Le cas échéant, nous pouvons évaluer des sociétés qui ne sont pas couvertes par son modèle de Notation de la matérialité des facteurs ESG à l'aide d'une recherche fondamentale, ou nous engager auprès de sociétés affichant une faible notation de la matérialité des facteurs ESG dans le but qu'elles s'améliorent, afin d'atteindre cet engagement minimum de 50 %. Le produit financier a conservé plus de 50 % de ses participations dans des sociétés ayant une notation de 1 à 3 sur la période.
- Nous avons exclu les sociétés qui, selon nous, enfreignent les normes internationales acceptées, par exemple les principes du Pacte mondial des Nations unies. La politique d'exclusion a été respectée grâce à l'application de restrictions strictes en amont des négociations et à un suivi continu.
- Nous avons également respecté notre politique relative aux armes controversées et exclu les sociétés ayant une implication directe dans les armes nucléaires.

Étant donné que ces indicateurs constituent la base des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, ils constituent également les éléments contraignants de la stratégie ESG du Portefeuille.

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

Dans le prochain rapport, nous fournirons une comparaison des indicateurs de développement durable par rapport à une période précédente.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— — — *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

— — — *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l’OCDE à l’intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l’homme ?
Description détaillée :*

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à investir dans des investissements durables.

La taxinomie de l’UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l’UE et s’accompagne de critères spécifiques de l’Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s’applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l’homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



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

Non applicable – le produit financier ne s’engage pas à prendre en compte les principales incidences négatives des décisions d’investissement sur les facteurs de durabilité.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d’investissements du produit financier au cours de la période de référence.

Investissements les plus importants	Secteur	Moyenne pondérée	Pays
CTS EVENTIM AG	Services de communication	2,66 %	Allemagne
SIG GROUP N AG	Matériaux	2,66 %	Suisse
MELEXIS NV	Technologies de l’information	2,63 %	Belgique
ASM INTERNATIONAL NV	Technologies de l’information	2,53 %	Pays-Bas
IMCD NV	Produits industriels	2,51 %	Pays-Bas
BELIMO N AG	Produits industriels	2,51 %	Suisse
BUREAU VERITAS SA	Produits industriels	2,47 %	France
TRYG	Finance	2,40 %	Danemark
FINECOBANK BANCA FINECO	Finance	2,38 %	Italie
VAT GROUP AG	Produits industriels	2,18 %	Suisse
SIKA AG	Matériaux	2,10 %	Suisse
BRENNTAG	Produits industriels	2,03 %	Allemagne
BURCKHARDT COMPRESSION HOLDING AG	Produits industriels	2,01 %	Suisse
AVANZA BANK HOLDING	Finance	1,97 %	Suède
HUHTAMAKI	Matériaux	1,92 %	Finlande



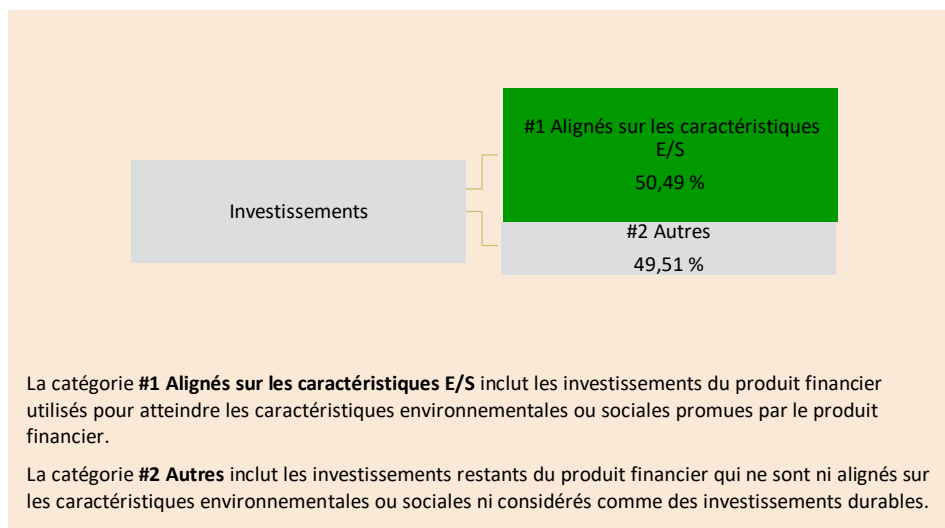
Quelle était la proportion d’investissements liés à la durabilité ?

