Rapport annuel
aux actionnaires
31 janvier 2023

MFS Meridian® Funds

SICAV de droit luxembourgeois
RCS : B0039346

SICAV-SF-ANN-1/23

MFS Meridian® Funds
SOMMAIRE

Lettre de la Présidente 3
Tableau des performances. 4
Notes relatives au tableau des performances. 8
Informations générales 9
Gouvernance d'entreprise. 9
Réclamations ou questions des actionnaires 9
Communication de certaines informations sur la gestion du risque. 9
Tableaux des investissements 12
Bilans 191
Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net 196
Statistiques 201
Notes aux états financiers 236
Addenda. 278
Rapport du Réviseur d'entreprises. 284
Rapport du cabinet d'expertise comptable indépendant 286
Administrateurs et administration 288
Principaux agents locaux . . . . . Plat verso

Liste des Fonds MFS Meridian®

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

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

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

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

LETTRE DE LA PRÉSIDENTE

Chères et Chers actionnaires,

Les marchés, qui se sont redressés fin 2022 et début 2023 en raison de signes d'inflation galopante, en espérant la fin prochaine des cycles de resserrement de la politique monétaire et une relance rapide de l'économie chinoise, ont récemment subi des perturbations. Les données sur l'inflation indiquent une persistance accrue des pressions sur les prix au-delà des prévisions, exerçant ainsi une nouvelle pression haussière sur les taux d'intérêt. D'un point de vue positif, les marchés se sont largement adaptés aux défis que constitue l'invasion de l'Ukraine par la Russie, en partie grâce à la température hivernale douce en Europe qui a atténué les inquiétudes relatives à d'éventuelles pénuries de gaz naturel. La résistance des marchés du travail dans la majeure partie des pays développés a également contribué à un contexte économique plus favorable que prévu. Toutefois, les investisseurs sont conscients que les effets différés du resserrement actuel de la politique monétaire tardent encore à se faire sentir dans l'économie mondiale.

Le resserrement des conditions financières mondiales constitue un frein pour les actions de croissance à forte valorisation et pour les secteurs économiques sensibles aux taux d'intérêt, tels que l'immobilier. Sur le court terme, nous croyons que les sociétés seront contraintes de faire face à un contexte défavorable quant à leurs bénéfices, car elles devront supporter des coûts d'intrants et de main-d'œuvre plus élevés, tout en diminuant le pouvoir de fixation des prix. En ce qui concerne les revenus fixes, la hausse des taux d'intérêt a renforcé l'attrait des obligations, ce qui peut contribuer à équilibrer les portefeuilles des investisseurs.

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

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

Cordialement,

Lina Medeiros
Présidente du Conseil d'administration
MFS Investment Management Company (Lux) S.à r.l.
Le 4 mai 2023

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

TABLEAU DES PERFORMANCES (non révisé)

Taux de rendement totaux pour l'exercice clos le 31 janvier 2023

Catégorie d'actions	Asia Ex-Japan Fund	Blended Research European Equity Fund	Continental European Equity Fund	Contrarian Value Fund	Diversified Income Fund	Emerging Markets Debt Fund	Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Emerging Markets Equity Fund
A1 (EUR)	(8,47) %	(0,36) %	(0,13) %	7,22 %(a)	N/A	(7,11) %	(1,69) %	(9,85) %
A1 (GBP)	N/A	N/A	5,27 %	N/A	N/A	(1,75) %	N/A	N/A
A1 (USD)	(11,44) %	(3,55) %	(3,36) %	3,67 %	(7,34) %	(10,09) %	(4,91) %	(12,74) %
A2 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	(7,39) %	(10,10) %	(4,81) %	N/A
A4 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	(4,24) %	N/A	N/A	N/A
AH1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	(0,41) %	(10,04) %	(12,48) %	N/A	N/A
AH1 (USD)	N/A	2,54 %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
AH2 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	(9,74) %	(12,73) %	N/A	N/A
AH4 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	(9,95) %	N/A	N/A	N/A
C1 (USD)	(12,11) %	(4,25) %	(4,10) %	2,94 %	(8,22) %	(10,99) %	(5,84) %	(13,43) %
C2 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	(8,26) %	(11,01) %	(5,79) %	N/A
CH1 (USD)	N/A	2,19 %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
I1 (EUR)	N/A	0,65 %	1,00 %	8,34 %	N/A	N/A	N/A	(8,91) %
I1 (GBP)	(2,18) %	6,05 %	6,39 %	14,54 %	N/A	(1,03) %	N/A	(3,69) %
I1 (USD)	(10,46) %	(2,63) %	(2,31) %	4,84 %	(6,54) %	(9,40) %	(4,19) %	(11,84) %
I2 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(8,91) %
I2 (GBP)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(1,02) %	N/A	N/A
IH1 (CHF)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(12,31) %	N/A	N/A
IH1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	0,63 %	(8,96) %	(11,79) %	N/A	N/A
IH1 (USD)	N/A	3,77 %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
IH2 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(11,72) %	N/A	N/A
IS1 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(9,27) %	N/A	N/A
ISH1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(11,51) %	N/A	N/A
ISH2 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(11,70) %	N/A	N/A
ISH2 (GBP)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(10,59) %	N/A	N/A
ISM1 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(9,18) %	N/A	N/A
N1 (USD)	(11,86) %	(4,07) %	(3,85) %	3,19 %	(7,85) %	(10,50) %	(5,31) %	(13,24) %
N2 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	(7,79) %	(10,57) %	(5,33) %	N/A
NH1 (USD)	N/A	2,43 %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
P1 (EUR)	N/A	(0,33) %	N/A	N/A	(4,26) %	(7,07) %	N/A	(9,85) %
P1 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	(7,34) %	(10,07) %	N/A	(12,79) %
PH1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	(9,85) %	(12,43) %	N/A	(15,47) %
S1 (USD)	(10,54) %	N/A	N/A	N/A	N/A	(9,62) %	N/A	(11,87) %
W1 (EUR)	N/A	0,55 %	0,83 %	8,03 %(a)	(3,54) %	(6,55) %	N/A	N/A
W1 (GBP)	N/A	N/A	N/A	14,43 %	N/A	N/A	N/A	N/A
W1 (USD)	(10,53) %	(2,73) %	(2,41) %	4,73 %	(6,66) %	(9,53) %	(4,27) %	(11,92) %
W2 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	(6,69) %	(9,49) %	(4,31) %	N/A
WH1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	0,40 %	(9,16) %	(11,70) %	(7,01) %	(14,85) %
WH1 (GBP)	N/A	1,42 %	2,07 %	1,81 %	(7,99) %	(10,77) %	(5,74) %	(13,75) %
WH1 (USD)	N/A	3,67 %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
WH2 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(12,25) %	N/A	N/A
WH2 (GBP)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(11,06) %	N/A	N/A
WS1 (USD)	N/A	N/A	N/A	15,99 %(a)	N/A	(9,19) %	N/A	N/A
WSH1 (CHF)	N/A	N/A	N/A	12,70 %(a)	N/A	N/A	N/A	N/A
WSH1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	13,19 %(a)	N/A	(11,56) %	N/A	N/A
WSH2 (GBP)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(10,34) %	N/A	N/A
Z1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(8,09) %
Z1 (JPY)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	0,71 %
Z1 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(8,77) %	N/A	N/A

TABLEAU DES PERFORMANCES (non révisé)

Taux de rendement totaux pour l'exercice clos le 31 janvier 2023

Catégorie d'actions	Emerging Markets Equity Research Fund	Euro Credit Fund	European Core Equity Fund	European Research Fund	European Smaller Companies Fund	European Value Fund	Global Concentrated Fund	Global Credit Fund
A1 (EUR)	N/A	(11,92) %	(3,21) %	(3,52) %	(8,96) %	(4,06) %	(4,94) %	(9,67) %
A1 (GBP)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	1,08 %	N/A	N/A
A1 (USD)	(14,78) %	(14,78) %	(6,33) %	(6,61) %	(11,89) %	(7,17) %	(7,98) %	(12,56) %
A2 (EUR)	N/A	(11,91) %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
A2 (USD)	N/A	(14,68) %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(12,59) %
AH1 (CHF)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(4,80) %	N/A	N/A
AH1 (EUR)	(17,47) %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(14,83) %
AH1 (USD)	N/A	N/A	(0,22) %	(0,35) %	(6,10) %	(1,31) %	N/A	N/A
C1 (USD)	(15,05) %	(15,61) %	(7,05) %	(7,37) %	(12,54) %	N/A	(8,68) %	(13,40) %
C2 (USD)	N/A	(15,60) %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(13,35) %
CH1 (USD)	N/A	N/A	(1,04) %	(1,29) %	(6,67) %	N/A	N/A	N/A
I1 (EUR)	(11,05) %	(11,30) %	(2,10) %	(2,46) %	(8,04) %	(3,12) %	(3,99) %	N/A
I1 (GBP)	(5,96) %	(6,55) %	3,16 %	2,78 %	N/A	2,08 %	1,51 %	(3,82) %
I1 (USD)	(13,92) %	(14,16) %	(5,28) %	(5,61) %	(11,00) %	(6,26) %	(7,09) %	(11,96) %
I3 (EUR)	N/A	N/A	N/A	(2,45) %	N/A	N/A	N/A	N/A
IH1 (EUR)	(16,53) %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
IH1 (SGD)	N/A	N/A	N/A	0,01 %	N/A	N/A	N/A	N/A
IH1 (USD)	N/A	N/A	N/A	0,39 %	(5,19) %	(0,18) %	N/A	N/A
IH1R (EUR)	N/A	N/A	N/A	17,74 %	N/A	N/A	N/A	N/A
IS1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	(2,32) %	(7,84) %	(2,98) %	N/A	N/A
ISB1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	5,51 %(a)	N/A	N/A	N/A	N/A
N1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(4,58) %	N/A	N/A
N1 (USD)	(15,24) %	(15,19) %	(6,80) %	(7,11) %	(12,30) %	(7,67) %	(8,43) %	(13,08) %
N2 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(12,93) %
NH1 (USD)	N/A	N/A	(0,92) %	(1,14) %	(6,45) %	N/A	N/A	N/A
P1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	(3,50) %	N/A	N/A	(4,94) %	N/A
P1 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(7,99) %	N/A
PH1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(11,44) %	N/A
S1 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(7,03) %	N/A
W1 (EUR)	N/A	(11,35) %	(2,20) %	(2,55) %	(8,27) %	(3,36) %	(4,23) %	N/A
W1 (GBP)	N/A	(6,61) %	3,01 %	N/A	N/A	1,86 %	1,26 %	N/A
W1 (USD)	(13,98) %	(14,25) %	(5,37) %	(5,70) %	(11,21) %	(6,45) %	(7,29) %	(12,07) %
W2 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(12,04) %
WH1 (CHF)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(4,16) %	N/A	N/A
WH1 (EUR)	(16,65) %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(10,82) %	(14,42) %
WH1 (GBP)	(15,46) %	N/A	(1,03) %	(1,64) %	N/A	(2,23) %	(9,64) %	(13,44) %
WH1 (USD)	N/A	N/A	0,82 %	0,46 %	(5,26) %	(0,36) %	N/A	N/A
Z1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	(1,73) %	N/A	(2,30) %	N/A	N/A

TABLEAU DES PERFORMANCES (non révisé)

Taux de rendement totaux pour l'exercice clos le 31 janvier 2023

Catégorie d'actions	Global Equity Fund	Global Equity Income Fund	Global High Yield Fund	Global Intrinsic Value Fund	Global New Discovery Fund	Global Opportunistic Bond Fund	Global Research Focused Fund	Global Total Return Fund(b)
A1 (EUR)	(4,77) %	N/A	(1,98) %	(5,93) %	(9,94) %	(3,70) %	(7,37) %	1,10 %
A1 (GBP)	0,66 %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
A1 (USD)	(7,85) %	1,05 %	(5,17) %	(9,00) %	(12,87) %	(6,88) %	(10,36) %	4,40 %
A2 (EUR)	N/A	N/A	(1,98) %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
A2 (USD)	N/A	1,04 %	(5,21) %	N/A	N/A	(6,89) %	N/A	N/A
AH1 (EUR)	(11,14) %	(1,94) %	N/A	(12,05) %	(15,83) %	(9,27) %	N/A	1,30 %
AH2 (EUR)	N/A	(2,09) %	(7,52) %	N/A	N/A	(9,15) %	N/A	N/A
C1 (USD)	(8,56) %	0,32 %	(6,11) %	(9,67) %	(13,55) %	(7,81) %	(11,02) %	3,80 %
C2 (USD)	N/A	0,27 %	(6,06) %	N/A	N/A	(7,86) %	N/A	N/A
I1 (EUR)	(3,84) %	5,45 %	N/A	(4,93) %	(9,02) %	N/A	(6,35) %	1,85 %
I1 (GBP)	1,66 %	N/A	N/A	0,51 %	(3,81) %	N/A	(0,99) %	6,32 %
I1 (JPY)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	2,61 %	N/A
I1 (USD)	(6,95) %	2,05 %	(4,40) %	(8,00) %	(11,96) %	(6,28) %	(9,38) %	5,01 %
I2 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(6,29) %	N/A	N/A
IH1 (EUR)	(11,17) %	(1,13) %	N/A	(11,22) %	(15,83) %	(8,45) %	N/A	1,76 %
IH1 (GBP)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(7,54) %	N/A	N/A
IH1 (JPY)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(8,88) %	(12,39) %	N/A
IH2 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(8,44) %	N/A	N/A
IH2 (GBP)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(7,07) %	N/A	N/A
IS1 (EUR)	(3,70) %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
N1 (USD)	(8,33) %	0,51 %	(5,61) %	(9,47) %	(13,31) %	(7,33) %	(10,82) %	4,00 %
N2 (USD)	N/A	0,53 %	(5,62) %	N/A	N/A	(7,38) %	N/A	N/A
P1 (EUR)	(4,80) %	N/A	N/A	(5,93) %	N/A	(3,79) %	N/A	N/A
P1 (USD)	(7,86) %	N/A	N/A	N/A	N/A	(6,88) %	N/A	N/A
PH1 (EUR)	(11,13) %	N/A	N/A	(12,28) %	N/A	(8,97) %	N/A	N/A
S1 (USD)	(7,03) %	N/A	(4,73) %	N/A	N/A	N/A	(9,61) %	N/A
W1 (EUR)	(4,07) %	N/A	N/A	(5,00) %	N/A	(3,36) %	N/A	N/A
W1 (GBP)	1,42 %	N/A	N/A	0,40 %	(3,85) %	N/A	N/A	N/A
W1 (USD)	(7,17) %	1,97 %	(4,48) %	(8,11) %	(12,08) %	(6,32) %	(9,45) %	5,10 %
W2 (USD)	N/A	1,91 %	(4,40) %	N/A	N/A	(6,41) %	N/A	N/A
WH1 (EUR)	(10,42) %	(1,28) %	(6,63) %	(11,38) %	(15,00) %	(8,93) %	N/A	1,70 %
WH1 (GBP)	(9,42) %	(0,13) %	(5,26) %	(10,38) %	(13,98) %	(6,82) %	N/A	2,20 %
Z1 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(5,86) %	N/A	N/A

TABLEAU DES PERFORMANCES (non révisé)

Taux de rendement totaux pour l'exercice clos le 31 janvier 2023

Catégorie d'actions	Global Total Return Fund	Inflation-Adjusted Bond Fund	Japan Equity Fund	Limited Maturity Fund	Managed Wealth Fund	Prudent Capital Fund	Prudent Wealth Fund	U.K. Equity Fund
A1 (EUR)	(2,52) %	N/A	(7,87) %	0,44 %	N/A	(4,86) %	(7,74) %	N/A
A1 (GBP)	3,09 %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	1,31 %
A1 (USD)	(5,64) %	(8,37) %	(10,83) %	(2,83) %	(0,82) %	(7,99) %	(10,71) %	(7,26) %
A2 (USD)	(5,61) %	(8,47) %	N/A	(2,79) %	N/A	N/A	N/A	N/A
A4 (EUR)	(2,46) %	N/A	N/A	N/A	N/A	(4,91) %	N/A	N/A
AH1 (CHF)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(11,19) %	N/A	N/A
AH1 (EUR)	(8,47) %	N/A	N/A	N/A	(3,01) %	(10,63) %	(13,46) %	N/A
AH2 (EUR)	(8,52) %	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
AH4 (EUR)	(8,43) %	N/A	N/A	N/A	N/A	(10,84) %	N/A	N/A
C1 (USD)	(6,41) %	(9,39) %	(11,53) %	(3,85) %	(1,51) %	(8,69) %	(11,38) %	(7,92) %
C2 (USD)	(6,43) %	(9,35) %	N/A	(3,91) %	N/A	N/A	N/A	N/A
I1 (EUR)	N/A	N/A	(6,85) %	N/A	3,59 %	(3,87) %	(6,83) %	N/A
I1 (GBP)	4,12 %	N/A	(1,52) %	N/A	9,42 %	1,64 %	(1,49) %	2,43 %
I1 (JPY)	N/A	N/A	1,24 %(a)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
I1 (USD)	(4,70) %	(7,97) %	(9,89) %	(2,17) %	0,14 %	(6,97) %	(9,83) %	(6,25) %
I2 (GBP)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	2,42 %
IH1 (EUR)	(7,62) %	(2,28) %(a)	N/A	N/A	(2,38) %	(9,53) %	(12,33) %	N/A
IH1R (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	6,51 %	N/A	N/A
N1 (USD)	(6,23) %	(8,96) %	(11,33) %	(3,39) %	(1,28) %	(8,43) %	(11,15) %	(7,73) %
N2 (USD)	(6,18) %	(8,97) %	N/A	(3,42) %	N/A	N/A	N/A	N/A
P1 (EUR)	(2,52) %	N/A	N/A	N/A	2,51 %	(4,86) %	N/A	N/A
P1 (USD)	(5,64) %	N/A	N/A	N/A	(0,82) %	(7,99) %	N/A	N/A
PH1 (EUR)	(8,82) %	N/A	N/A	N/A	(3,36) %	(10,52) %	N/A	N/A
S1 (USD)	(4,86) %	(8,15) %	N/A	(2,48) %	N/A	(7,13) %	N/A	N/A
W1 (EUR)	(1,85) %	N/A	N/A	N/A	N/A	(3,95) %	(7,04) %	N/A
W1 (GBP)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	1,53 %	(1,72) %	2,34 %
W1 (USD)	(5,03) %	(8,01) %	(9,93) %	(2,30) %	0,39 %	(7,08) %	(10,01) %	(6,53) %
W2 (GBP)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	2,35 %
W2 (USD)	(5,01) %	(8,01) %	N/A	(2,33) %	N/A	N/A	N/A	N/A
WH1 (CHF)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(10,06) %	N/A	N/A
WH1 (EUR)	(7,84) %	N/A	N/A	N/A	(2,48) %	(9,78) %	(12,61) %	N/A
WH1 (GBP)	(6,49) %	N/A	N/A	N/A	(0,82) %	(8,56) %	(11,54) %	N/A
ZH1 (JPY)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(9,52) %	N/A	N/A

TABLEAU DES PERFORMANCES (non révisé)

Taux de rendement totaux pour l'exercice clos le 31 janvier 2023

Catégorie d'actions	U.S. Concentrated Growth Fund	U.S. Corporate Bond Fund	U.S. Government Bond Fund	U.S. Growth Fund	U.S. Total Return Bond Fund	U.S. Value Fund
A1 (EUR)	N/A	N/A	(5,63) %	N/A	N/A	N/A
A1 (USD)	(10,55) %	(10,38) %	(8,65) %	(18,76) %	(9,33) %	(1,83) %
A2 (USD)	N/A	(10,40) %	(8,60) %	N/A	(9,30) %	N/A
AH1 (EUR)	N/A	(12,84) %	(11,10) %	(21,67) %	(11,56) %	(4,86) %
C1 (USD)	(11,27) %	(11,28) %	(9,63) %	(19,39) %	(10,23) %	(2,56) %
C2 (USD)	N/A	(11,28) %	(9,67) %	N/A	(10,19) %	N/A
I1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	(15,13) %	N/A	2,55 %
I1 (GBP)	(1,36) %	N/A	N/A	(10,29) %	N/A	8,41 %
I1 (USD)	(9,71) %	(9,73) %	(8,21) %	(17,89) %	(8,65) %	(0,76) %
IH1 (EUR)	N/A	(11,90) %	N/A	(20,97) %	(10,97) %	(3,69) %
IH2 (EUR)	N/A	N/A	(10,51) %	N/A	N/A	N/A
N1 (USD)	(11,03) %	(10,86) %	(9,19) %	(19,18) %	(9,78) %	(2,37) %
N2 (USD)	N/A	(10,84) %	(9,28) %	N/A	(9,74) %	N/A
P1 (USD)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(1,86) %
PH1 (EUR)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	(4,64) %
S1 (USD)	(9,66) %	N/A	(8,31) %	N/A	(8,83) %	(0,95) %
W1 (USD)	(9,78) %	(9,86) %	(8,24) %	(17,98) %	(8,78) %	(0,87) %
W2 (USD)	N/A	(9,83) %	(8,36) %	N/A	(8,77) %	N/A
WH1 (EUR)	(13,01) %	(11,91) %	N/A	(21,06) %	(11,09) %	(3,95) %
WH1 (GBP)	(12,14) %	(10,67) %	N/A	(20,14) %	(9,56) %	(3,00) %
Z1 (USD)	N/A	N/A	N/A	(17,31) %	N/A	N/A

(a) La performance correspond à la période allant du début des activités de la catégorie à la fin de la période indiquée. Voir la note 18 pour de plus amples informations.
(b) Le compartiment a commencé ses activités le 18 mai 2022.