L’allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

● Quelle était l’allocation des actifs ?

50,49 % du produit financier a été investi dans des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 1 à 3 et donc alignées sur les caractéristiques E/S.

49,51 % du produit financier a été investi dans : (1) des sociétés ayant une notation de la matérialité des facteurs ESG de 4 ou 5 et n’étaient donc pas alignées sur les caractéristiques E/S, (2) des sociétés non couvertes par le modèle de matérialité des facteurs ESG et (3) des liquidités et des instruments dérivés.



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

Secteur	Moyenne pondérée
Produits industriels	27,74 %
Technologies de l'information	16,61 %
Santé	15,91 %
Finance	11,91 %
Matériaux	10,09 %
Consommation de base	5,97 %
Services de communication	5,34 %
Consommation discrétionnaire	4,68 %
Immobilier	0,26 %
Énergie	0,09 %
Liquidité	1,40 %



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

Le fonds ne s'est pas engagé à s'aligner sur les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

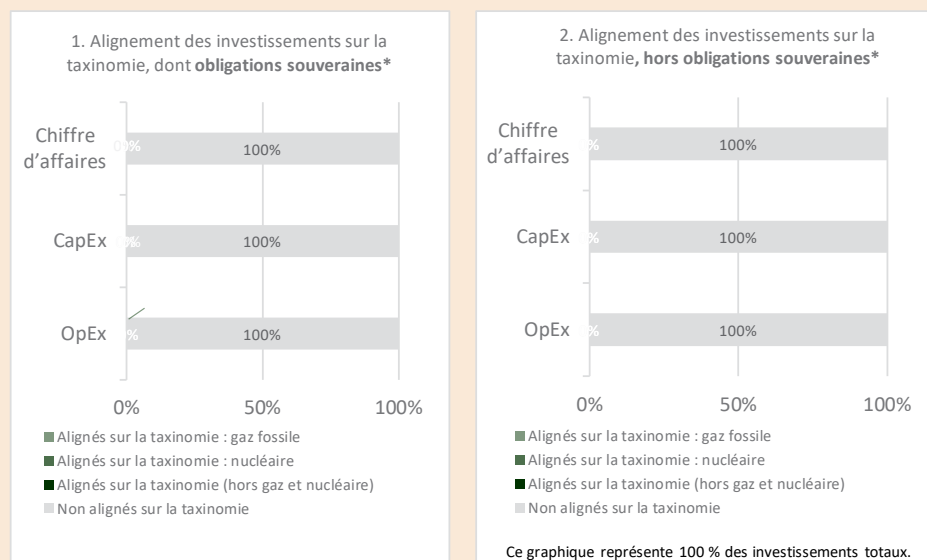
Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

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

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

0 % des investissements réalisés par le fonds sont dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies par le Règlement de l'UE sur la taxinomie.

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE — voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

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

Sur la base de données fiables mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements se situent dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxinomie. Le fonds n'a pas encore publié de rapport d'alignement sur le Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables dont l'objectif environnemental n'est pas conforme au Règlement de l'UE sur la taxinomie.



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

Non applicable - le fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements durables ayant un objectif social




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

Les participations classées comme « autres » comprennent (i) des actifs liquides accessoires (c'est-à-dire des dépôts bancaires à vue) détenus à des fins de gestion de la liquidité ; (ii) des dépôts bancaires, des instruments du marché monétaire ou des fonds du marché monétaire détenus à des fins de trésorerie ; (iii) des produits dérivés à des fins de couverture ; (iv) des sociétés dont la notation de la matérialité des facteurs ESG est de 4 ou 5 ; ou (v) des sociétés qui ne sont pas couvertes par le modèle de la matérialité des facteurs ESG.

Ces investissements ne sont pas utilisés pour respecter les caractéristiques environnementales et sociales du Portefeuille. L'objectif de ces titres est de fournir un portefeuille diversifié capable d'atteindre l'objectif financier.

Les mesures de protection minimales environnementales ou sociales sont garanties en appliquant le filtrage d'exclusion à toutes les participations dans les sociétés en portefeuille. Pour les trésoreries et les instruments dérivés, les considérations ESG sont intégrées à l'évaluation du risque de contrepartie.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



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

Nous nous sommes engagés auprès des entreprises, dans le but d'influencer leur approche des risques ESG et des pratiques ESG.

Par exemple, au cours de la période, nous avons fait appel à ASM International pour discuter de la gouvernance et de l'intégration des indicateurs ESG dans la rémunération des dirigeants. Cela permettra de responsabiliser les dirigeants. Suite à notre engagement, l'entreprise a accepté de mettre en œuvre ce projet. En outre, suite aux engagements pris en 2022, l'entreprise a amélioré la diversité sur le lieu de travail et s'est fixé des objectifs d'embauche en matière de parité hommes-femmes. Enfin, l'entreprise s'est fixé un objectif d'émissions conforme à la perspective mondiale de 1,5°C.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Non applicable - le produit financier ne dispose pas d'un indice de référence désigné utilisé pour mesurer s'il respecte les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Au cours de la période, le produit financier a conservé un profil ESG supérieur à celui de l'Indice Euromoney Small Europe ex-UK, tel que mesuré par le modèle de notation de la matérialité des facteurs ESG de Columbia Threadneedle Investments.

Informations relatives au Règlement de l'UE sur la taxonomie (non auditées)

Le Règlement (UE) 2020/852 est un cadre visant à favoriser les investissements durables (le « Règlement de l'UE sur la taxonomie »), qui établit des critères pour déterminer si une activité économique est considérée comme durable sur le plan environnemental dans six objectifs environnementaux (« alignée sur la taxonomie »). Le Règlement de l'UE sur la taxonomie exige que certaines informations soient communiquées dans le présent Rapport.

Produits financiers soumis à l'article 6

Les investissements sous-jacents aux produits financiers énumérés ci-dessous ne tiennent pas compte des critères de l'UE pour les activités économiques durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxonomie. Les produits financiers soumis à l'article 6 comprennent :

- Threadneedle (Lux) – American
- Threadneedle (Lux) – American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) – American Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) – American Select
- Threadneedle (Lux) – Asia Contrarian Equity
- Threadneedle (Lux) – Asian Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market Corporate Bonds
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market Debt
- Threadneedle (Lux) – Enhanced Commodities
- Threadneedle (Lux) – Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) – European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) – European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) – European Strategic Bond
- Threadneedle (Lux) – Flexible Asian Bond
- Threadneedle (Lux) – Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) – Global Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) – Global Emerging Market Equities
- Threadneedle (Lux) – Global Emerging Market Short-Term Bonds
- Threadneedle (Lux) – Global Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) – Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) – Global Multi Asset Income
- Threadneedle (Lux) – Global Technology
- Threadneedle (Lux) – Pan European Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) – Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) – Pan European Small Cap Opportunities
- Threadneedle (Lux) – UK Equities
- Threadneedle (Lux) – UK Equity Income
- Threadneedle (Lux) – US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) – US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) – US High Yield Bond

Produits financiers soumis à l'article 8 qui promeuvent des caractéristiques environnementales

Les investissements sous-jacents aux produits financiers soumis à l'article 8 énumérés ci-dessous qui promeuvent des caractéristiques environnementales ne s'engagent pas à prendre en compte les critères de l'UE pour les activités économiques durables sur le plan environnemental tels que définis dans le Règlement de l'UE sur la taxonomie et le principe « ne pas causer de préjudice important » du Règlement de l'UE sur la taxonomie ne s'applique donc pas à ces activités. Sur la base de données fiables qui ont été mises à disposition à la date du présent Rapport, 0 % des investissements dans les produits financiers sont alignés sur la taxonomie.

- Threadneedle (Lux) – American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Asia Equities
- Threadneedle (Lux) – European Select
- Threadneedle (Lux) – European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Global Focus
- Threadneedle (Lux) – Global Select
- Threadneedle (Lux) – Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies

Informations relatives au Règlement de l'UE sur la taxonomie (non auditées)

(suite)

- Threadneedle (Lux) – European High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) – Pan European ESG Equities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market ESG Equities

Produits financiers soumis à l'article 8 qui ne promeuvent pas des caractéristiques environnementales

Le portefeuille Threadneedle (Lux) – European Social Bond ne promeut que les caractéristiques sociales. De ce fait, les investissements sous-jacents de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'UE pour les activités économiques durables sur le plan environnemental en vertu du Règlement de l'UE sur la taxonomie et 0 % des investissements du produit financier s'engage à être aligné sur la taxonomie.

Annuaire

Siège social

31 Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Grand-Duché de Luxembourg

Conseiller en investissement

Threadneedle Management Luxembourg S.A.