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES PERFORMANCES

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

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

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

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

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

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

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

INFORMATIONS GÉNÉRALES

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

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

La liste des changements intervenus dans les portefeuilles au cours de la période close le 31 janvier 2023 est disponible gratuitement au siège social du fonds.

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

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

Les documents d'offre les plus récents du fonds, y compris les Documents d'informations clés (DIC), les Key Facts Statements (KFS) pour les investisseurs à Hong Kong et les prospectus, contiennent des informations sur les objectifs d'investissement, les charges, les frais et les risques des compartiments. Les documents d'offre, les Statuts, les rapports financiers et les autres informations concernant le fonds sont mis à la disposition des investisseurs, sans frais, au siège social du fonds, auprès de votre intermédiaire financier, ou en ligne sur *www.meridian.mfs.com*. Veuillez les lire soigneusement avant d'investir. Veuillez également noter que tous les compartiments ou toutes les catégories d'actions ne sont pas nécessairement enregistrés ou agréés pour la distribution dans toutes les juridictions. Dans certaines juridictions, un investissement peut uniquement être effectué par un investisseur qualifié et/ou par le biais d'un intermédiaire agréé sur la base d'un placement privé limité, en fonction des dispositions législatives et réglementaires applicables dans le pays de distribution. Veuillez noter qu'à compter du 31 janvier 2023, le Contrarian Value Fund, les compartiments Contrarian Value Fund, Diversified Income Fund, Emerging Markets Debt Local Currency Fund, Emerging Markets Equity Research Fund, Euro Credit Fund, Global Credit Fund, Global Equity Income Fund, Global Intrinsic Value Fund, Global New Discovery Fund, Global Opportunistic Bond Fund, Global Strategic Equity Fund, Managed Wealth Fund, Prudent Capital Fund, U.S. Corporate Bond Fund, U.S. Equity Income Fund et U.S. Growth Fund n'étaient pas enregistrés à Hong Kong et qu'ils n'étaient donc pas offerts au public dans cette juridiction.

GOUVERNANCE D'ENTREPRISE

CODE DE CONDUITE DE L'ALFI

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

RÉCLAMATIONS OU QUESTIONS DES ACTIONNAIRES

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Pour le compartiment Global Opportunistic Bond Fund, le niveau d'effet de levier prévu peut varier entre 0 % et 400 % (mesuré au moyen de la somme de la valeur notionnelle des instruments dérivés utilisés par le compartiment) de sa valeur nette. En outre, la Société de Gestion suit d'une manière complémentaire le niveau d'effet de levier attendu mesuré au moyen de l'approche par les engagements, lequel peut varier entre 0 % et 125 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment. Dans certaines circonstances, telles que des conditions de marché exceptionnelles ou des facteurs opérationnels temporaires, le niveau d'effet de levier pourrait dépasser les fourchettes indiquées ci-dessus. À compter du 24 avril 2023, le niveau d'effet de levier attendu mesuré au moyen de l'approche par les engagements peut varier entre 0 % et 200 % suivant la valeur nette d'inventaire du compartiment.

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

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

Veuillez consulter le tableau ci-dessous pour une synthèse des informations concernant les résultats quotidiens de la VaR et de l'effet de levier au titre des compartiments Emerging Markets Debt Local Currency Fund, Euro Credit Fund, Global Credit Fund, Global Opportunistic Bond Fund et Managed Wealth Fund entre le 1er février 2022 et la clôture de l'exercice le 31 janvier 2023 :

1er février 2022 – 31 janvier 2023	Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Euro Credit Fund	Global Credit Fund	Global Opportunistic Bond Fund
VaR relative la plus basse	49,48 %	47,44 %	83,77 %	82,38 %
VaR relative la plus élevée	106,08 %	184,46 %	133,33 %	153,10 %
VaR relative moyenne	97,18 %	120,91 %	111,27 %	107,98 %
Niveau d'effet de levier le plus bas (somme de la valeur notionnelle)	63,76 %	31,72 %	18,19 %	159,36 %
Niveau d'effet de levier le plus haut (somme de la valeur notionnelle)	249,54 %	122,64 %	126,60 %	502,03 %
Niveau d'effet de levier moyen (somme de la valeur notionnelle)	116,75 %	51,13 %	44,85 %	249,19 %
Niveau d'effet de levier le plus bas (approche par les engagements)	49,30 %	16,29 %	6,09 %	65,47 %
Niveau d'effet de levier le plus haut (approche par les engagements)	68,38 %	65,95 %	70,11 %	115,75 %
Niveau d'effet de levier moyen (approche par les engagements)	55,72 %	26,43 %	18,31 %	90,80 %

1er février 2022 – 31 janvier 2023	Managed Wealth Fund
VaR absolue la plus basse	2,06 %
VaR absolue la plus élevée	3,39 %
VaR absolue moyenne	2,79 %
Niveau d'effet de levier le plus bas (somme de la valeur notionnelle)	67,75 %
Niveau d'effet de levier le plus haut (somme de la valeur notionnelle)	90,24 %
Niveau d'effet de levier moyen (somme de la valeur notionnelle)	76,47 %
Niveau d'effet de levier le plus bas (approche par les engagements)	66,69 %
Niveau d'effet de levier le plus haut (approche par les engagements)	83,93 %
Niveau d'effet de levier moyen (approche par les engagements)	73,65 %

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2023

MFS Meridian Funds - Asia Ex-Japan Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Singapore Technologies Engineering Ltd.	234 700	660 670	1,30
Boissons alcoolisées			
China Resources Beer Holdings Co. Ltd.	130 000	977 344	1,93
Kweichow Moutai Co. Ltd., "A"	4 700	1 283 874	2,53
Wuliangye Yibin Co. Ltd.	15 300	473 246	0,93
		2 734 464	5,39
Industrie de la confection			
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	52 400	656 575	1,29
Industrie automobile			
BYD Co. Ltd.	28 500	897 400	1,77
Mahindra & Mahindra Ltd.	36 051	608 025	1,20
Maruti Suzuki India Ltd.	3 969	432 264	0,85
		1 937 689	3,82
Biotechnologies			
Hugel, Inc.	4 955	571 605	1,13
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	21 700	975 250	1,92
Services aux entreprises			
Infosys Ltd.	14 729	277 289	0,55
Kingsoft Cloud Holdings, ADR	55 215	265 032	0,52
Tech Mahindra Ltd.	35 991	447 601	0,88
		989 922	1,95
Produits chimiques			
UPL Ltd.	63 619	590 348	1,16
Logiciels			
Kingsoft Corp.	139 600	516 944	1,02
NAVER Corp.	2 518	419 568	0,83
NetEase, Inc.	41 925	741 725	1,46
		1 678 237	3,31
Logiciels - Systèmes			
E Ink Holdings, Inc.	64 000	372 031	0,73
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	137 000	457 001	0,90
Samsung Electronics Co. Ltd.	60 060	3 002 033	5,92
		3 831 065	7,55
Construction			
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	148 500	562 475	1,11
Midea Group Co. Ltd., "A"	83 300	683 012	1,34
Techtronic Industries Co. Ltd.	70 000	902 493	1,78
Zhejiang Supor Co. Ltd., "A"	35 300	270 414	0,53
		2 418 394	4,76
Biens de consommation			
AmorePacific Corp.	8 421	1 004 189	1,98
Services de consommation			
Trip.com Group Ltd.	12 566	461 926	0,91
Équipements électriques			
Advantech Co. Ltd.	48 000	548 033	1,08
Contemporary Amperex Technology Co. Ltd., "A"	6 300	436 731	0,86
		984 764	1,94
Électronique			
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	237 814	4 195 560	8,26
Énergie - Sociétés indépendantes			
Reliance Industries Ltd.	37 465	1 079 075	2,13
Ingénierie - Construction			
Doosan Bobcat, Inc.	19 993	568 517	1,12

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2023

MFS Meridian Funds - Asia Ex-Japan Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Alimentation et boissons			
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd., "A"	182 063	881 217	1,74
Assurances			
AIA Group Ltd.	209 800	2 369 269	4,67
Ping An Insurance Co. of China Ltd., "H"	87 500	682 985	1,34
Prudential PLC	17 105	283 451	0,56
		3 335 705	6,57
Internet			
Tencent Holdings Ltd.	63 000	3 070 800	6,05
Loisirs et jouets			
NCsoft Corp.	1 132	421 277	0,83
Machines et outils			
AirTAC International Group	9 000	308 667	0,61
Grandes banques			
Bandhan Bank Ltd.	220 361	658 697	1,30
Bank BTPN Syariah Tbk PT	4 119 300	703 496	1,38
DBS Group Holdings Ltd.	55 300	1 513 855	2,98
		2 876 048	5,66
Équipements médicaux			
Venus MedTech HangZhou, Inc., "H'	128 000	249 433	0,49
Métaux et exploitation minière			
PT United Tractors Tbk	472 800	774 332	1,52
Gaz naturel - Distribution			
China Resources Gas Group Ltd.	190 300	799 677	1,57
Réseaux et télécommunications			
GDS Holdings Ltd., "A"	66 034	192 852	0,38
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Chailease Holding Co.	120 642	912 826	1,80
China Merchants Bank Co Ltd. "A"	147 229	902 209	1,77
China Merchants Bank Co. Ltd.	39 000	252 916	0,50
HDFC Bank Ltd.	45 949	904 069	1,78
KB Financial Group, Inc.	7 127	324 732	0,64
Kotak Mahindra Bank Ltd.	43 170	915 038	1,80
PT Bank Central Asia Tbk	643 300	364 581	0,72
		4 576 371	9,01
Immobilier			
CapitaLand Investment Ltd.	195 100	592 335	1,17
ESR Group Ltd.	401 800	808 241	1,59
		1 400 576	2,76
Restaurants			
Jollibee Foods Corp.	98 400	429 715	0,85
Yum China Holdings, Inc.	19 687	1 212 916	2,39
		1 642 631	3,24
Magasins spécialisés			
Alibaba Group Holding Ltd.	181 036	2 501 605	4,93
Meituan, "B"	17 160	382 104	0,75
		2 883 709	5,68
Télécommunications mobiles			
Advanced Info Service Public Co. Ltd.	106 900	633 110	1,25
PT Telekom Indonesia	1 282 400	329 369	0,65
		962 479	1,90
Services téléphoniques			
Singapore Telecommunications Ltd.	114 900	220 206	0,43
Services publics - Énergie électrique			
CLP Holdings Ltd.	59 000	439 033	0,86
Total des actions ordinaires (coût identifié, 51 399 810 $)		50 373 263	99,22

MFS Meridian Funds - Asia Ex-Japan Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 663 000 $)	USD	663 000	663 000	1,31
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 52 062 810 $) (k)			51 036 263	100,53
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			(269 410)	(0,53)
ACTIF NET			50 766 853	100,00

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

MFS Meridian Funds - Blended Research European Equity Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
QinetiQ Group PLC	7 274	29 927	0,36
Thales S.A.	859	104 392	1,27
		134 319	1,63
Compagnies aériennes			
Ryanair Holdings PLC, ADR	768	63 953	0,77
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	2 058	82 150	0,99
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	2 581	72 209	0,87
Christian Dior S.A.	60	47 636	0,58
Compagnie Financiere Richemont S.A.	1 206	171 042	2,07
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	333	267 584	3,24
		558 471	6,76
Industrie automobile			
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	3 566	104 096	1,26
D'Ieteren Group	92	16 125	0,19
Stellantis N.V.	6 284	90 578	1,10
		210 799	2,55
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Deutsche Boerse AG	295	48 488	0,59
Services aux entreprises			
Eurofins Scientific SE	1 247	82 264	1,00
Experian PLC	2 037	68 504	0,83
Serco Group PLC	25 453	42 113	0,51
		192 881	2,34
Logiciels			
Dassault Systemes SE	2 757	94 254	1,14
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	2 177	125 970	1,53
Cap Gemini S.A.	253	44 132	0,53
		170 102	2,06
Construction			
Forterra PLC	22 053	53 393	0,65
Biens de consommation			
L'Oréal S.A.	105	39 897	0,48
Reckitt Benckiser Group PLC	1 674	109 652	1,33
Societe BIC S.A.	466	31 118	0,38
Unilever PLC	752	35 339	0,43
		216 006	2,62

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2023

MFS Meridian Funds - Blended Research European Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Équipements électriques			
Legrand S.A.	1 064	87 479	1,06
Schneider Electric SE	1 230	183 465	2,22
		270 944	3,28
Électronique			
ASML Holding N.V.	482	293 622	3,56
NXP Semiconductors N.V.	231	39 162	0,47
		332 784	4,03
Énergie - Sociétés intégrées			
Aker BP ASA	1 430	40 077	0,49
Eni S.p.A.	10 833	153 683	1,86
Harbour Energy PLC	14 889	53 063	0,64
Shell PLC	2 847	76 920	0,93
TotalEnergies SE	3 764	215 101	2,60
		538 844	6,52
Divertissement			
CTS Eventim AG	917	58 963	0,71
Alimentation et boissons			
Nestlé S.A.	3 015	338 430	4,10
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Tesco PLC	44 153	123 370	1,49
Meubles et appareils			
Howden Joinery Group PLC	12 166	95 386	1,16
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	316	45 203	0,55
Whitbread PLC	2 732	94 614	1,14
		139 817	1,69
Assurances			
Beazley PLC	4 735	35 801	0,43
Hannover Rueck SE	300	55 860	0,68
Sampo OYJ, "A"	2 397	115 667	1,40
Zurich Insurance Group AG	361	164 229	1,99
		371 557	4,50
Internet			
Scout24 AG	1 871	99 874	1,21
Loisirs et jouets			
Ubisoft Entertainment S.A.	1 016	19 462	0,24
Machines et outils			
Aalberts Industries N.V.	2 090	90 962	1,10
GEA Group AG	2 912	120 411	1,46
Volvo Group	5 858	106 799	1,29
		318 172	3,85
Grandes banques			
ABN AMRO Group N.V., GDR	7 929	120 775	1,46
Bank of Ireland Group PLC	11 026	108 182	1,31
BNP Paribas	3 121	196 780	2,38
Erste Group Bank AG	1 998	69 616	0,84
Lloyds TSB Group PLC	90 814	54 472	0,66
NatWest Group PLC	41 930	146 742	1,78
UBS Group AG	9 167	179 540	2,18
UniCredit S.p.A.	4 617	82 763	1,00
		958 870	11,61
Équipements médicaux			
ConvaTec Group PLC	28 386	75 468	0,92
QIAGEN N.V.	1 689	76 127	0,92
		151 595	1,84

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2023

MFS Meridian Funds - Blended Research European Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Métaux et exploitation minière			
Glencore PLC	21 482	132 669	1,61
K+S AG	2 847	62 593	0,76
Rio Tinto PLC	2 475	177 976	2,15
		373 238	4,52
Gaz naturel - Distribution			
Centrica PLC	62 687	71 925	0,87
Réseaux et télécommunications			
LM Ericsson Telephone Co., "B"	17 113	91 256	1,10
Produits pharmaceutiques			
AstraZeneca PLC	508	61 138	0,74
Bayer AG	2 368	135 106	1,63
Novartis AG	2 265	188 427	2,28
Novo Nordisk A.S., "B"	796	101 396	1,23
Roche Holding AG	949	272 818	3,30
Sanofi	2 144	193 794	2,35
		952 679	11,53
Imprimerie et édition			
Wolters Kluwer N.V.	1 131	113 383	1,37
Immobilier			
LEG Immobilien SE	1 234	88 481	1,07
Tritax Big Box PLC, REIT	44 944	79 781	0,97
		168 262	2,04
Restaurants			
Sodexo	819	74 637	0,90
Produits chimiques spéciaux			
Linde PLC	324	97 978	1,19
Télécommunications mobiles			
Vodafone Group PLC	94 524	100 167	1,21
Services téléphoniques			
Orange S.A.	3 972	38 661	0,47
Tabac			
British American Tobacco PLC	4 513	158 760	1,92
Imperial Brands PLC	2 346	54 099	0,66
		212 859	2,58
Services publics - Énergie électrique			
E.ON SE	13 807	137 994	1,67
Iberdrola S.A.	14 223	152 990	1,85
		290 984	3,52
Total des actions ordinaires (coût identifié, 7 458 718 €)		8 228 913	99,63
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT			
Fonds communs de placement			
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 1,77 % (v) (coût identifié, 57 463 €)	57 463	57 463	0,70
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 7 516 181 €) (k)		8 286 376	100,33
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		(26 991)	(0,33)
ACTIF NET		8 259 385	100,00

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

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2023

MFS Meridian Funds - Continental European Equity Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Boissons alcoolisées			
Pernod Ricard S.A.	3 076	585 424	3,06
Industrie de la confection			
Kering S.A.	583	334 788	1,75
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1 256	1 009 264	5,27
		1 344 052	7,02
Industrie automobile			
Continental AG	1 987	128 040	0,67
Radio-télévision			
Publicis Groupe S.A.	3 697	239 900	1,25
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Deutsche Boerse AG	2 359	387 737	2,02
Logiciels			
Dassault Systemes SE	7 870	269 054	1,41
SAP SE	9 752	1 055 772	5,51
		1 324 826	6,92
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	5 461	315 996	1,65
Cap Gemini S.A.	4 431	772 926	4,03
		1 088 922	5,68
Construction			
Kingspan Group PLC	1 675	98 740	0,52
Biens de consommation			
L'Oréal S.A.	934	354 890	1,85
Équipements électriques			
Prysmian S.p.A.	11 907	446 466	2,33
Schneider Electric SE	7 028	1 048 284	5,47
		1 494 750	7,80
Énergie - Sociétés intégrées			
Galp Energia SGPS S.A., "B"	14 992	188 524	0,98
Ingénierie - Construction			
Arcadis N.V.	5 145	205 280	1,07
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	6 601	332 096	1,73
Nestlé S.A.	11 871	1 332 507	6,96
		1 664 603	8,69
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	2 858	408 726	2,13
Internet			
Scout24 AG	2 953	157 631	0,82
Machines et outils			
Assa Abloy AB	15 674	339 798	1,77
GEA Group AG	9 566	395 554	2,07
Schindler Holding AG	791	154 995	0,81
		890 347	4,65
Grandes banques			
Bank of Ireland Group PLC	27 000	264 913	1,38
Erste Group Bank AG	3 562	124 110	0,65
ING Groep N.V.	25 137	333 728	1,74
UBS Group AG	27 774	543 966	2,84
		1 266 717	6,61
Technologies et services médicaux et de santé			
Alcon, Inc.	2 119	146 969	0,77
Équipements médicaux			
EssilorLuxottica	3 925	660 639	3,45
QIAGEN N.V.	9 363	418 058	2,18

MFS Meridian Funds - Continental European Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Équipements médicaux, suite			
Sonova Holding AG	792	182 131	0,95
		1 260 828	6,58
Réseaux et télécommunications			
LM Ericsson Telephone Co., "B"	32 137	171 373	0,90
Services pétroliers			
Tenaris S.A.	13 117	213 948	1,12
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
AIB Group PLC	91 343	351 619	1,84
Allfunds Group PLC	2 305	16 950	0,09
Julius Baer Group Ltd.	4 652	274 194	1,43
Komercní banka A.S.	4 291	132 961	0,69
		775 724	4,05
Produits pharmaceutiques			
Bayer AG	9 754	556 513	2,90
Merck KGaA	549	104 995	0,55
Novartis AG	12 206	1 015 424	5,30
Roche Holding AG	3 558	1 022 852	5,34
		2 699 784	14,09
Produits chimiques spéciaux			
Akzo Nobel N.V.	3 334	228 107	1,19
Linde PLC	2 868	867 287	4,53
Sika AG	1 145	299 851	1,56
		1 395 245	7,28
Magasins spécialisés			
Just Eat Takeaway	1 795	42 523	0,22
Services publics - Énergie électrique			
Fortum Corp.	7 387	102 378	0,53
Total des actions ordinaires (coût identifié, 17 306 034 €)		18 637 881	97,28
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT			
Fonds communs de placement			
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 1,77 % (v) (coût identifié, 519 529 €)	520 680	520 680	2,72
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 17 825 563 €) (k)		19 158 561	100,00
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		(176)	(0,00)
ACTIF NET		19 158 385	100,00

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

MFS Meridian Funds - Contrarian Value Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Airbus SE	87 949	11 020 167	4,21
Babcock International Group PLC	1 409 922	5 308 529	2,02
BAE Systems PLC	527 454	5 571 526	2,13
		21 900 222	8,36
Compagnies aériennes			
Ryanair Holdings PLC, ADR	91 625	8 294 811	3,17
Industrie de la confection			
Adidas AG	32 885	5 268 973	2,01

MFS Meridian Funds - Contrarian Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Industrie automobile			
Autoliv, Inc.	117 729	10 845 195	4,14
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	319 387	10 135 853	3,87
		20 981 048	8,01
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Citigroup, Inc.	67 896	3 545 529	1,35
Services aux entreprises			
Constellium SE	369 340	5 366 510	2,05
Logiciels			
Sage Group PLC	939 440	9 011 750	3,44
Logiciels - Systèmes			
Hitachi Ltd.	81 700	4 289 950	1,64
Construction			
CRH PLC	206 930	9 626 834	3,68
Services de consommation			
Booking Holdings, Inc.	3 759	9 149 782	3,49
Équipements électriques			
Philips Lighting N.V.	254 890	9 202 428	3,52
Spectris PLC	82 017	3 250 409	1,24
		12 452 837	4,76
Énergie - Sociétés intégrées			
Cenovus Energy, Inc.	422 348	8 437 120	3,22
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	170 654	9 333 841	3,56
Assurances			
Swiss Re Ltd.	58 850	6 155 283	2,35
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	62 237	6 151 505	2,35
Loisirs et jouets			
Electronic Arts, Inc.	49 423	6 359 752	2,43
Machines et outils			
Toyota Industries Corp.	30 400	1 850 011	0,71
Weir Group PLC	304 966	6 714 700	2,56
		8 564 711	3,27
Grandes banques			
Bank of America Corp.	112 172	3 979 863	1,52
Bank of Ireland Group PLC	751 039	8 011 072	3,06
BNP Paribas	72 800	4 990 085	1,91
NatWest Group PLC	1 800 900	6 851 861	2,62
Resona Holdings, Inc.	1 145 800	6 345 927	2,42
UBS Group AG	314 230	6 690 689	2,55
		36 869 497	14,08
Métaux et exploitation minière			
ArcelorMittal S.A.	293 130	9 063 465	3,46
Chemins de fer et transport maritime			
CSX Corp.	280 888	8 685 057	3,32
Immobilier			
Vonovia SE, REIT	131 091	3 686 879	1,41
Magasins spécialisés			
NEXT PLC	204 916	16 803 424	6,42
Télécommunications mobiles			
T-Mobile US, Inc.	30 143	4 500 651	1,72
Services publics - Énergie électrique			
National Grid PLC	457 946	5 825 002	2,23

MFS Meridian Funds - Contrarian Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Services publics - Eau				
Veolia Environnement S.A.		227 135	6 740 226	2,57
Total des actions ordinaires (coût identifié, 227 817 173 $)			247 064 659	94,35
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 16 245 000 $)	USD	16 245 000	16 245 000	6,20
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 244 062 173 $) (k)			263 309 659	100,55
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			(1 444 628)	(0,55)
ACTIF NET			261 865 031	100,00

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

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Aérospatiale et défense				
Bombardier, Inc., 7,5 %, 15/03/2025	USD	36 000	36 045	0,04
Bombardier, Inc., 7,125 %, 15/06/2026		40 000	39 904	0,05
Bombardier, Inc., 7,5 %, 1/02/2029		25 000	24 976	0,03
General Dynamics Corp., 3,625 %, 1/04/2030		45 000	43 424	0,05
Moog, Inc., 4,25 %, 15/12/2027		102 000	94 605	0,11
Raytheon Technologies Corp., 1,9 %, 1/09/2031		16 000	13 041	0,01
Raytheon Technologies Corp., 2,375 %, 15/03/2032		60 000	50 452	0,06
Raytheon Technologies Corp., 3,03 %, 15/03/2052		76 000	56 085	0,06
TransDigm, Inc., 6,25 %, 15/03/2026		65 000	64 977	0,07
TransDigm, Inc., 6,375 %, 15/06/2026		65 000	64 187	0,07
TransDigm, Inc., 5,5 %, 15/11/2027		15 000	14 325	0,02
TransDigm, Inc., 4,625 %, 15/01/2029		71 000	64 053	0,07
			566 074	0,64
Industrie de la confection				
Tapestry, Inc., 4,125 %, 15/07/2027		21 000	20 193	0,02
Tapestry, Inc., 3,05 %, 15/03/2032		53 000	43 443	0,05
			63 636	0,07
Créances adossées à des actifs et titrisées				
Commercial Mortgage Trust, 2017-COR2, "A3", 3,51 %, 10/09/2050		77 616	73 493	0,08
GS Mortgage Securities Trust, 2015-GC30, "A4", 3,382 %, 10/05/2050		75 000	71 976	0,08
KREF 2018-FT1 Ltd., "A", FLR, 5,535 %, 15/02/2039		100 000	96 930	0,11
KREF 2018-FT1 Ltd., "AS", FLR, 5,764 %, 15/02/2039		100 000	95 273	0,11
MF1 2020-FL4 Ltd., "A", FLR, 6,297 %, 15/11/2035		72 413	72 413	0,08
MF1 2021-FL5 Ltd., "B", FLR, 6,047 %, 15/07/2036		100 000	96 595	0,11
PFP III 2021-8 Ltd., "A", FLR, 5,454 %, 9/08/2037		83 453	80 281	0,09
PFP III 2021-8 Ltd., "AS", FLR, 5,704 %, 9/08/2037		100 000	94 163	0,11
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL7, "A", FLR, 5,705 %, 25/11/2036		98 249	95 272	0,11
Santander Drive Auto Receivables Trust, 2022-5, "A2", 3,98 %, 15/01/2025		15 835	15 775	0,02
Santander Drive Auto Receivables Trust, 2022-6, "A2", 4,37 %, 15/05/2025		5 000	4 982	0,00
Westlake Automobile Receivable Trust, 2023-1A, "A2B", FLR, 5,25 %, 15/06/2026		10 000	10 000	0,01
Westlake Automobile Receivables Trust, 2022-3A, "A2", 5,24 %, 15/07/2025		27 000	26 973	0,03
			834 126	0,94
Industrie automobile				
Clarios Global LP/Clarios U.S. Finance Co., 8,5 %, 15/05/2027		80 000	79 681	0,09
Dana, Inc., 5,375 %, 15/11/2027		56 000	53 212	0,06
Dana, Inc., 4,25 %, 1/09/2030		35 000	29 621	0,03

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Industrie automobile, suite				
Dornoch Debt Merger Sub, Inc., 6,625 %, 15/10/2029	USD	68 000	51 057	0,06
Ford Motor Credit Co. LLC, 4,134 %, 4/08/2025		200 000	190 994	0,22
Hyundai Capital America, 1,8 %, 10/01/2028		30 000	25 426	0,03
Hyundai Capital America, 6,375 %, 8/04/2030		82 000	86 185	0,10
Real Hero Merger Sub 2, Inc., 6,25 %, 1/02/2029		50 000	37 125	0,04
			553 301	0,63
Radio-télévision				
Activision Blizzard, Inc., 2,5 %, 15/09/2050		51 000	34 269	0,04
Advantage Sales & Marketing, Inc., 6,5 %, 15/11/2028		58 000	44 080	0,05
Discovery Communications LLC, 3,625 %, 15/05/2030		52 000	45 741	0,05
Discovery Communications LLC, 4 %, 15/09/2055		34 000	23 386	0,03
Gray Escrow II, Inc., 5,375 %, 15/11/2031		127 000	97 666	0,11
iHeartCommunications, Inc., 8,375 %, 1/05/2027		75 000	67 219	0,08
Prosus N.V., 3,68 %, 21/01/2030		200 000	173 000	0,19
Scripps Escrow II, Inc., 5,875 %, 15/07/2027		63 000	56 227	0,06
Summer (BC) Bidco B LLC, 5,5 %, 31/10/2026		200 000	164 383	0,19
Walt Disney Co., 3,35 %, 24/03/2025		56 000	54 582	0,06
Walt Disney Co., 3,5 %, 13/05/2040		83 000	70 999	0,08
Walt Disney Co., 3,8 %, 13/05/2060		52 000	42 999	0,05
Warnermedia Holdings, Inc., 4,279 %, 15/03/2032		41 000	36 488	0,04
Warnermedia Holdings, Inc., 5,391 %, 15/03/2062		30 000	24 964	0,03
WMG Acquisition Corp., 3,875 %, 15/07/2030		79 000	69 638	0,08
			1 005 641	1,14
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
AG TTMT Escrow Issuer LLC, 8,625 %, 30/09/2027		75 000	77 383	0,09
Aretec Escrow Issuer, Inc., 7,5 %, 1/04/2029		60 000	53 250	0,06
Brookfield Finance, Inc., 2,34 %, 30/01/2032		92 000	74 419	0,08
Intercontinental Exchange, Inc., 1,85 %, 15/09/2032		48 000	37 785	0,04
Intercontinental Exchange, Inc., 5,2 %, 15/06/2062		55 000	54 250	0,06
LPL Holdings, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		85 000	80 889	0,09
LPL Holdings, Inc., 4 %, 15/03/2029		55 000	49 225	0,06
LPL Holdings, Inc., 4,375 %, 15/05/2031		39 000	34 149	0,04
NFP Corp., 4,875 %, 15/08/2028		60 000	52 364	0,06
NFP Corp., 6,875 %, 15/08/2028		67 000	57 932	0,07
			571 646	0,65
Construction				
ABC Supply Co., Inc., 4 %, 15/01/2028		145 000	132 105	0,15
Fortune Brands Home & Security, Inc., 4 %, 25/03/2032		106 000	96 139	0,11
Foundation Building Materials LLC, 6 %, 1/03/2029		53 000	42 631	0,05
GYP Holding III Corp., 4,625 %, 1/05/2029		105 000	88 533	0,10
Interface, Inc., 5,5 %, 1/12/2028		95 000	79 814	0,09
MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Co., 5,5 %, 1/02/2030		50 000	41 574	0,05
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 9,75 %, 15/07/2028		61 000	57 845	0,07
Patrick Industries, Inc., 7,5 %, 15/10/2027		85 000	84 103	0,09
SRM Escrow Issuer LLC, 6 %, 1/11/2028		55 000	50 216	0,06
SRS Distribution, Inc., 6,125 %, 1/07/2029		70 000	60 194	0,07
Standard Industries, Inc., 4,75 %, 15/01/2028		50 000	46 858	0,05
Standard Industries, Inc., 4,375 %, 15/07/2030		104 000	88 907	0,10
Standard Industries, Inc., 3,375 %, 15/01/2031		10 000	7 942	0,01
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030		63 000	57 566	0,06
Vulcan Materials Co., 4,5 %, 15/06/2047		32 000	28 616	0,03
White Cap Buyer LLC, 6,875 %, 15/10/2028		60 000	54 613	0,06
			1 017 656	1,15
Services aux entreprises				
Entegris Escrow Corp., 5,95 %, 15/06/2030		32 000	30 731	0,03

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services aux entreprises, suite				
Equifax, Inc., 3,1 %, 15/05/2030	USD	71 000	62 296	0,07
Equifax, Inc., 2,35 %, 15/09/2031		40 000	32 949	0,04
Equinix, Inc., 2,5 %, 15/05/2031		91 000	76 045	0,09
Fiserv, Inc., 4,4 %, 1/07/2049		78 000	66 950	0,08
HealthEquity, Inc., 4,5 %, 1/10/2029		65 000	58 195	0,07
Iron Mountain, Inc., 4,875 %, 15/09/2027		60 000	56 492	0,06
Iron Mountain, Inc., 5,25 %, 15/03/2028		35 000	33 282	0,04
Mastercard, Inc., 3,85 %, 26/03/2050		77 000	69 926	0,08
Verscend Escrow Corp., 9,75 %, 15/08/2026		81 000	81 282	0,09
Visa, Inc., 2,05 %, 15/04/2030		62 000	54 081	0,06
Visa, Inc., 2,7 %, 15/04/2040		70 000	55 962	0,06
Visa, Inc., 2 %, 15/08/2050		84 000	53 628	0,06
ZI Technologies LLC/ZI Finance Corp. Co., 3,875 %, 1/02/2029		20 000	17 250	0,02
			749 069	0,85
Télévision par câble				
Cable One, Inc., 4 %, 15/11/2030		72 000	59 366	0,07
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 5,125 %, 1/05/2027		50 000	47 653	0,06
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,75 %, 1/03/2030		195 000	170 389	0,19
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,5 %, 15/08/2030		100 000	85 446	0,10
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,25 %, 1/02/2031		55 000	45 818	0,05
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,25 %, 15/01/2034		70 000	54 569	0,06
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 6,384 %, 23/10/2035		35 000	35 795	0,04
Comcast Corp., 1,5 %, 15/02/2031		79 000	63 859	0,07
Comcast Corp., 3,75 %, 1/04/2040		56 000	49 487	0,06
CSC Holdings LLC, 5,375 %, 1/02/2028		200 000	168 750	0,19
DISH DBS Corp., 7,75 %, 1/07/2026		40 000	32 486	0,04
DISH DBS Corp., 5,25 %, 1/12/2026		65 000	56 022	0,06
DISH DBS Corp., 5,125 %, 1/06/2029		55 000	34 974	0,04
DISH Network Corp., 11,75 %, 15/11/2027		20 000	20 784	0,02
Sirius XM Holdings, Inc., 3,875 %, 1/09/2031		95 000	78 316	0,09
Sirius XM Radio, Inc., 4 %, 15/07/2028		50 000	44 505	0,05
Sirius XM Radio, Inc., 5,5 %, 1/07/2029		135 000	126 515	0,14
United Group B.V., 4,625 %, 15/08/2028	EUR	100 000	88 037	0,10
Videotron Ltd., 5,125 %, 15/04/2027	USD	49 000	47 036	0,05
Videotron Ltd., 3,625 %, 15/06/2029		30 000	26 102	0,03
Virgin Media Finance PLC, 5 %, 15/07/2030		200 000	167 878	0,19
VTR Comunicaciones S.p.A., 5,125 %, 15/01/2028		200 000	140 153	0,16
Ziggo Bond Finance B.V., 5,125 %, 28/02/2030		200 000	165 300	0,19
			1 809 240	2,05
Produits chimiques				
Axalta Coating Systems Ltd., 4,75 %, 15/06/2027		150 000	141 750	0,16
Element Solutions, Inc., 3,875 %, 1/09/2028		92 000	81 420	0,09
Ingevity Corp., 3,875 %, 1/11/2028		88 000	77 131	0,09
LSF11 A5 HoldCo LLC, 6,625 %, 15/10/2029		65 000	53 339	0,06
RPM International, Inc., 4,55 %, 1/03/2029		44 000	41 898	0,05
RPM International, Inc., 4,25 %, 15/01/2048		3 000	2 386	0,00
			397 924	0,45
Logiciels				
Camelot Finance S.A., 4,5 %, 1/11/2026		45 000	42 801	0,05
Cisco Systems, Inc., 5,5 %, 15/01/2040		24 000	26 502	0,03
Clarivate Analytics (US) LLC, 4,875 %, 1/07/2029		65 000	57 195	0,06
Clarivate Science Holdings Corp., 3,875 %, 1/07/2028		20 000	17 846	0,02
Clarivate Science Holdings Corp., 4,875 %, 1/07/2029		5 000	4 400	0,00
Dun & Bradstreet Corp., 5 %, 15/12/2029		65 000	57 557	0,07