Société de gestion

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Délégation à¹ :

Columbia Management
Investment Advisers, LLC
225 Franklin Street
Boston MA 02110
États-Unis d'Amérique

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities²
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities²
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
Threadneedle (Lux) - Global Technology

Threadneedle Asset
Management Limited
Cannon Place
78 Cannon Street
Londres EC4N 6AG
Royaume-Uni

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond³
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - European Social Bond
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds³
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt³
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds³
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond⁴
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income⁵
Threadneedle (Lux) - Global Focus
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
Threadneedle (Lux) - Global Select
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - American⁵
Threadneedle (Lux) - American Select⁵
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies⁵
Threadneedle (Lux) - Asia Equities⁴
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities⁵
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - European Select
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income⁴
Threadneedle (Lux) - UK Equities
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha⁵
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities³

Annuaire

(suite)

Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited 3 Killiney Road #07-07 Winsland House 1 Singapour 239519 Singapour	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity ⁶
---	--

STANLIB Asset Management (Pty) Limited 17 Melrose Boulevard Melrose Arch 2196 Johannesbourg Afrique du Sud	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity ⁷
---	---

¹Sous réserve de la responsabilité et de la supervision de Threadneedle Management Luxembourg S.A.

²Threadneedle Asset Management Limited formule des recommandations en matière d'investissement à Columbia Management Investment Advisers, LLC et fournit de fait des conseils en investissement étayés par des recherches à Columbia Management Investment Advisers, LLC.

³Threadneedle Asset Management Limited peut, sous sa propre responsabilité, déléguer la gestion discrétionnaire d'une partie des actifs du Portefeuille à Columbia Management Investment Advisers, LLC (à compter du 1^{er} août 2022 pour Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities).

⁴Threadneedle Asset Management Limited peut, sous sa propre responsabilité, déléguer la gestion discrétionnaire d'une partie des actifs du Portefeuille à Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited.

⁵Columbia Management Investment Advisers, LLC émet des recommandations en matière d'investissement à Threadneedle Asset Management Limited et fournit de fait des conseils en investissement étayés par des recherches à Threadneedle Asset Management Limited.

⁶Columbia Management Investment Advisers, LLC émet des recommandations en matière d'investissement à Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited et fournit de fait des conseils en investissement étayés par des recherches à Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited.

⁷Voir annexe 1.

Annuaire

(suite)

Banque dépositaire, Agent domiciliataire, administratif et payeur

Citibank Europe plc, succursale de Luxembourg
31, Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Grand-Duché de Luxembourg

Agent de transfert et teneur de registres

International Financial Data Services (Luxembourg) S.A.
49, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Distributeur (délégation à divers distributeurs)

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Représentant et Agents payeurs

En Autriche

Erste Bank
Am Belvedere 1
1100 Vienne
Autriche

En Belgique

CACEIS Belgium S.A.
Avenue du Port 86 C b 320
B-1000 Bruxelles
Belgique

En France

CACEIS Bank
1-3, Place Valhubert
75013 Paris
France

En Allemagne

J.P. Morgan AG
Junghofstrasse 14
D-60311 Francfort-sur-le-Main
Allemagne

À Hong Kong

HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited
17/F Tower 2 & 3 HSBC Centre
1 Sham Mong Road
Kowloon
Hong Kong

En Suisse

RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette
Succursale de Zurich
Bleicherweg 7
CH-8027 Zurich
Suisse

Commissaire aux comptes

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443
L-1014 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Conseillers juridiques au Luxembourg

Linklaters LLP
35, Avenue John F. Kennedy, B.P. 1107
L-1011 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Pour en savoir plus, rendez-vous sur columbiathreadneedle.com



Publié par Threadneedle Management Luxembourg S.A. Enregistrée au Registre de Commerce et des Sociétés (Luxembourg), sous le numéro B 110242, 44, rue de la Vallée, L-2661 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg. Au Royaume-Uni, publié par Threadneedle Asset Management Limited (TAML) Enregistrée en Angleterre et au Pays de Galles, sous le numéro : 573204, Cannon Place, 78 Cannon Street, Londres EC4N 6AG, Royaume-Uni. Agréée et réglementée au Royaume-Uni par la Financial Conduct Authority. Columbia Threadneedle Investments est la marque mondiale du groupe de sociétés Columbia et Threadneedle. columbiathreadneedle.com 467660