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Logiciels, suite				
Microsoft Corp., 3,45 %, 8/08/2036	USD	77 000	71 273	0,08
Microsoft Corp., 2,525 %, 1/06/2050		57 000	40 619	0,05
Neptune Bidco U.S., Inc., 9,29 %, 15/04/2029		45 000	43 741	0,05
VeriSign, Inc., 4,75 %, 15/07/2027		38 000	37 670	0,04
			399 604	0,45
Logiciels - Systèmes				
Apple, Inc., 1,7 %, 5/08/2031		86 000	70 790	0,08
Apple, Inc., 2,65 %, 11/05/2050		79 000	56 120	0,06
Fair Isaac Corp., 5,25 %, 15/05/2026		136 000	135 014	0,15
Fair Isaac Corp., 4 %, 15/06/2028		33 000	30 641	0,04
Sabre GLBL, Inc., 7,375 %, 1/09/2025		18 000	17 656	0,02
Sabre GLBL, Inc., 11,25 %, 15/12/2027		28 000	29 680	0,03
SS&C Technologies Holdings, Inc., 5,5 %, 30/09/2027		112 000	107 715	0,12
Viavi Solutions, Inc., 3,75 %, 1/10/2029		95 000	82 887	0,10
Virtusa Corp., 7,125 %, 15/12/2028		55 000	46 200	0,05
			576 703	0,65
Conglomérats				
BWX Technologies, Inc., 4,125 %, 30/06/2028		48 000	43 320	0,05
BWX Technologies, Inc., 4,125 %, 15/04/2029		127 000	113 669	0,13
Chart Industries, Inc., 9,5 %, 1/01/2031		27 000	28 174	0,03
Gates Global LLC, 6,25 %, 15/01/2026		85 000	83 711	0,10
Griffon Corp., 5,75 %, 1/03/2028		75 000	70 981	0,08
Madison IAQ LLC, 5,875 %, 30/06/2029		86 000	68 219	0,08
Otis Worldwide Corp., 2,565 %, 15/02/2030		12 000	10 474	0,01
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		36 000	36 548	0,04
Regal Rexnord Corp., 6,3 %, 15/02/2030		79 000	80 553	0,09
Regal Rexnord Corp., 6,4 %, 15/04/2033		45 000	46 140	0,05
TriMas Corp., 4,125 %, 15/04/2029		149 000	132 647	0,15
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,95 %, 15/09/2028		70 000	69 534	0,08
			783 970	0,89
Construction				
Empire Communities Corp., 7 %, 15/12/2025		60 000	54 300	0,06
Mattamy Group Corp., 5,25 %, 15/12/2027		30 000	27 450	0,03
Mattamy Group Corp., 4,625 %, 1/03/2030		85 000	71 688	0,08
Meritage Homes Corp., 3,875 %, 15/04/2029		60 000	53 175	0,06
Taylor Morrison Communities, Inc., 5,75 %, 15/01/2028		79 000	76 631	0,09
Weekley Homes LLC/Weekley Finance Corp., 4,875 %, 15/09/2028		55 000	47 864	0,05
			331 108	0,37
Biens de consommation				
Energizer Holdings, Inc., 4,375 %, 31/03/2029		93 000	80 763	0,09
Hasbro, Inc., 3,9 %, 19/11/2029		44 000	40 220	0,05
Mattel, Inc., 3,375 %, 1/04/2026		77 000	71 803	0,08
Mattel, Inc., 5,875 %, 15/12/2027		15 000	14 962	0,02
Mattel, Inc., 3,75 %, 1/04/2029		34 000	30 546	0,03
Mattel, Inc., 6,2 %, 1/10/2040		5 000	4 643	0,01
Mattel, Inc., 5,45 %, 1/11/2041		25 000	21 396	0,02
Newell Brands, Inc., 6,375 %, 15/09/2027		38 000	38 197	0,04
Newell Brands, Inc., 6,625 %, 15/09/2029		45 000	45 490	0,05
Prestige Consumer Healthcare, Inc., 5,125 %, 15/01/2028		60 000	57 315	0,07
Prestige Consumer Healthcare, Inc., 3,75 %, 1/04/2031		30 000	25 473	0,03
Spectrum Brands, Inc., 3,875 %, 15/03/2031		45 000	36 280	0,04
SWF Escrow Issuer Corp., 6,5 %, 1/10/2029		50 000	32 871	0,04
			499 959	0,57
Services de consommation				
Allied Universal Holdco LLC, 6,625 %, 15/07/2026		46 000	44 287	0,05

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services de consommation, suite				
Allied Universal Holdco LLC, 9,75 %, 15/07/2027	USD	75 000	71 625	0,08
ANGI Group LLC, 3,875 %, 15/08/2028		99 000	75 886	0,09
Arches Buyer, Inc., 6,125 %, 1/12/2028		75 000	63 170	0,07
Booking Holdings, Inc., 3,55 %, 15/03/2028		54 000	51 702	0,06
Booking Holdings, Inc., 4,625 %, 13/04/2030		27 000	27 107	0,03
Conservation Fund, 3,474 %, 15/12/2029		48 000	42 284	0,05
GoDaddy, Inc., 3,5 %, 1/03/2029		133 000	115 018	0,13
GW B-CR Security Corp., 9,5 %, 1/11/2027		52 000	51 355	0,06
Match Group Holdings II LLC, 5 %, 15/12/2027		60 000	57 532	0,07
Match Group Holdings II LLC, 4,625 %, 1/06/2028		90 000	82 779	0,09
Match Group Holdings II LLC, 4,125 %, 1/08/2030		20 000	17 200	0,02
Match Group Holdings II LLC, 3,625 %, 1/10/2031		5 000	4 013	0,00
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5,75 %, 15/01/2029		45 000	34 989	0,04
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5,25 %, 15/04/2030		50 000	37 500	0,04
TriNet Group, Inc., 3,5 %, 1/03/2029		118 000	99 088	0,11
WASH Multi-Family Acquisition, Inc., 5,75 %, 15/04/2026		57 000	52 595	0,06
			928 130	1,05
Conteneurs				
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC, 4 %, 1/09/2029		200 000	165 372	0,19
Can-Pack S.A./Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,875 %, 15/11/2029		200 000	166 078	0,19
Crown Americas LLC, 5,25 %, 1/04/2030		65 000	62 562	0,07
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. V, 4,25 %, 30/09/2026		105 000	100 344	0,11
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. VI, 4,75 %, 1/02/2026		30 000	29 308	0,03
LABL, Inc., 5,875 %, 1/11/2028		20 000	18 075	0,02
			541 739	0,61
Équipements électriques				
Arrow Electronics, Inc., 3,875 %, 12/01/2028		64 000	60 176	0,07
CommScope Technologies LLC, 5 %, 15/03/2027		90 000	68 713	0,08
			128 889	0,15
Électronique				
Broadcom, Inc., 3,187 %, 15/11/2036		71 000	54 290	0,06
Entegris, Inc., 4,375 %, 15/04/2028		35 000	31 675	0,04
Entegris, Inc., 3,625 %, 1/05/2029		42 000	35 818	0,04
Lam Research Corp., 1,9 %, 15/06/2030		13 000	10 931	0,01
Lam Research Corp., 4,875 %, 15/03/2049		25 000	25 089	0,03
NXP B.V./NXP Funding LLC/NXP USA, Inc., 3,125 %, 15/02/2042		25 000	17 972	0,02
Qualcomm, Inc., 3,25 %, 20/05/2027		28 000	26 986	0,03
Sensata Technologies B.V., 5,625 %, 1/11/2024		30 000	30 007	0,04
Sensata Technologies B.V., 5 %, 1/10/2025		100 000	98 899	0,11
Sensata Technologies, Inc., 4,375 %, 15/02/2030		35 000	31 684	0,04
Synaptics, Inc., 4 %, 15/06/2029		75 000	64 944	0,07
			428 295	0,49
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A. (République du Panama), 5,125 %, 11/08/2061		200 000	162 500	0,18
Autoridad del Canal de Panama, 4,95 %, 29/07/2035		200 000	194 192	0,22
Bank Negara Indonesia, 3,75 %, 30/03/2026		200 000	187 100	0,21
Comision Federal de Electricidad (États-Unis du Mexique), 3,348 %, 9/02/2031		200 000	163 977	0,19
Dua Capital Ltd. (Fédération de Malaisie), 2,78 %, 11/05/2031		200 000	163 122	0,19
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 7,125 %, 11/02/2025		200 000	191 520	0,22
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 8,45 %, 10/08/2028		200 000	191 647	0,22
Huarong Finance 2017 Co. Ltd. (République populaire de Chine), 4,95 %, 7/11/2047		200 000	142 465	0,16
Huarong Finance 2019 Co. Ltd. (République populaire de Chine), 4,25 %, 7/11/2027		200 000	175 215	0,20
Ipoteka Bank (République d'Ouzbékistan), 5,5 %, 19/11/2025		200 000	186 500	0,21
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 6,375 %, 24/10/2048		200 000	171 000	0,19
MDGH - GMTN RSC Ltd. (Émirats arabes unis), 5,5 %, 28/04/2033		200 000	213 611	0,24

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations quasi souveraines des marchés émergents, suite				
National Bank of Uzbekistan, 4,85 %, 21/10/2025	USD	200 000	187 000	0,21
Office Cherifien des Phosphates S.A. (Royaume du Maroc), 5,125 %, 23/06/2051		200 000	157 124	0,18
Petroleos Mexicanos, 6,84 %, 23/01/2030		75 000	65 252	0,07
Petroleos Mexicanos, 10 %, 7/02/2033		75 000	73 275	0,08
Petroleos Mexicanos, 6,75 %, 21/09/2047		68 000	47 179	0,05
Petroleos Mexicanos, 7,69 %, 23/01/2050		132 000	98 551	0,11
Petroleos Mexicanos, 6,95 %, 28/01/2060		57 000	39 323	0,04
PETRONAS Capital Ltd. (Fédération de Malaisie), 3,404 %, 28/04/2061		200 000	145 926	0,17
PJSC State Savings Bank of Ukraine, 9,375 %, 10/03/2023		13 600	9 569	0,01
PT Freeport Indonesia, 6,2 %, 14/04/2052		200 000	185 000	0,21
QNB Finance Ltd. (État du Qatar), 2,75 %, 12/02/2027		200 000	186 580	0,21
Saudi Arabian Oil Co., 3,5 %, 24/11/2070		200 000	140 000	0,16
State Oil Company of the Azerbaijan Republic, 6,95 %, 18/03/2030		200 000	209 265	0,24
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi A.S. (République turque), 9,375 %, 31/01/2026		200 000	199 720	0,23
			3 886 613	4,40
Obligations souveraines des marchés émergents				
République arabe d'Égypte, 7,903 %, 21/02/2048		200 000	132 752	0,15
République arabe d'Égypte, 8,875 %, 29/05/2050		200 000	142 599	0,16
République dominicaine, 5,3 %, 21/01/2041		150 000	120 051	0,14
République dominicaine, 6,4 %, 5/06/2049		256 000	217 681	0,25
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2025	BRL	115 000	21 636	0,02
Gouvernement d'Ukraine, 7,375 %, 25/09/2034 (p)	USD	350 000	69 125	0,08
Gouvernement d'Ukraine, Obligation liée au PIB, 0 %, 31/05/2041		66 000	20 720	0,02
Royaume hachémite de Jordanie, 7,375 %, 10/10/2047		200 000	179 606	0,20
République islamique du Pakistan, 6 %, 8/04/2026		200 000	86 000	0,10
Royaume d'Arabie Saoudite, 4,625 %, 4/10/2047		200 000	181 356	0,20
République orientale d'Uruguay, 8,25 %, 21/05/2031	UYU	1 835 000	42 600	0,05
République orientale d'Uruguay, 5,75 %, 28/10/2034	USD	122 000	134 955	0,15
République orientale d'Uruguay, 4,975 %, 20/04/2055		41 000	40 582	0,05
République d'Angola, 9,375 %, 8/05/2048		200 000	178 012	0,20
République argentine, 3,875 %, 9/01/2038		288 000	105 794	0,12
République argentine, 3,5 %, 9/07/2041		408 000	138 813	0,16
République de Colombie, 8 %, 20/04/2033		200 000	204 818	0,23
République de Côte d'Ivoire, 4,875 %, 30/01/2032	EUR	100 000	85 091	0,10
République de Côte d'Ivoire, 6,875 %, 17/10/2040		100 000	82 983	0,09
République d'Équateur, 2,5 %, 31/07/2035	USD	79 000	38 443	0,04
République d'Équateur, 1,5 %, 31/07/2040		227 300	95 400	0,11
République de Hongrie, 6,25 %, 22/09/2032		200 000	206 762	0,23
République du Kenya, 8 %, 22/05/2032		200 000	173 764	0,20
République du Pérou, 2,783 %, 23/01/2031		22 000	18 621	0,02
République du Pérou, 1,862 %, 1/12/2032		43 000	32 125	0,04
République des Philippines, 5,5 %, 17/01/2048		200 000	208 349	0,24
République de Pologne, 5,75 %, 16/11/2032		33 000	35 650	0,04
République de Roumanie, 6,625 %, 17/02/2028		122 000	126 331	0,14
République de Roumanie, 1,75 %, 13/07/2030	EUR	53 000	42 134	0,05
République de Roumanie, 2 %, 28/01/2032		64 000	49 317	0,06
République de Serbie, 6,25 %, 26/05/2028	USD	200 000	203 500	0,23
République d'Afrique du Sud, 5,75 %, 30/09/2049		200 000	152 276	0,17
République turque, 9,375 %, 19/01/2033		200 000	195 861	0,22
Sultanat d'Oman, 6,75 %, 17/01/2048		200 000	197 054	0,22
Sultanat d'Oman, 7 %, 25/01/2051		200 000	202 380	0,23
États-Unis du Mexique, 5,75 %, 5/03/2026	MXN	500 000	24 047	0,03
États-Unis du Mexique, 7,5 %, 3/06/2027		500 000	25 242	0,03
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 29/05/2031		700 000	35 142	0,04

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations souveraines des marchés émergents, suite				
États-Unis du Mexique, 4,875 %, 19/05/2033	USD	200 000	192 005	0,22
États-Unis du Mexique, 4,4 %, 12/02/2052		200 000	156 006	0,18
			4 595 583	5,21
Énergie - Sociétés indépendantes				
Antero Resources Corp., 7,625 %, 1/02/2029		50 000	51 130	0,06
CNX Resources Corp., 6 %, 15/01/2029		70 000	64 258	0,07
CNX Resources Corp., 7,375 %, 15/01/2031		12 000	11 670	0,01
Comstock Resources, Inc., 6,75 %, 1/03/2029		85 000	78 413	0,09
CrownRock LP/CrownRock Finance, Inc., F, 5 %, 1/05/2029		80 000	73 276	0,08
Encino Acquisition Partners Holdings LLC, 8,5 %, 1/05/2028		50 000	46 616	0,05
Energean PLC, 6,5 %, 30/04/2027		200 000	187 160	0,21
EQT Corp., 3,625 %, 15/05/2031		62 000	54 267	0,06
Hess Corp., 5,8 %, 1/04/2047		52 000	52 688	0,06
Leviathan Bond Ltd., 6,75 %, 30/06/2030		99 000	96 143	0,11
Moss Creek Resources Holdings, Inc., 7,5 %, 15/01/2026		45 000	41 553	0,05
Permian Resources Operating LLC, 7,75 %, 15/02/2026		10 000	9 994	0,01
Permian Resources Operating LLC, 5,875 %, 1/07/2029		57 000	53 426	0,06
Pioneer Natural Resources Co., 1,9 %, 15/08/2030		69 000	56 602	0,07
SM Energy Co., 6,5 %, 15/07/2028		55 000	52 317	0,06
Southwestern Energy Co., 8,375 %, 15/09/2028		35 000	36 762	0,04
Southwestern Energy Co., 5,375 %, 15/03/2030		45 000	41 906	0,05
Tap Rock Resources LLC, 7 %, 1/10/2026		16 000	15 144	0,02
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 3,25 %, 15/08/2030		200 000	152 264	0,17
			1 175 589	1,33
Énergie - Sociétés intégrées				
BP Capital Markets America, Inc., 1,749 %, 10/08/2030		29 000	24 144	0,03
BP Capital Markets America, Inc., 3,001 %, 17/03/2052		41 000	29 584	0,03
Eni S.p.A., 4,75 %, 12/09/2028		200 000	197 887	0,22
			251 615	0,28
Divertissement				
Carnival Corp. PLC, 7,625 %, 1/03/2026		78 000	70 980	0,08
Carnival Corp. PLC, 5,75 %, 1/03/2027		45 000	37 350	0,04
Carnival Corp. PLC, 9,875 %, 1/08/2027		25 000	25 687	0,03
Life Time, Inc., 5,75 %, 15/01/2026		55 000	52 856	0,06
Life Time, Inc., 8 %, 15/04/2026		15 000	14 569	0,02
NCL Corp. Ltd., 5,875 %, 15/03/2026		53 000	45 844	0,05
NCL Corp. Ltd., 5,875 %, 15/02/2027		15 000	13 946	0,01
Royal Caribbean Cruises Ltd., 5,375 %, 15/07/2027		40 000	34 795	0,04
Royal Caribbean Cruises Ltd., 5,5 %, 1/04/2028		75 000	64 500	0,07
SeaWorld Parks & Entertainment, 5,25 %, 15/08/2029		55 000	49 710	0,06
			410 237	0,46
Établissements financiers				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,3 %, 30/01/2032		166 000	139 375	0,16
Air Lease Corp., 2,875 %, 15/01/2032		130 000	106 780	0,12
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,25 %, 15/04/2026		21 000	19 943	0,02
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,375 %, 1/05/2026		33 000	31 362	0,03
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,75 %, 21/02/2028		63 000	54 277	0,06
Credit Acceptance Corp., 5,125 %, 31/12/2024		75 000	70 041	0,08
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		151 352	138 121	0,16
Howard Hughes Corp., 4,125 %, 1/02/2029		89 000	76 853	0,09
Nationstar Mortgage Holdings, Inc., 6 %, 15/01/2027		98 000	90 895	0,10
OneMain Finance Corp., 6,875 %, 15/03/2025		45 000	44 859	0,05
OneMain Finance Corp., 7,125 %, 15/03/2026		55 000	54 640	0,06
Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc., 3,625 %, 1/03/2029		93 000	78 463	0,09

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Établissements financiers, suite				
Shriram Transport Finance Co. Ltd., 4,4 %, 13/03/2024	USD	200 000	192 750	0,22
SLM Corp., 3,125 %, 2/11/2026		30 000	26 496	0,03
			1 124 855	1,27
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 5,55 %, 23/01/2049		52 000	55 771	0,06
B&G Foods, Inc., 5,25 %, 1/04/2025		45 000	41 011	0,05
B&G Foods, Inc., 5,25 %, 15/09/2027		15 000	12 131	0,01
Bacardi Ltd., 5,15 %, 15/05/2038		100 000	98 018	0,11
BellRing Brands, Inc., 7 %, 15/03/2030		75 000	74 445	0,08
Central American Bottling Corp., 5,25 %, 27/04/2029		71 000	68 181	0,08
Constellation Brands, Inc., 2,25 %, 1/08/2031		61 000	50 330	0,06
Constellation Brands, Inc., 4,1 %, 15/02/2048		94 000	79 597	0,09
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3 %, 2/02/2029		35 000	30 042	0,03
Kraft Heinz Foods Co., 4,875 %, 1/10/2049		26 000	24 318	0,03
Kraft Heinz Foods Co., 5,5 %, 1/06/2050		33 000	33 680	0,04
Lamb Weston Holdings, Inc., 4,125 %, 31/01/2030		80 000	72 100	0,08
Performance Food Group Co., 5,5 %, 15/10/2027		95 000	91 437	0,10
Post Holdings, Inc., 5,625 %, 15/01/2028		65 000	62 562	0,07
Post Holdings, Inc., 4,625 %, 15/04/2030		100 000	88 000	0,10
Primo Water Holding, Inc., 4,375 %, 30/04/2029		100 000	87 224	0,10
PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, 4,805 %, 27/04/2052		200 000	154 035	0,18
SYSCO Corp., 2,45 %, 14/12/2031		68 000	57 046	0,07
SYSCO Corp., 4,45 %, 15/03/2048		18 000	15 950	0,02
U.S. Foods Holding Corp., 4,75 %, 15/02/2029		80 000	73 184	0,08
			1 269 062	1,44
Jeux et hôtellerie				
Boyd Gaming Corp., 4,75 %, 1/12/2027		50 000	47 533	0,05
Boyd Gaming Corp., 4,75 %, 15/06/2031		35 000	31 493	0,04
Caesars Entertainment, Inc., 4,625 %, 15/10/2029		50 000	42 750	0,05
Caesars Entertainment, Inc., 7 %, 15/02/2030		48 000	48 840	0,05
Caesars Resort Collection LLC/CRC Finco, Inc., 8,125 %, 1/07/2027		64 000	64 960	0,07
CCM Merger, Inc., 6,375 %, 1/05/2026		62 000	59 985	0,07
Hilton Domestic Operating Co., Inc., 3,75 %, 1/05/2029		108 000	95 916	0,11
Hilton Domestic Operating Co., Inc., 3,625 %, 15/02/2032		76 000	63 821	0,07
Marriott International, Inc., 2,85 %, 15/04/2031		82 000	69 792	0,08
Marriott International, Inc., 3,5 %, 15/10/2032		66 000	58 315	0,07
Marriott Ownership Resorts, Inc., 4,5 %, 15/06/2029		40 000	34 820	0,04
Sands China Ltd., 4,3 %, 8/01/2026		200 000	189 710	0,21
Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US Finco, Inc., 6,625 %, 1/03/2030		58 000	51 665	0,06
VICI Properties LP / VICI Note Co., Inc., 4,25 %, 1/12/2026		88 000	83 050	0,09
VICI Properties LP / VICI Note Co., Inc., 5,75 %, 1/02/2027		35 000	34 816	0,04
VICI Properties LP / VICI Note Co., Inc., 4,125 %, 15/08/2030		16 000	14 312	0,02
VICI Properties LP, REIT, 4,75 %, 15/02/2028		42 000	40 670	0,05
Wyndham Hotels & Resorts, Inc., 4,375 %, 15/08/2028		93 000	85 774	0,10
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp., 5,125 %, 1/10/2029		80 000	71 400	0,08
			1 189 622	1,35
Industrie				
APi Escrow Corp., 4,75 %, 15/10/2029		95 000	84 705	0,10
Dar Al-Arkan Sukuk Co. Ltd., 6,875 %, 26/02/2027		200 000	195 206	0,22
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,416 %, 1/10/2024		11 000	10 443	0,01
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,516 %, 1/10/2025		12 000	11 317	0,01
Trustees of the University of Pennsylvania, 2,396 %, 1/10/2050		82 000	55 864	0,07
Williams Scotsman International, Inc., 4,625 %, 15/08/2028		87 000	80 610	0,09
			438 145	0,50

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Assurances				
Corebridge Financial, Inc., 3,9 %, 5/04/2032	USD	33 000	30 058	0,03
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042		57 000	49 462	0,06
Equitable Holdings, Inc., 5,594 %, 11/01/2033		82 000	83 956	0,10
			163 476	0,19
Assurances - Santé				
Humana, Inc., 2,15 %, 3/02/2032		62 000	50 333	0,06
Humana, Inc., 4,95 %, 1/10/2044		49 000	47 233	0,05
UnitedHealth Group, Inc., 5,3 %, 15/02/2030		38 000	39 954	0,05
UnitedHealth Group, Inc., 2,3 %, 15/05/2031		38 000	32 689	0,04
UnitedHealth Group, Inc., 4,625 %, 15/07/2035		107 000	108 065	0,12
UnitedHealth Group, Inc., 5,875 %, 15/02/2053		40 000	45 800	0,05
			324 074	0,37
Assurances IARD				
Alliant Holdings Intermediate LLC, 6,75 %, 15/10/2027		30 000	28 060	0,03
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 2,05 %, 23/08/2031		122 000	99 857	0,11
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 2,6 %, 2/12/2031		6 000	5 087	0,01
AssuredPartners, Inc., 5,625 %, 15/01/2029		50 000	42 769	0,05
Fairfax Financial Holdings Ltd., 5,625 %, 16/08/2032		103 000	100 254	0,11
GTCR (AP) Finance, Inc., 8 %, 15/05/2027		35 000	34 367	0,04
Hub International Ltd., 5,625 %, 1/12/2029		104 000	93 067	0,11
Ryan Specialty Group, 4,375 %, 1/02/2030		40 000	36 050	0,04
			439 511	0,50
Obligations souveraines du marché international				
Gouvernement des Bermudes, 3,375 %, 20/08/2050		200 000	144 145	0,16
Machines et outils				
CNH Industrial N.V., 3,85 %, 15/11/2027		116 000	112 728	0,13
Terex Corp., 5 %, 15/05/2029		100 000	93 375	0,10
			206 103	0,23
Grandes banques				
Bank of America Corp., 3,366 % jusqu'au 23/01/2025, FLR jusqu'au 23/01/2026		109 000	105 253	0,12
Bank of America Corp., 3,419 % jusqu'au 20/12/2027, FLR jusqu'au 20/12/2028		124 000	115 975	0,13
Bank of America Corp., 2,496 % jusqu'au 13/02/2030, FLR jusqu'au 13/02/2031		22 000	18 714	0,02
Bank of America Corp., 2,687 % jusqu'au 22/04/2031, FLR jusqu'au 22/04/2032		125 000	105 532	0,12
Bank of America Corp., 3,311 % jusqu'au 22/04/2041, FLR jusqu'au 22/04/2042		86 000	69 204	0,08
Bank of New York Mellon Corp., 5,802 % jusqu'au 25/10/2027, FLR jusqu'au 25/10/2028		54 000	56 776	0,06
Bank of New York Mellon Corp., 5,834 % jusqu'au 25/10/2032, FLR jusqu'au 25/10/2033		41 000	44 404	0,05
Barclays PLC, 2,894 % jusqu'au 24/11/2031, FLR jusqu'au 24/11/2032		200 000	163 272	0,19
Commonwealth Bank of Australia, 3,61 % jusqu'au 12/09/2029, FLR jusqu'au 12/09/2034		200 000	172 956	0,20
Commonwealth Bank of Australia, 3,305 %, 11/03/2041		200 000	147 305	0,17
Credit Agricole S.A., 1,247 % jusqu'au 26/01/2026, FLR jusqu'au 26/01/2027		250 000	223 533	0,25
Goldman Sachs Group, Inc., 2,64 % jusqu'au 24/02/2027, FLR jusqu'au 24/02/2028		104 000	95 359	0,11
Goldman Sachs Group, Inc., 2,65 % jusqu'au 21/10/2031, FLR jusqu'au 21/10/2032		109 000	89 913	0,10
Goldman Sachs Group, Inc., 3,102 % jusqu'au 24/02/2032, FLR jusqu'au 24/02/2033		70 000	59 987	0,07
HSBC Holdings PLC, 2,357 % jusqu'au 18/08/2030, FLR jusqu'au 18/08/2031		200 000	161 822	0,18
JPMorgan Chase & Co., 3,782 % jusqu'au 1/02/2027, FLR jusqu'au 1/02/2028		84 000	80 741	0,09
JPMorgan Chase & Co., 2,545 % jusqu'au 8/11/2031, FLR jusqu'au 8/11/2032		194 000	161 039	0,18
JPMorgan Chase & Co., 3,109 % jusqu'au 22/04/2040, FLR jusqu'au 22/04/2041		77 000	60 873	0,07
Kasikornbank PLC (Hong Kong Branch), 3,343 %, 2/10/2031		200 000	179 340	0,20
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2,494 % jusqu'au 13/10/2031, FLR jusqu'au 13/10/2032		200 000	163 034	0,19
Morgan Stanley, 3,125 %, 27/07/2026		127 000	120 365	0,14
Morgan Stanley, 3,622 % jusqu'au 1/04/2030, FLR jusqu'au 1/04/2031		144 000	132 454	0,15
Morgan Stanley, 3,217 % jusqu'au 22/04/2041, FLR jusqu'au 22/04/2042		50 000	39 938	0,05
National Australia Bank Ltd., 3,347 % jusqu'au 12/01/2032, FLR jusqu'au 12/01/2037		250 000	201 868	0,23
Nordea Bank Abp, 1,5 %, 30/09/2026		200 000	176 744	0,20
Royal Bank of Canada, 2,3 %, 3/11/2031		105 000	87 141	0,10
Royal Bank of Canada, 5 %, 1/02/2033		81 000	82 224	0,09

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Grandes banques, suite				
Toronto-Dominion Bank, 4,108 %, 8/06/2027	USD	29 000	28 527	0,03
Toronto-Dominion Bank, 4,693 %, 15/09/2027		54 000	54 295	0,06
Toronto-Dominion Bank, 2 %, 10/09/2031		68 000	55 697	0,06
Toronto-Dominion Bank, 4,456 %, 8/06/2032		55 000	53 985	0,06
UBS Group AG, 3,179 % jusqu'au 11/02/2042, FLR jusqu'au 11/02/2043		200 000	153 490	0,17
Wells Fargo & Co., 3,908 % jusqu'au 25/04/2025, FLR jusqu'au 25/04/2026		45 000	43 964	0,05
Wells Fargo & Co., 4,54 % jusqu'au 15/08/2025, FLR jusqu'au 15/08/2026		100 000	99 033	0,11
Wells Fargo & Co., 3,35 % jusqu'au 2/03/2032, FLR jusqu'au 2/03/2033		149 000	131 388	0,15
			3 736 145	4,23
Technologies et services médicaux et de santé				
Avantor Funding, Inc., 4,625 %, 15/07/2028		98 000	92 374	0,10
Becton, Dickinson and Co., 2,823 %, 20/05/2030		77 000	68 494	0,08
Becton, Dickinson and Co., 4,298 %, 22/08/2032		101 000	98 591	0,11
Catalent, Inc., 3,125 %, 15/02/2029		167 000	138 149	0,16
Charles River Laboratories International, Inc., 3,75 %, 15/03/2029		137 000	122 024	0,14
CHS/Community Health Systems, Inc., 8 %, 15/12/2027		45 000	42 412	0,05
CHS/Community Health Systems, Inc., 6,125 %, 1/04/2030		120 000	72 137	0,08
CHS/Community Health Systems, Inc., 5,25 %, 15/05/2030		25 000	20 173	0,02
DaVita, Inc., 4,625 %, 1/06/2030		75 000	63 187	0,07
Encompass Health Corp., 5,75 %, 15/09/2025		30 000	29 775	0,03
Encompass Health Corp., 4,75 %, 1/02/2030		60 000	55 000	0,06
Encompass Health Corp., 4,625 %, 1/04/2031		10 000	8 802	0,01
IQVIA Holdings, Inc., 5 %, 15/10/2026		200 000	195 000	0,22
Legacy LifePoint Health LLC, 4,375 %, 15/02/2027		25 000	21 875	0,03
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,325 %, 15/11/2028		78 000	78 895	0,09
Regional Care/LifePoint Health, Inc., 9,75 %, 1/12/2026		70 000	61 378	0,07
Syneos Health, Inc., 3,625 %, 15/01/2029		106 000	85 727	0,10
Tenet Healthcare Corp., 6,125 %, 1/10/2028		128 000	119 690	0,14
Tenet Healthcare Corp., 4,375 %, 15/01/2030		22 000	19 556	0,02
Tenet Healthcare Corp., 6,125 %, 15/06/2030		30 000	29 121	0,03
Thermo Fisher Scientific, Inc., 2 %, 15/10/2031		27 000	22 662	0,03
Thermo Fisher Scientific, Inc., 2,8 %, 15/10/2041		9 000	7 067	0,01
U.S. Acute Care Solutions LLC, 6,375 %, 1/03/2026		60 000	54 276	0,06
			1 506 365	1,71
Équipements médicaux				
Danaher Corp., 2,6 %, 1/10/2050		61 000	42 137	0,05
Garden SpinCo Corp., 8,625 %, 20/07/2030		72 000	77 040	0,08
Mozart Debt Merger Sub, Inc., 5,25 %, 1/10/2029		40 000	33 492	0,04
Teleflex, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		93 000	88 788	0,10
			241 457	0,27
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 2,875 %, 17/03/2031		200 000	171 783	0,19
Baffinland Iron Mines Corp./Baffinland Iron Mines LP, 8,75 %, 15/07/2026		78 000	75 747	0,09
Coeur Mining, Inc., 5,125 %, 15/02/2029		83 000	66 832	0,08
Compass Minerals International, Inc., 6,75 %, 1/12/2027		75 000	73 173	0,08
Eldorado Gold Corp., 6,25 %, 1/09/2029		45 000	41 238	0,05
Ero Cooper Corp., 6,5 %, 15/02/2030		23 000	19 588	0,02
Ero Copper Corp., 6,5 %, 15/02/2030		42 000	35 770	0,04
FMG Resources Ltd., 4,375 %, 1/04/2031		120 000	105 600	0,12
Glencore Funding LLC, 2,5 %, 1/09/2030		35 000	29 658	0,03
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031		70 000	59 952	0,07
GrafTech Finance, Inc., 4,625 %, 15/12/2028		79 000	67 330	0,08
Kaiser Aluminum Corp., 4,625 %, 1/03/2028		87 000	79 431	0,09
Kaiser Aluminum Corp., 4,5 %, 1/06/2031		40 000	33 824	0,04

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Métaux et exploitation minière, suite				
Novelis Corp., 3,25 %, 15/11/2026	USD	25 000	22 633	0,03
Novelis Corp., 4,75 %, 30/01/2030		90 000	81 450	0,09
Novelis Corp., 3,875 %, 15/08/2031		32 000	27 008	0,03
Petra Diamonds US$ Treasury PLC, 10,5 % (10,5 % PIK/9,75 % liquidités au 30/06/2023), 9,75 % liquidités au 8/03/2026 (p)		36 110	35 027	0,04
Petra Diamonds US$ Treasury PLC, 10,5 % (10,5 % PIK/9,75 % liquidités au 30/06/2023), 9,75 % liquidités au 8/03/2026 (p)		122 773	119 090	0,13
TMS International Corp., 6,25 %, 15/04/2029		15 000	11 267	0,01
			1 156 401	1,31
Secteur intermédiaire				
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 3,7 %, 15/11/2029		28 000	26 295	0,03
Cheniere Energy Partners LP, 4,5 %, 1/10/2029		42 000	39 401	0,04
DT Midstream, Inc., 4,125 %, 15/06/2029		64 000	56 160	0,06
DT Midstream, Inc., 4,375 %, 15/06/2031		94 000	82 224	0,09
Enbridge, Inc., 3,4 %, 1/08/2051		54 000	40 268	0,05
Energy Transfer LP, 4 %, 1/10/2027		28 000	26 817	0,03
Energy Transfer LP, 5,55 %, 15/02/2028		22 000	22 357	0,03
Energy Transfer LP, 3,75 %, 15/05/2030		63 000	57 739	0,07
Energy Transfer LP, 5,75 %, 15/02/2033		26 000	26 720	0,03
Energy Transfer Partners LP, 5,15 %, 15/03/2045		52 000	46 926	0,05
EQM Midstream Partners LP, 6 %, 1/07/2025		9 000	8 861	0,01
EQM Midstream Partners LP, 6,5 %, 1/07/2027		19 000	18 658	0,02
EQM Midstream Partners LP, 5,5 %, 15/07/2028		145 000	133 762	0,15
EQM Midstream Partners LP, 4,5 %, 15/01/2029		40 000	35 082	0,04
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 1,75 %, 30/09/2027		162 398	150 610	0,17
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp., 8 %, 15/01/2027		23 000	22 706	0,03
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp., 8,875 %, 15/04/2030		58 000	58 942	0,07
Kinetik Holdings, Inc., 5,875 %, 15/06/2030		115 000	109 250	0,12
Peru LNG, 5,375 %, 22/03/2030		200 000	165 848	0,19
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp., 3,55 %, 15/12/2029		70 000	62 958	0,07
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp., 4,3 %, 31/01/2043		52 000	40 224	0,05
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,2 %, 15/03/2028		117 000	113 390	0,13
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,5 %, 15/05/2030		57 000	55 330	0,06
Tallgrass Energy Partners LP, 5,5 %, 15/01/2028		110 000	101 297	0,12
Targa Resources Corp., 4,2 %, 1/02/2033		74 000	67 063	0,08
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		45 000	38 531	0,04
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Finance Corp., 6,875 %, 15/01/2029		80 000	82 159	0,09
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 3,875 %, 15/08/2029		80 000	71 200	0,08
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4,125 %, 15/08/2031		60 000	53 194	0,06
Venture Global Calcasieu Pass LLC , 6,25 %, 15/01/2030		19 000	19 357	0,02
			1 833 329	2,08
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 3 %, 1/11/2028–1/09/2046		198 716	190 631	0,22
Fannie Mae, 2,5 %, 1/11/2031–1/10/2046		27 124	24 589	0,03
Fannie Mae, 3 %, 25/02/2033 (i)		30 355	2 782	0,00
Fannie Mae, 5,5 %, 1/08/2037–1/05/2044		168 811	176 707	0,20
Fannie Mae, 3,5 %, 25/04/2040–1/12/2047		147 431	142 015	0,16
Fannie Mae, 4 %, 1/09/2040–1/07/2043		136 689	134 995	0,17
Fannie Mae, 5 %, 1/10/2040–1/03/2042		116 161	119 331	0,14
Fannie Mae, 2 %, 25/10/2040–25/05/2044		6 531	6 324	0,01
Fannie Mae, 4,5 %, 1/02/2041–1/11/2042		82 827	84 175	0,09
Fannie Mae, 1,75 %, 25/09/2041		26 162	24 501	0,03
Fannie Mae, UMBS, 2 %, 1/06/2037–1/04/2052		852 484	733 182	0,83
Fannie Mae, UMBS, 2,5 %, 1/03/2042–1/11/2052		553 084	487 055	0,53
Fannie Mae, UMBS, 3,5 %, 1/07/2043–1/06/2050		138 117	131 986	0,14
Fannie Mae, UMBS, 1,5 %, 1/12/2050		49 881	39 966	0,05

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques, suite				
Fannie Mae, UMBS, 3 %, 1/12/2051–1/10/2052	USD	215 343	196 253	0,22
Fannie Mae, UMBS, 4 %, 1/05/2052–1/09/2052		97 774	94 631	0,11
Fannie Mae, UMBS, 4,5 %, 1/09/2052		24 483	24 260	0,03
Fannie Mae, UMBS, 6 %, 1/12/2052		49 952	51 315	0,06
Freddie Mac, 0,903 %, 25/04/2024 (i)		713 749	6 188	0,01
Freddie Mac, 0,597 %, 25/07/2024 (i)		1 086 415	6 883	0,01
Freddie Mac, 3,5 %, 15/01/2027		12 445	12 377	0,01
Freddie Mac, 0,573 %, 25/07/2027 (i)		2 358 386	50 549	0,06
Freddie Mac, 0,424 %, 25/08/2027 (i)		1 754 087	29 164	0,03
Freddie Mac, 3,444 %, 25/12/2027		33 000	32 203	0,04
Freddie Mac, 0,293 %, 25/01/2028 (i)		3 238 259	44 071	0,05
Freddie Mac, 0,304 %, 25/01/2028 (i)		1 396 937	19 577	0,02
Freddie Mac, 0,135 %, 25/02/2028 (i)		4 144 935	29 708	0,03
Freddie Mac, 0,12 %, 25/04/2028 (i)		2 649 930	18 002	0,02
Freddie Mac, 3 %, 15/06/2028–1/08/2045		128 132	120 593	0,14
Freddie Mac, 3,78 %, 25/10/2028		100 000	98 934	0,11
Freddie Mac, 4,06 %, 25/10/2028		79 000	78 857	0,09
Freddie Mac, 5,5 %, 15/02/2036 (i)		7 459	1 206	0,00
Freddie Mac, 4 %, 1/08/2037–1/04/2044		22 831	22 594	0,03
Freddie Mac, 4,5 %, 1/07/2040–1/05/2042		46 807	47 455	0,05
Freddie Mac, 5 %, 1/03/2041–1/12/2044		52 335	54 007	0,06
Freddie Mac, 5,5 %, 1/09/2041		23 410	24 612	0,03
Freddie Mac, UMBS, 2,5 %, 1/10/2037–1/09/2052		788 928	697 050	0,78
Freddie Mac, UMBS, 2 %, 1/02/2042–1/05/2052		392 678	331 125	0,37
Freddie Mac, UMBS, 3,5 %, 1/02/2047–1/09/2052		155 279	146 166	0,17
Freddie Mac, UMBS, 3 %, 1/03/2047–1/05/2052		149 552	137 205	0,16
Ginnie Mae, 5,682 %, 20/08/2034		17 457	18 036	0,02
Ginnie Mae, 4 %, 16/05/2039–20/10/2052		179 980	175 318	0,19
Ginnie Mae, 4,5 %, 20/07/2041–20/11/2052		266 343	266 604	0,32
Ginnie Mae, 4 %, 16/08/2042 (i)		21 764	3 210	0,00
Ginnie Mae, 3,5 %, 20/07/2043–20/10/2052		209 700	201 184	0,23
Ginnie Mae, 3 %, 20/04/2045–20/11/2052		270 238	250 020	0,28
Ginnie Mae, 2,5 %, 20/08/2051–20/07/2052		305 031	272 046	0,30
Ginnie Mae, 2 %, 20/01/2052–20/03/2052		48 712	42 106	0,05
Ginnie Mae, 5 %, 20/09/2052–20/11/2052		99 432	100 147	0,12
Ginnie Mae, 5,5 %, 20/01/2053		50 000	50 839	0,06
Ginnie Mae, 6 %, 21/02/2053		25 000	25 621	0,03
Ginnie Mae, 0,585 %, 16/02/2059 (i)		53 344	1 866	0,00
UMBS, TBA, 5 %, 13/04/2053		75 000	75 182	0,09
			6 155 403	6,98
Obligations municipales				
Golden State, CA, Tobacco Securitization Corp., Tobacco Settlement Rev., Taxable, "B", 2,746 %, 1/06/2034		30 000	25 338	0,03
Golden State, CA, Tobacco Securitization Corp., Tobacco Settlement Rev., Taxable, "B", 3 %, 1/06/2046		25 000	23 249	0,03
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 2,682 %, 1/07/2027		25 000	22 891	0,02
Michigan Finance Authority Tobacco Settlement Asset-Backed Rev., Taxable (2006 Recettes vendues de tabac), "A-1", 2,326 %, 1/06/2030		14 933	14 296	0,02
Philadelphia, PA, School District, Taxable, "A", AGM, 5,995 %, 1/09/2030		50 000	53 916	0,06
State of Florida, Taxable, "A", 2,154 %, 1/07/2030		64 000	53 678	0,06
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,497 %, 1/06/2024		20 000	19 079	0,02
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,647 %, 1/06/2025		20 000	18 513	0,02
			230 960	0,26
Gaz naturel - Distribution				
NiSource, Inc., 5,65 %, 1/02/2045		13 000	13 597	0,02

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 5 %, 23/03/2035	USD	51 000	48 034	0,05
Réseaux et télécommunications				
AT&T, Inc., 2,75 %, 1/06/2031		24 000	20 698	0,03
AT&T, Inc., 3,55 %, 15/09/2055		39 000	28 536	0,03
Total Play Telecomunicaciones S.A. de C.V., 6,375 %, 20/09/2028		200 000	169 278	0,19
			218 512	0,25
Services pétroliers				
Nabors Industrials Ltd., 7,25 %, 15/01/2026		51 000	49 598	0,05
Solaris Midstream Holding LLC, 7,625 %, 1/04/2026		50 000	50 000	0,06
			99 598	0,11
Pétrole				
Parkland Corp., 4,625 %, 1/05/2030		120 000	103 152	0,12
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp., 6 %, 15/02/2028		40 000	37 714	0,04
Puma International Financing S.A., 5 %, 24/01/2026		200 000	184 020	0,21
			324 886	0,37
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
American Express Co., 4,989 % jusqu'au 26/05/2032, FLR jusqu'au 26/05/2033		77 000	76 322	0,09
Banco Continental S.A.E.C.A., 2,75 %, 10/12/2025		150 000	134 062	0,15
Banco Industrial S.A., 4,875 % jusqu'au 29/01/2026, FLR jusqu'au 29/01/2031		150 000	140 320	0,16
Mizrahi Tefahot Bank Ltd., 3,077 % jusqu'au 7/04/2026, FLR jusqu'au 7/04/2031		200 000	179 900	0,20
Uzbek Industrial and Construction Bank, 5,75 %, 2/12/2024		200 000	193 000	0,22
			723 604	0,82
Ordinateurs personnels et périphériques				
NCR Corp., 5 %, 1/10/2028		75 000	66 064	0,07
NCR Corp., 5,125 %, 15/04/2029		49 000	42 682	0,05
			108 746	0,12
Produits pharmaceutiques				
1375209 BC Ltd., 9 %, 30/01/2028		13 000	12 952	0,01
1375209 BC Ltd., 9 %, 30/01/2028		27 000	26 899	0,03
AstraZeneca PLC, 1,375 %, 6/08/2030		29 000	23 804	0,03
Bausch Health Co., Inc., 11 %, 30/09/2028		47 000	36 773	0,04
Bausch Health Co., Inc., 14 %, 15/10/2030		9 000	5 618	0,01
Jazz Securities DAC, 4,375 %, 15/01/2029		200 000	182 468	0,21
Merck & Co., Inc., 2,75 %, 10/12/2051		26 000	18 724	0,02
Organon Finance 1 LLC, 4,125 %, 30/04/2028		200 000	180 890	0,21
Pfizer, Inc., 2,55 %, 28/05/2040		27 000	20 777	0,02
			508 905	0,58
Lutte contre la pollution				
GFL Environmental, Inc., 4,25 %, 1/06/2025		15 000	14 466	0,02
GFL Environmental, Inc., 4 %, 1/08/2028		75 000	66 581	0,08
GFL Environmental, Inc., 4,75 %, 15/06/2029		30 000	27 076	0,03
GFL Environmental, Inc., 4,375 %, 15/08/2029		25 000	22 171	0,02
Stericycle, Inc., 3,875 %, 15/01/2029		70 000	62 108	0,07
Waste Connections, Inc., 4,2 %, 15/01/2033		43 000	41 772	0,05
			234 174	0,27
Métaux et minéraux précieux				
IAMGOLD Corp., 5,75 %, 15/10/2028		75 000	59 272	0,07
Taseko Mines Ltd., 7 %, 15/02/2026		55 000	52 113	0,06
			111 385	0,13
Imprimerie et édition				
Cimpress N.V., 7 %, 15/06/2026		150 000	104 144	0,12
Chemins de fer et transport maritime				
Canadian Pacific Railway Co., 3 %, 2/12/2041		11 000	8 731	0,01
Canadian Pacific Railway Co., 3,1 %, 2/12/2051		16 000	11 797	0,01
			20 528	0,02

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Immobilier - Appartements				
American Homes 4 Rent LP, REIT, 2,375 %, 15/07/2031	USD	39 000	31 831	0,04
Immobilier - Santé				
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp., REIT, 5 %, 15/10/2027		85 000	71 853	0,08
Immobilier - Bureaux				
Corporate Office Property LP, REIT, 2 %, 15/01/2029		32 000	25 374	0,03
Corporate Office Property LP, REIT, 2,75 %, 15/04/2031		60 000	46 831	0,05
			72 205	0,08
Immobilier - Autres				
EPR Properties, REIT, 3,6 %, 15/11/2031		25 000	19 327	0,02
Lexington Realty Trust Co., 2,7 %, 15/09/2030		42 000	34 688	0,04
Lexington Realty Trust Co., 2,375 %, 1/10/2031		16 000	12 591	0,02
W.P. Carey, Inc., REIT, 2,45 %, 1/02/2032		13 000	10 610	0,01
XHR LP, REIT, 4,875 %, 1/06/2029		80 000	71 000	0,08
			148 216	0,17
Immobilier - Distribution				
Brixmor Operating Partnership LP, REIT, 2,5 %, 16/08/2031		15 000	12 006	0,01
STORE Capital Corp., REIT, 2,75 %, 18/11/2030		73 000	57 044	0,07
			69 050	0,08
Restaurants				
Fertitta Entertainment LLC, 6,75 %, 15/01/2030		60 000	49 800	0,06
Distribution				
Alimentation Couche-Tard, Inc., 3,8 %, 25/01/2050		50 000	37 403	0,04
Amazon.com, Inc., 3,6 %, 13/04/2032		123 000	117 024	0,13
Asbury Automotive Group, Inc., 4,625 %, 15/11/2029		80 000	70 595	0,08
AutoZone, Inc., 4,75 %, 1/08/2032		75 000	75 000	0,08
Bath & Body Works, Inc., 5,25 %, 1/02/2028		145 000	136 867	0,16
Home Depot, Inc., 3,9 %, 15/06/2047		68 000	60 153	0,07
Victoria's Secret & Co., 4,625 %, 15/07/2029		72 000	59 813	0,07
			556 855	0,63
Produits chimiques spéciaux				
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,23 %, 1/10/2025		13 000	11 690	0,02
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,832 %, 15/10/2027		13 000	11 250	0,01
International Flavors & Fragrances, Inc., 2,3 %, 1/11/2030		26 000	21 550	0,03
International Flavors & Fragrances, Inc., 3,268 %, 15/11/2040		38 000	29 125	0,03
Univar Solutions USA, Inc., 5,125 %, 1/12/2027		39 000	37 710	0,04
			111 325	0,13
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		30 000	24 547	0,03
DICK'S Sporting Goods, 4,1 %, 15/01/2052		79 000	55 610	0,06
Group 1 Automotive, Inc., 4 %, 15/08/2028		78 000	68 598	0,08
Michael Cos., Inc., 5,25 %, 1/05/2028		35 000	29 187	0,03
Michael Cos., Inc., 7,875 %, 1/05/2029		50 000	38 000	0,04
Penske Automotive Group Co., 3,75 %, 15/06/2029		80 000	67 650	0,08
			283 592	0,32
Hypermarchés				
Albertsons Cos. LLC/Safeway, Inc., 4,625 %, 15/01/2027		65 000	61 623	0,07
Albertsons Cos. LLC/Safeway, Inc., 3,5 %, 15/03/2029		60 000	51 750	0,06
			113 373	0,13
Télécommunications mobiles				
Crown Castle, Inc., REIT, 4,45 %, 15/02/2026		27 000	26 676	0,03
Crown Castle, Inc., REIT, 3,7 %, 15/06/2026		129 000	124 457	0,14
Rogers Communications, Inc., 3,8 %, 15/03/2032		45 000	40 505	0,05
Rogers Communications, Inc., 4,5 %, 15/03/2042		52 000	45 236	0,05
Rogers Communications, Inc., 3,7 %, 15/11/2049		66 000	49 043	0,06
SBA Communications Corp., 3,875 %, 15/02/2027		50 000	46 177	0,05

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Télécommunications mobiles, suite				
SBA Communications Corp., 3,125 %, 1/02/2029	USD	130 000	110 134	0,13
Sprint Capital Corp., 6,875 %, 15/11/2028		115 000	123 031	0,14
Sprint Corp., 7,625 %, 1/03/2026		60 000	63 460	0,07
Telefónica Celular del Paraguay S.A., 5,875 %, 15/04/2027		200 000	185 921	0,21
T-Mobile USA, Inc., 3,5 %, 15/04/2025		84 000	81 568	0,09
			896 208	1,02
Tabac				
Philip Morris International, Inc., 5,625 %, 17/11/2029		19 000	19 844	0,02
Vector Group Ltd., 5,75 %, 1/02/2029		40 000	34 880	0,04
			54 724	0,06
Transports				
Hidrovias International Finance S.à r.l., 4,95 %, 8/02/2031		200 000	153 546	0,17
Transports - Services				
ERAC USA Finance LLC, 3,3 %, 1/12/2026		113 000	106 113	0,12
ICTSI Treasury B.V., 3,5 %, 16/11/2031		200 000	169 400	0,19
			275 513	0,31
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 1,125 %, 15/08/2040		215 000	142 656	0,16
Obligations du Trésor américain, 1,375 %, 15/11/2040		271 000	187 530	0,21
Obligations du Trésor américain, 2,375 %, 15/02/2042		283 000	228 942	0,26
Obligations du Trésor américain, 2,5 %, 15/02/2045		430 000	346 906	0,39
Obligations du Trésor américain, 2,5 %, 15/02/2046		113 000	90 793	0,10
Obligations du Trésor américain, 2,875 %, 15/11/2046		20 000	17 218	0,02
Bons du Trésor américain, 0,125 %, 15/07/2023		70 000	68 548	0,08
Bons du Trésor américain, 2,5 %, 15/08/2023		140 000	138 294	0,16
Bons du Trésor américain, 0,375 %, 31/10/2023		264 700	256 201	0,29
Bons du Trésor américain, 0,875 %, 31/01/2024		157 000	151 088	0,17
Bons du Trésor américain, 2,5 %, 15/05/2024		22 000	21 416	0,02
Bons du Trésor américain, 3 %, 30/06/2024		406 000	397 404	0,45
Bons du Trésor américain, 2 %, 15/02/2025		405 000	387 835	0,44
Bons du Trésor américain, 2,625 %, 15/04/2025		207 000	200 547	0,23
Bons du Trésor américain, 2,875 %, 31/07/2025		449 000	437 179	0,50
Bons du Trésor américain, 0,875 %, 30/09/2026		210 000	189 418	0,21
Bons du Trésor américain, 2,25 %, 15/08/2027		560 000	527 559	0,60
Bons du Trésor américain, 4,125 %, 30/09/2027		66 000	67 338	0,08
Bons du Trésor américain, 2,875 %, 30/04/2029		43 000	41 272	0,05
Bons du Trésor américain, 1,625 %, 15/05/2031		94 000	81 784	0,09
Bons du Trésor américain, 2,75 %, 15/08/2032		210 000	197 597	0,22
Bons du Trésor américain, 4,125 %, 15/11/2032		55 000	57 862	0,07
Bons du Trésor américain, 3,25 %, 15/05/2042		46 000	42 679	0,05
			4 278 066	4,85
Services publics - Énergie électrique				
Adani Transmission Ltd., 4,25 %, 21/05/2036		169 000	125 060	0,14
AES Gener S.A., 7,125 %, 26/03/2079		200 000	193 650	0,22
Alabama Power Co., 3,45 %, 1/10/2049		75 000	57 762	0,06
American Electric Power Co., Inc., 2,3 %, 1/03/2030		60 000	50 680	0,06
American Transmission Systems, Inc., 2,65 %, 15/01/2032		42 000	35 753	0,04
Calpine Corp., 4,5 %, 15/02/2028		83 000	76 589	0,09
Calpine Corp., 5,125 %, 15/03/2028		105 000	95 068	0,11
CenterPoint Energy, Inc., 2,65 %, 1/06/2031		36 000	30 799	0,03
Clean Renewable Power (Mauritius) Pte. Ltd., 4,25 %, 25/03/2027		191 000	169 959	0,19
Clearway Energy Operating LLC, 4,75 %, 15/03/2028		45 000	42 444	0,05
Clearway Energy Operating LLC, 3,75 %, 15/02/2031		150 000	126 725	0,14
Duke Energy Carolinas LLC, 2,85 %, 15/03/2032		81 000	70 895	0,08
Duke Energy Corp., 3,3 %, 15/06/2041		122 000	94 844	0,11

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services publics - Énergie électrique, suite				
Evergy, Inc., 2,9 %, 15/09/2029	USD	41 000	36 461	0,04
FirstEnergy Corp., 2,65 %, 1/03/2030		71 000	60 665	0,07
Florida Power & Light Co., 2,85 %, 1/04/2025		62 000	59 779	0,07
Florida Power & Light Co., 2,45 %, 3/02/2032		69 000	59 527	0,07
Florida Power & Light Co., 3,95 %, 1/03/2048		80 000	70 516	0,08
Georgia Power Co., 4,7 %, 15/05/2032		76 000	75 774	0,09
Georgia Power Co., 5,125 %, 15/05/2052		56 000	56 094	0,06
Greenko Dutch B.V. (République de l'Inde), 3,85 %, 29/03/2026		191 000	170 575	0,19
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		103 000	87 168	0,10
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 2,44 %, 15/01/2032		40 000	33 406	0,04
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 3,8 % jusqu'au 15/03/2027, FLR jusqu'au 15/03/2082		50 000	43 680	0,05
NextEra Energy, Inc., 4,25 %, 15/07/2024		9 000	8 790	0,01
NextEra Energy, Inc., 4,25 %, 15/09/2024		12 000	11 190	0,01
NextEra Energy, Inc., 4,5 %, 15/09/2027		55 000	51 767	0,06
Pacific Gas & Electric Co., 2,5 %, 1/02/2031		52 000	41 956	0,05
Southern California Edison Co., 4,5 %, 1/09/2040		15 000	13 576	0,01
Southern California Edison Co., 3,65 %, 1/02/2050		41 000	32 230	0,04
TerraForm Global Operating LLC, 6,125 %, 1/03/2026		60 000	56 850	0,06
TerraForm Power Operating LLC, 5 %, 31/01/2028		125 000	117 415	0,13
TerraForm Power Operating LLC, 4,75 %, 15/01/2030		45 000	40 499	0,05
Virginia Electric & Power Co., 2,875 %, 15/07/2029		84 000	76 197	0,09
Xcel Energy, Inc., 4,6 %, 1/06/2032		35 000	34 654	0,04
			2 408 997	2,73
Services publics - Eau				
Aegea Finance S.à r.l., 6,75 %, 20/05/2029		200 000	198 840	0,23
Total des obligations (coût identifié, 60 002 451 $)			**54 955 507**	**62,28**
ACTIONS ORDINAIRES				
Aérospatiale et défense				
General Dynamics Corp.		1 939	451 903	0,51
Thales S.A.		360	47 563	0,06
			499 466	0,57
Boissons alcoolisées				
Kirin Holdings Co. Ltd.		8 600	132 456	0,15
Industrie de la confection				
Compagnie Financiere Richemont S.A.		578	89 119	0,10
Industrie automobile				
Magna International, Inc.		2 830	183 725	0,21
Mercedes-Benz Group AG		933	69 126	0,08
Stellantis N.V.		5 565	87 204	0,10
			340 055	0,39
Biotechnologies				
Biogen, Inc.		154	44 799	0,05
Gilead Sciences, Inc.		1 895	159 066	0,18
			203 865	0,23
Radio-télévision				
Omnicom Group, Inc.		914	78 595	0,09
Services aux entreprises				
Amdocs Ltd.		1 318	121 164	0,14
Télévision par câble				
Intelsat Emergence S.A.		1 036	23 828	0,03
Produits chimiques				
Nutrien Ltd.		524	43 376	0,05
Logiciels				
Microsoft Corp.		944	233 933	0,26

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels - Systèmes			
Hitachi Ltd.	2 500	131 271	0,15
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	49 000	163 453	0,18
Lenovo Group Ltd.	86 000	69 189	0,08
Samsung Electronics Co. Ltd.	2 543	127 109	0,14
Seagate Technology Holdings PLC	1 375	93 198	0,11
		584 220	0,66
Construction			
American Homes 4 Rent, "A", REIT	10 415	357 130	0,41
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	21 500	81 436	0,09
AvalonBay Communities, Inc., REIT	3 125	554 500	0,63
Essex Property Trust, Inc., REIT	2 139	483 564	0,55
ICA Tenedora, S.A. de C.V. (b)	51 042	46 080	0,05
		1 522 710	1,73
Biens de consommation			
Colgate-Palmolive Co.	3 682	274 419	0,31
Kimberly-Clark Corp.	2 977	387 040	0,44
		661 459	0,75
Électronique			
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	1 814	168 212	0,19
Texas Instruments, Inc.	3 122	553 250	0,63
		721 462	0,82
Énergie - Sociétés indépendantes			
Coterra Energy, Inc.	3 825	95 740	0,11
Valero Energy Corp.	688	96 340	0,11
		192 080	0,22
Énergie - Sociétés intégrées			
China Petroleum & Chemical Corp.	512 000	276 903	0,31
Eni S.p.A.	13 722	211 633	0,24
Exxon Mobil Corp.	1 370	158 934	0,18
LUKOIL PJSC (c)	606	0	0,00
Suncor Energy, Inc.	1 576	54 699	0,06
TotalEnergies SE	3 778	234 717	0,27
		936 886	1,06
Alimentation et boissons			
Archer Daniels Midland Co.	1 843	152 693	0,17
Coca-Cola FEMSA S.A.B. de C.V.	905	68 943	0,08
General Mills, Inc.	5 908	462 951	0,53
J.M. Smucker Co.	1 504	229 811	0,26
		914 398	1,04
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Albertsons Cos., Inc., "A"	4 120	87 344	0,10
BIM Birlesik Magazalar A.S.	16 726	110 985	0,12
Tesco PLC	59 818	181 706	0,21
		380 035	0,43
Produits forestiers et papier			
Rayonier, Inc., REIT	10 451	380 312	0,43
Weyerhaeuser Co., REIT	13 681	471 037	0,53
		851 349	0,96
Assurances			
Equitable Holdings, Inc.	7 875	252 551	0,29
Everest Re Group Ltd.	93	32 521	0,04
Hartford Financial Services Group, Inc.	1 359	105 472	0,12
Manulife Financial Corp.	19 779	391 403	0,44
MetLife, Inc.	2 788	203 580	0,23
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	866	143 050	0,16

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Assurances, suite			
Zurich Insurance Group AG	314	155 297	0,17
		1 283 874	1,45
Loisirs et jouets			
Brunswick Corp.	789	66 536	0,07
Nintendo Co. Ltd.	1 800	77 786	0,09
Polaris, Inc.	531	60 980	0,07
		205 302	0,23
Machines et outils			
GEA Group AG	1 322	59 429	0,07
Timken Co.	498	41 010	0,05
Volvo Group	7 699	152 596	0,17
		253 035	0,29
Grandes banques			
BNP Paribas	5 439	372 817	0,42
DBS Group Holdings Ltd.	18 800	514 656	0,58
Erste Group Bank AG	1 600	60 607	0,07
Regions Financial Corp.	4 310	101 457	0,12
		1 049 537	1,19
Technologies et services médicaux et de santé			
Encompass Health Corp.	7 052	440 398	0,50
McKesson Corp.	712	269 620	0,30
		710 018	0,80
Métaux et exploitation minière			
Fortescue Metals Group Ltd.	1 587	25 175	0,03
Glencore PLC	12 080	81 106	0,09
Rio Tinto PLC	7 465	583 586	0,66
Vale S.A.	11 800	219 691	0,25
		909 558	1,03
Gaz naturel - Gazoducs			
Plains GP Holdings LP	3 012	39 427	0,04
Réseaux et télécommunications			
Equinix, Inc., REIT	1 436	1 059 955	1,20
Services pétroliers			
LTRI Holdings LP (b)	105	35 179	0,04
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
China Construction Bank Corp.	130 000	84 443	0,10
KB Financial Group, Inc.	1 036	47 204	0,05
Sberbank of Russia PJSC (c)	58 864	0	0,00
SLM Corp.	6 646	116 770	0,13
Tisco Financial Group PCL	20 600	63 965	0,07
		312 382	0,35
Produits pharmaceutiques			
Bayer AG	4 782	296 614	0,34
Johnson & Johnson	2 780	454 307	0,51
Merck & Co., Inc.	7 468	802 138	0,91
Organon & Co.	8 875	267 404	0,30
Pfizer, Inc.	3 193	141 003	0,16
Roche Holding AG	1 663	519 743	0,59
Sanofi	1 132	111 238	0,13
		2 592 447	2,94
Chemins de fer et transport maritime			
A.P. Moller-Maersk A/S	15	32 623	0,04
Orient Overseas International Ltd.	1 500	24 950	0,03
		57 573	0,07

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Immobilier			
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT	3 044	489 293	0,55
Brixmor Property Group, Inc., REIT	24 185	569 073	0,65
Douglas Emmett, Inc., REIT	10 332	173 061	0,20
Equity Lifestyle Properties, Inc., REIT	8 665	621 974	0,70
Extra Space Storage, Inc., REIT	4 652	734 225	0,83
Farmland Partners, Inc., REIT	5 236	67 440	0,08
National Retail Properties, Inc., REIT	11 966	566 590	0,64
Phillips Edison & Co., REIT	12 571	421 380	0,48
Prologis, Inc., REIT	9 069	1 172 440	1,33
Simon Property Group, Inc., REIT	8 050	1 034 103	1,17
Sun Communities, Inc., REIT	3 736	586 029	0,66
Urban Edge Properties, REIT	25 918	408 208	0,46
W.P. Carey, Inc., REIT	1 012	86 556	0,10
		6 930 372	7,85
Restaurants			
Cracker Barrel Old Country Store, Inc.	403	44 967	0,05
Darden Restaurants, Inc.	378	55 932	0,06
Sodexo	699	69 253	0,08
Texas Roadhouse, Inc.	628	63 070	0,07
		233 222	0,26
Produits chimiques spéciaux			
Chemours Co.	1 446	52 620	0,06
Télécommunications mobiles			
American Tower Corp., REIT	1 660	370 827	0,42
KDDI Corp.	12 900	403 052	0,46
PT Telekom Indonesia	220 600	56 659	0,06
SBA Communications Corp., REIT	1 221	363 284	0,41
Vodafone Group PLC	69 647	80 237	0,09
		1 274 059	1,44
Services téléphoniques			
AT&T, Inc.	4 221	85 982	0,10
Hellenic Telecommunications Organization S.A.	7 533	118 502	0,13
Orange S.A.	8 739	92 473	0,11
		296 957	0,34
Tabac			
British American Tobacco PLC	6 860	262 355	0,30
Japan Tobacco, Inc.	6 500	132 341	0,15
Philip Morris International, Inc.	839	87 457	0,10
		482 153	0,55
Services publics - Énergie électrique			
American Electric Power Co., Inc.	1 037	97 436	0,11
E.ON SE	14 738	160 136	0,18
Edison International	2 809	193 540	0,22
Iberdrola S.A.	7 851	91 809	0,11
Transmissora Alianca de Energia Eletrica S.A., IEU	5 085	37 124	0,04
Vistra Corp.	1 664	38 372	0,04
		618 417	0,70
Total des actions ordinaires (coût identifié, 25 812 795 $)		**26 926 543**	**30,51**
ACTIONS PRIVILÉGIÉES			
Logiciels - Systèmes			
Samsung Electronics Co. Ltd.	1 226	55 245	0,06
Métaux et exploitation minière			
Gerdau S.A.	27 100	174 784	0,20
Total des actions privilégiées (coût identifié, 215 448 $)		**230 029**	**0,26**

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES				
Équipements médicaux				
Boston Scientific Corp., 5,5 % (coût identifié, 115 632 $)		1 043	119 038	0,13
CERTIFICATS DE VALEUR GARANTIE				
Télévision par câble				
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Series A, 5/12/2025		107	615	0,00
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Series B, 5/12/2025		107	401	0,00
Total des certificats de valeur garantie (coût identifié, 0 $)			**1 016**	**0,00**
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 5 158 000 $)	USD	5 158 000	5 158 000	5,85
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 91 304 326 $)			**87 390 133**	**99,03**

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES				
Markit CDX North America Investment Grade Series 39 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 1 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 0,88 %	USD	3 100 000	4 292	0,00
S&P 500 Index – Juin 2023 @ 3 000 $		10	14 030	0,02
Total des options de vente achetées (primes versées, 138 064 $)			**18 322**	**0,02**
Total des investissements (coût identifié, 91 442 390 $) (k)			**87 408 455**	**99,05**
OPTIONS DE VENTE VENDUES				
Markit CDX North America Investment Grade Series 39 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 1 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 1,1 % (primes reçues, 3 100 $)	USD	(3 100 000)	(1 653)	(0,00)
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			**839 749**	**0,95**
ACTIF NET			**88 246 551**	**100,00**

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

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Angola				
République d'Angola, 8,75 %, 14/04/2032	USD	8 566 000	7 912 157	0,35
République d'Angola, 9,375 %, 8/05/2048		9 384 000	8 352 323	0,37
République d'Angola, 9,125 %, 26/11/2049		29 778 000	26 036 395	1,15
			42 300 875	1,87
Argentine				
Province de Santa Fe, 7 %, 23/03/2023		224 000	218 400	0,01
République argentine, 3,875 %, 9/01/2038		54 103 000	19 874 177	0,88
République argentine, 3,5 %, 9/07/2041		59 957 000	20 399 100	0,90
			40 491 677	1,79
Azerbaïdjan				
Southern Gas Corridor CJSC (République d'Azerbaïdjan), 6,875 %, 24/03/2026		14 629 000	15 074 892	0,67
State Oil Company of the Azerbaijan Republic, 6,95 %, 18/03/2030		11 463 000	11 994 035	0,53
			27 068 927	1,20
Bénin				
République du Bénin, 4,875 %, 19/01/2032	EUR	5 565 000	4 749 243	0,21
République du Bénin, 6,875 %, 19/01/2052		2 624 000	2 066 198	0,09
			6 815 441	0,30

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Bermudes				
Gouvernement des Bermudes, 2,375 %, 20/08/2030	USD	7 729 000	6 608 295	0,29
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		5 114 000	5 134 624	0,23
Gouvernement des Bermudes, 3,375 %, 20/08/2050		5 390 000	3 884 698	0,17
			15 627 617	0,69
Brésil				
Acu Petroleo Luxembourg S.à r.l., 7,5 %, 13/01/2032		8 355 013	7 864 072	0,35
Aegea Finance S.à r.l., 6,75 %, 20/05/2029		5 458 000	5 426 344	0,24
Ero Cooper Corp., 6,5 %, 15/02/2030		2 783 000	2 370 177	0,10
Ero Copper Corp., 6,5 %, 15/02/2030		1 635 000	1 392 468	0,06
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2025	BRL	13 820 000	2 600 030	0,12
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2027		14 092 000	2 550 311	0,11
Hidrovias International Finance S.à r.l., 4,95 %, 8/02/2031	USD	6 249 000	4 797 545	0,21
MC Brazil Downstream, 7,25 %, 30/06/2031		3 648 293	3 182 356	0,14
MV24 Capital B.V., 6,748 %, 1/06/2034		5 657 182	5 396 952	0,24
TerraForm Global Operating LLC, 6,125 %, 1/03/2026		4 950 000	4 690 125	0,21
			40 270 380	1,78
Bulgarie				
Bulgarian Energy Holdings, 2,45 %, 22/07/2028	EUR	7 471 000	6 620 811	0,29
ContourGlobal Power Holdings S.A., 3,125 %, 1/01/2028		2 642 000	2 396 974	0,11
			9 017 785	0,40
Cameroun				
République du Cameroun, 5,95 %, 7/07/2032		5 161 000	4 273 666	0,19
Chili				
AES Gener S.A., 6,35 % jusqu'au 7/04/25, FLR jusqu'au 7/10/2079	USD	5 823 000	5 502 735	0,24
Agrosuper S.A., 4,6 %, 20/01/2032		4 586 000	4 104 470	0,18
Alfa Desarrollo S.p.A., 4,55 %, 27/09/2051		4 027 266	3 229 666	0,14
Antofagasta PLC, 5,625 %, 13/05/2032		4 307 000	4 319 928	0,19
Banco del Estado de Chile, 2,704 %, 9/01/2025		7 387 000	7 057 884	0,31
Chile Electricity PEC S.p.A., 0 %, 25/01/2028		3 019 000	2 254 542	0,10
Compania Cervecerias Unidas S.A., 3,35 %, 19/01/2032		7 584 000	6 560 160	0,29
E.CL S.A., 4,5 %, 29/01/2025		4 689 000	4 571 775	0,20
Empresa Nacional del Petroleo (République du Chili), 3,75 %, 5/08/2026		2 523 000	2 378 763	0,11
Empresa Nacional del Petroleo (République du Chili), 5,25 %, 6/11/2029		2 062 000	2 010 450	0,09
Empresa Nacional del Petroleo (République du Chili), 3,45 %, 16/09/2031		5 825 000	4 966 275	0,22
Empresa Nacional del Petroleo (République du Chili), 4,5 %, 14/09/2047		4 824 000	3 789 300	0,17
ENGIE Energía Chile S.A., 3,4 %, 28/01/2030		7 171 000	6 005 713	0,27
Mercury Chile Holdco LLC, 6,5 %, 24/01/2027		5 130 000	4 928 648	0,22
République du Chili, 2,55 %, 27/07/2033		5 775 000	4 703 157	0,21
République du Chili, 3,5 %, 31/01/2034		4 811 000	4 253 578	0,19
République du Chili, 4 %, 31/01/2052		6 509 000	5 280 732	0,23
République du Chili, 3,25 %, 21/09/2071		3 773 000	2 461 318	0,11
Transelec S.A., 4,625 %, 26/07/2023		3 149 000	3 132 814	0,14
Transelec S.A., 3,875 %, 12/01/2029		1 492 000	1 372 640	0,06
VTR Comunicaciones S.p.A., 5,125 %, 15/01/2028		2 403 000	1 683 938	0,07
VTR Finance N.V., 6,375 %, 15/07/2028		3 980 000	1 640 556	0,07
			86 209 042	3,81
Chine				
AIA Group Ltd., 5,625 %, 25/10/2027		4 443 000	4 626 365	0,20
CCBL (Cayman) 1 Corp. Ltd., 3,5 %, 16/05/2024		4 641 000	4 545 043	0,20
China Southern Power Grid Co. Ltd., 3,5 %, 8/05/2027		4 400 000	4 266 238	0,19
China Southern Power Grid Co. Ltd., 4,25 %, 18/09/2028		1 990 000	1 980 408	0,09
Country Garden Holdings Co. Ltd., 2,7 %, 12/07/2026		814 000	528 418	0,02
Country Garden Holdings Co. Ltd., 4,8 %, 6/08/2030		315 000	190 362	0,01
Country Garden Holdings Co. Ltd., 3,875 %, 22/10/2030		1 156 000	671 310	0,03
Country Garden Holdings Co. Ltd., 3,3 %, 12/01/2031		935 000	542 044	0,02

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Chine, suite				
ENN Clean Energy Co., 3,375 %, 12/05/2026	USD	3 687 000	3 358 093	0,15
Huarong Finance 2017 Co. Ltd. (République populaire de Chine), 4,75 %, 27/04/2027		3 470 000	3 131 675	0,14
Huarong Finance 2019 Co. Ltd. (République populaire de Chine), 3,25 %, 13/11/2024		3 669 000	3 443 624	0,15
ICBCIL Finance Co. Ltd. (République populaire de Chine), 2,65 %, 2/08/2031		5 252 000	4 381 706	0,19
Meituan, 2,125 %, 28/10/2025		3 539 000	3 216 806	0,14
Meituan, 3,05 %, 28/10/2030		6 307 000	5 132 585	0,23
Prosus N.V., 3,061 %, 13/07/2031		4 456 000	3 566 681	0,16
Prosus N.V., 4,193 %, 19/01/2032		2 537 000	2 180 846	0,10
Prosus N.V., 4,027 %, 3/08/2050		4 241 000	2 866 687	0,13
State Grid Overseas Investment (2016) Ltd. (République populaire de Chine), 3,5 %, 4/05/2027		9 214 000	8 941 960	0,40
Sunac China Holdings Ltd., 7,95 %, 11/10/2023 (d)		897 000	256 362	0,01
Sunac China Holdings Ltd., 7,5 %, 1/02/2024		4 841 000	1 373 638	0,06
Sunac China Holdings Ltd., 6,5 %, 10/01/2025		2 662 000	755 204	0,03
Times China Holdings Ltd., 6,75 %, 8/07/2025		2 950 000	573 913	0,03
Times China Holdings Ltd., 6,2 %, 22/03/2026		2 950 000	565 311	0,02
Weibo Corp., 3,375 %, 8/07/2030		3 328 000	2 780 292	0,12
			63 875 571	2,82
Colombie				
Banco GNB Sudameris S.A., 7,5 % jusqu'au 16/04/2026, FLR jusqu'au 16/04/2031		2 762 000	2 159 418	0,10
Empresas Publicas de Medellin E.S.P., 4,375 %, 15/02/2031		1 507 000	1 193 359	0,05
EnfraGen Energia Sur S.A., 5,375 %, 30/12/2030		6 012 000	4 292 432	0,19
République de Colombie, 3,125 %, 15/04/2031		4 050 000	3 059 898	0,14
République de Colombie, 8 %, 20/04/2033		6 027 000	6 172 206	0,27
République de Colombie, 5,2 %, 15/05/2049		6 483 000	4 561 052	0,20
Sierracol Energy Andina LLC, 6 %, 15/06/2028		4 643 000	3 830 379	0,17
TermoCandelaria Power Ltd., 7,875 %, 30/01/2029		6 228 950	5 870 785	0,26
			31 139 529	1,38
Costa Rica				
Liberty Costa Rica Senior Secured Finance, 10,875 %, 15/01/2031		2 976 000	2 906 064	0,13
République du Costa Rica, 7 %, 4/04/2044		5 358 000	5 197 260	0,23
République du Costa Rica, 7,158 %, 12/03/2045		4 759 000	4 669 769	0,20
			12 773 093	0,56
Côte d'Ivoire				
République de Côte d'Ivoire, 5,25 %, 22/03/2030	EUR	5 052 000	4 634 389	0,21
République de Côte d'Ivoire, 4,875 %, 30/01/2032		9 610 000	8 177 270	0,36
République de Côte d'Ivoire, 6,875 %, 17/10/2040		371 000	307 867	0,01
République de Côte d'Ivoire, 6,875 %, 17/10/2040		10 168 000	8 437 717	0,37
République de Côte d'Ivoire, 6,625 %, 22/03/2048		2 750 000	2 155 218	0,10
			23 712 461	1,05
République tchèque				
CEZ A.S. (République tchèque), 2,375 %, 6/04/2027		4 041 000	4 106 740	0,18
PPF Telecom Group B.V., 3,25 %, 29/09/2027		5 105 000	5 077 894	0,23
			9 184 634	0,41
République dominicaine				
Banco de Reservas de la Republica Dominicana, 7 %, 1/02/2023	USD	7 528 000	7 528 000	0,33
République dominicaine, 5,5 %, 22/02/2029		6 225 000	5 855 658	0,26
République dominicaine, 4,5 %, 30/01/2030		2 694 000	2 336 674	0,10
République dominicaine, 7,05 %, 3/02/2031		4 182 000	4 182 000	0,19
République dominicaine, 4,875 %, 23/09/2032		18 515 000	15 761 587	0,70
République dominicaine, 6 %, 22/02/2033		8 101 000	7 471 487	0,33
République dominicaine, 5,3 %, 21/01/2041		6 144 000	4 917 292	0,22
République dominicaine, 6,5 %, 15/02/2048		2 739 000	2 362 148	0,10
République dominicaine, 6,4 %, 5/06/2049		1 888 000	1 605 395	0,07
République dominicaine, 5,875 %, 30/01/2060		23 020 000	17 682 172	0,78

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
République dominicaine, suite				
Empresa Generadora de Electricidad Haina S.A., 5,625 %, 8/11/2028	USD	6 164 000	5 566 523	0,25
			75 268 936	3,33
Équateur				
République d'Équateur, 2,5 %, 31/07/2035		30 124 771	14 659 496	0,65
République d'Équateur, 1,5 %, 31/07/2040		28 979 546	12 162 981	0,54
			26 822 477	1,19
Égypte				
République arabe d'Égypte, 5,8 %, 30/09/2027		795 000	658 022	0,03
République arabe d'Égypte, 6,588 %, 21/02/2028		3 567 000	2 942 918	0,13
République arabe d'Égypte, 7,6 %, 1/03/2029		2 921 000	2 410 035	0,11
République arabe d'Égypte, 6,375 %, 11/04/2031	EUR	4 997 000	3 807 871	0,17
République arabe d'Égypte, 7,052 %, 15/01/2032	USD	3 588 000	2 689 565	0,12
République arabe d'Égypte, 7,625 %, 29/05/2032		1 641 000	1 248 447	0,05
République arabe d'Égypte, 8,5 %, 31/01/2047		15 707 000	11 056 063	0,49
République arabe d'Égypte, 7,903 %, 21/02/2048		5 300 000	3 517 928	0,16
République arabe d'Égypte, 8,7 %, 1/03/2049		7 354 000	5 191 144	0,23
République arabe d'Égypte, 8,875 %, 29/05/2050		7 407 000	5 281 161	0,23
République arabe d'Égypte, 7,5 %, 16/02/2061		7 292 000	4 722 883	0,21
Energean PLC, 6,5 %, 30/04/2027		6 394 000	5 983 505	0,26
			49 509 542	2,19
Salvador				
République du Salvador, 7,65 %, 15/06/2035		1 687 000	812 203	0,03
République du Salvador, 7,124 %, 20/01/2050		1 773 000	820 576	0,04
			1 632 779	0,07
Gabon				
République du Gabon, 6,625 %, 6/02/2031		1 423 000	1 194 181	0,05
République du Gabon, 7 %, 24/11/2031		14 795 000	12 449 460	0,55
			13 643 641	0,60
Ghana				
Kosmos Energy Ltd., 7,75 %, 1/05/2027		2 013 000	1 791 369	0,08
Kosmos Energy Ltd., 7,5 %, 1/03/2028		2 877 000	2 457 318	0,11
République du Ghana, 7,75 %, 7/04/2029		1 129 000	417 730	0,02
République du Ghana, 8,625 %, 7/04/2034		4 910 000	1 804 425	0,08
République du Ghana, 7,875 %, 11/02/2035		12 186 000	4 471 043	0,20
République du Ghana, 8,75 %, 11/03/2061		1 388 000	500 152	0,02
			11 442 037	0,51
Guatemala				
Banco Industrial S.A., 4,875 % jusqu'au 29/01/2026, FLR jusqu'au 29/01/2031		3 836 000	3 588 447	0,16
Central American Bottling Corp., 5,25 %, 27/04/2029		8 755 000	8 407 339	0,37
CT Trust, 5,125 %, 3/02/2032		5 478 000	4 775 692	0,21
Energuate Trust, 5,875 %, 3/05/2027		7 939 000	7 621 440	0,34
Investment Energy Resources Ltd., 6,25 %, 26/04/2029		6 688 000	6 384 135	0,28
Millicom International Cellular S.A., 4,5 %, 27/04/2031		3 930 000	3 326 745	0,15
République du Guatemala, 4,875 %, 13/02/2028		1 305 000	1 265 916	0,05
République du Guatemala, 5,25 %, 10/08/2029		1 819 000	1 771 687	0,08
République du Guatemala, 4,9 %, 1/06/2030		3 509 000	3 346 355	0,15
République du Guatemala, 3,7 %, 7/10/2033		6 881 000	5 800 452	0,25
République du Guatemala, 4,65 %, 7/10/2041		5 988 000	4 978 492	0,22
République du Guatemala, 6,125 %, 1/06/2050		11 826 000	11 474 522	0,51
			62 741 222	2,77
Hongrie				
MVM Energetika Zartkoruen Mukodo Reszvenytarsasag, 0,875 %, 18/11/2027	EUR	5 422 000	4 448 365	0,20
République de Hongrie, 6,125 %, 22/05/2028	USD	5 939 000	6 140 427	0,27
République de Hongrie, 5,25 %, 16/06/2029		4 231 000	4 163 304	0,18
République de Hongrie, 6,25 %, 22/09/2032		7 633 000	7 891 072	0,35

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Hongrie, suite				
République de Hongrie, 5,5 %, 16/06/2034	USD	10 769 000	10 571 970	0,47
République de Hongrie, 6,75 %, 25/09/2052		1 919 000	2 024 545	0,09
			35 239 683	1,56
Inde				
Adani Green Energy (UP) Ltd./Prayatna Developers Private Ltd., 6,25 %, 10/12/2024		6 240 000	5 826 359	0,26
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd., 5 %, 2/08/2041		2 963 000	2 088 915	0,09
Adani Transmission Ltd., 4,25 %, 21/05/2036		6 206 525	4 592 828	0,20
Azure Power Energy Ltd., 3,575 %, 19/08/2026		6 658 658	5 025 289	0,22
Clean Renewable Power (Mauritius) Pte. Ltd., 4,25 %, 25/03/2027		5 423 445	4 825 996	0,21
Cliffton Ltd., 6,25 %, 25/10/2025		5 987 000	5 687 650	0,25
Delhi International Airport Ltd., 6,45 %, 4/06/2029		1 465 000	1 378 199	0,06
Export-Import Bank of India, 3,25 %, 15/01/2030		2 463 000	2 179 706	0,10
Export-Import Bank of India, 2,25 %, 13/01/2031		12 373 000	10 003 570	0,44
Export-Import Bank of India, 5,5 %, 18/01/2033		11 670 000	11 785 335	0,52
GMR Hyderabad International Airport Ltd., 4,25 %, 27/10/2027		688 000	603 720	0,03
Greenko Dutch B.V. (République de l'Inde), 3,85 %, 29/03/2026		4 380 585	3 912 125	0,17
Greenko Power II Ltd. (République de l'Inde), 4,3 %, 13/12/2028		2 339 750	2 013 824	0,09
Greenko Wind Projects (Mauritius) Ltd., 5,5 %, 6/04/2025		5 780 000	5 449 056	0,24
Indian Railway Finance Corp., 3,249 %, 13/02/2030		1 720 000	1 503 590	0,07
Indian Railway Finance Corp., 2,8 %, 10/02/2031		13 368 000	11 109 610	0,49
JSW Infrastructure Ltd., 4,95 %, 21/01/2029		7 180 000	6 360 461	0,28
JSW Steel Ltd., 5,05 %, 5/04/2032		3 973 000	3 340 691	0,15
Muthoot Finance Ltd., 4,4 %, 2/09/2023		6 470 000	6 340 600	0,28
Power Finance Corp. Ltd. (République de l'Inde), 3,95 %, 23/04/2030		3 724 000	3 274 774	0,14
ReNew Power, 4,5 %, 14/07/2028		4 922 000	4 234 597	0,19
Shriram Transport Finance Co. Ltd., 4,4 %, 13/03/2024		6 025 000	5 806 594	0,26
UPL Ltd., 4,625 %, 16/06/2030		1 005 000	831 650	0,04
			108 175 139	4,78
Indonésie				
Bank Negara Indonesia, 3,75 %, 30/03/2026		3 659 000	3 422 995	0,15
Listrindo Capital B.V., 4,95 %, 14/09/2026		6 383 000	6 034 317	0,27
Medco Bell Pte. Ltd., 6,375 %, 30/01/2027		4 086 000	3 922 182	0,17
Medco Laurel Tree Pte. Ltd., 6,95 %, 12/11/2028		6 074 000	5 785 906	0,26
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 2,8 %, 23/06/2030		2 524 000	2 250 600	0,10
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4,7 %, 6/06/2032		2 617 000	2 620 926	0,12
PT Freeport Indonesia, 5,315 %, 14/04/2032		6 005 000	5 705 476	0,25
PT Freeport Indonesia, 6,2 %, 14/04/2052		6 014 000	5 562 950	0,25
PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, 3,398 %, 9/06/2031		7 180 000	6 183 768	0,27
PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, 4,805 %, 27/04/2052		7 055 000	5 433 581	0,24
PT Pertamina (Persero) (République d'Indonésie), 5,625 %, 20/05/2043		2 221 000	2 132 600	0,09
PT Pertamina (Persero) (République d'Indonésie), 6,5 %, 7/11/2048		1 482 000	1 534 199	0,07
PT Pertamina (Persero) (République d'Indonésie), 4,15 %, 25/02/2060		1 217 000	903 860	0,04
PT Perusahaan Listrik Negara (République d'Indonésie), 6,15 %, 21/05/2048		1 026 000	996 322	0,04
PT Perusahaan Listrik Negara (République d'Indonésie), 4,875 %, 17/07/2049		2 920 000	2 385 577	0,11
République d'Indonésie, 4,125 %, 15/01/2025		2 775 000	2 749 987	0,12
République d'Indonésie, 3,4 %, 18/09/2029		2 516 000	2 344 912	0,10
République d'Indonésie, 3,55 %, 31/03/2032		4 090 000	3 752 748	0,17
République d'Indonésie, 4,65 %, 20/09/2032		6 292 000	6 261 806	0,28
République d'Indonésie, 4,85 %, 11/01/2033		7 029 000	7 093 324	0,31
République d'Indonésie, 1,1 %, 12/03/2033	EUR	4 347 000	3 515 365	0,16
République d'Indonésie, 4,625 %, 15/04/2043	USD	6 186 000	5 800 668	0,26
République d'Indonésie, 5,125 %, 15/01/2045		2 154 000	2 138 750	0,09
République d'Indonésie, 4,35 %, 11/01/2048		12 472 000	11 115 290	0,49
République d'Indonésie, 5,45 %, 20/09/2052		7 267 000	7 458 413	0,33

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Indonésie, suite				
République d'Indonésie, 5,65 %, 11/01/2053	USD	2 580 000	2 708 051	0,12
Saka Energi Indonesia PT, 4,45 %, 5/05/2024		581 000	562 844	0,02
Star Energy Geothermal (Salak-Darajat) B.V., 4,85 %, 14/10/2038		1 210 000	1 051 512	0,05
Star Energy Geothermal (Wayang Windu) Ltd., 6,75 %, 24/04/2033		5 836 138	5 668 311	0,25
			117 097 240	5,18
Israël				
Energean Israel Finance Ltd., 4,875 %, 30/03/2026		5 113 000	4 774 264	0,21
Leviathan Bond Ltd., 6,125 %, 30/06/2025		4 148 000	4 116 890	0,18
Leviathan Bond Ltd., 6,75 %, 30/06/2030		7 667 000	7 445 761	0,33
			16 336 915	0,72
Jamaïque				
Gouvernement de Jamaïque, 7,875 %, 28/07/2045		3 215 000	3 758 742	0,17
Jordanie				
Royaume hachémite de Jordanie, 7,75 %, 15/01/2028		4 499 000	4 646 117	0,21
Royaume hachémite de Jordanie, 5,85 %, 7/07/2030		10 894 000	10 027 557	0,44
Royaume hachémite de Jordanie, 7,375 %, 10/10/2047		15 936 000	14 310 974	0,63
			28 984 648	1,28
Kazakhstan				
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 5,375 %, 24/04/2030		5 305 000	4 892 822	0,22
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 3,5 %, 14/04/2033		5 242 000	3 971 067	0,18
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 5,75 %, 19/04/2047		3 793 000	3 014 274	0,13
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 6,375 %, 24/10/2048		10 462 000	8 945 010	0,39
KazTransGas JSC (République du Kazakhstan), 4,375 %, 26/09/2027		1 947 000	1 781 505	0,08
République du Kazakhstan, 6,5 %, 21/07/2045		7 522 000	7 971 304	0,35
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 4 %, 15/08/2026		12 000 000	10 705 920	0,47
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 3,25 %, 15/08/2030		6 719 000	5 115 309	0,23
			46 397 211	2,05
Kenya				
République du Kenya, 7 %, 22/05/2027		3 711 000	3 344 019	0,15
République du Kenya, 8 %, 22/05/2032		11 126 000	9 666 492	0,42
République du Kenya, 8,25 %, 28/02/2048		3 479 000	2 725 170	0,12
			15 735 681	0,69
Koweït				
EQUATE Petrochemical B.V. (État du Koweït), 4,25 %, 3/11/2026		784 000	762 675	0,03
EQUATE Petrochemical B.V. (État du Koweït), 2,625 %, 28/04/2028		1 204 000	1 071 560	0,05
MEGlobal Canada ULC, 5,875 %, 18/05/2030		1 044 000	1 078 452	0,05
NBK SPC Ltd. (État du Koweït), 1,625 % jusqu'au 15/09/2026, FLR jusqu'au 15/09/2027		6 679 000	5 961 008	0,26
			8 873 695	0,39
Malaisie				
Dua Capital Ltd. (Fédération de Malaisie), 2,78 %, 11/05/2031		12 340 000	10 064 627	0,44
GENM Capital Labuan Ltd., 3,882 %, 19/04/2031		4 361 000	3 539 102	0,16
PETRONAS Capital Ltd. (Fédération de Malaisie), 3,404 %, 28/04/2061		4 240 000	3 093 629	0,14
			16 697 358	0,74
Mexique				
Banco Mercantil del Norte S.A., 6,625 % jusqu'au 24/01/2032, FLR jusqu'au 24/01/2171		2 768 000	2 443 610	0,11
Banco Mercantil del Norte S.A., 7,625 % jusqu'au 10/01/2028, FLR jusqu'au 6/10/2171		2 460 000	2 432 399	0,11
Becle S.A.B. de C.V., 2,5 %, 14/10/2031		6 869 000	5 493 858	0,24
Braskem Idesa S.A.P.I., 6,99 %, 20/02/2032		4 156 000	3 077 934	0,14
CEMEX S.A.B. de C.V., 7,375 %, 5/06/2027		1 413 000	1 452 564	0,06
Comision Federal de Electricidad (États-Unis du Mexique), 4,688 %, 15/05/2029		4 870 000	4 486 487	0,20
Comision Federal de Electricidad (États-Unis du Mexique), 3,875 %, 26/07/2033		5 676 000	4 484 816	0,20
Electricidad Firme de Mexico Holdings S.A. de C.V., 4,9 %, 20/11/2026		5 193 000	4 668 283	0,21
GCC S.A.B. de C.V., 3,614 %, 20/04/2032		5 299 000	4 505 488	0,20
Grupo Axo S.A.P.I. de C.V., 5,75 %, 8/06/2026		6 237 000	5 510 900	0,24
Grupo Bimbo S.A.B. de C.V., 5,95 % jusqu'au 17/07/2023, FLR jusqu'au 17/07/2171		3 583 000	3 580 134	0,16

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Mexique, suite				
Grupo KUO S.A.B. de C.V., 5,75 %, 7/07/2027	USD	5 982 000	5 671 893	0,25
Infraestructura Energética Nova S.A.B. de C.V., 4,875 %, 14/01/2048		7 896 000	6 238 879	0,28
Petroleos Mexicanos, 6,49 %, 23/01/2027		3 863 000	3 627 396	0,16
Petroleos Mexicanos, 8,75 %, 2/06/2029		4 469 000	4 352 231	0,19
Petroleos Mexicanos, 6,84 %, 23/01/2030		8 075 000	7 025 428	0,31
Petroleos Mexicanos, 5,95 %, 28/01/2031		16 256 000	13 013 636	0,58
Petroleos Mexicanos, 6,7 %, 16/02/2032		9 954 000	8 262 471	0,36
Petroleos Mexicanos, 10 %, 7/02/2033		17 223 000	16 826 871	0,74
Petroleos Mexicanos, 6,75 %, 21/09/2047		15 093 000	10 471 679	0,46
Petroleos Mexicanos, 7,69 %, 23/01/2050		24 739 000	18 470 167	0,82
Petroleos Mexicanos, 6,95 %, 28/01/2060		15 400 000	10 624 226	0,47
Total Play Telecomunicaciones S.A. de C.V., 6,375 %, 20/09/2028		6 491 000	5 493 917	0,24
États-Unis du Mexique, 5,75 %, 5/03/2026	MXN	55 600 000	2 674 014	0,12
États-Unis du Mexique, 5,4 %, 9/02/2028	USD	3 958 000	4 063 776	0,18
États-Unis du Mexique, 8,5 %, 31/05/2029	MXN	41 300 000	2 173 555	0,10
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 29/05/2031		93 400 000	4 689 022	0,21
États-Unis du Mexique, 4,875 %, 19/05/2033	USD	3 364 000	3 229 529	0,14
États-Unis du Mexique, 1,45 %, 25/10/2033	EUR	2 913 000	2 313 144	0,10
États-Unis du Mexique, 3,5 %, 12/02/2034	USD	5 814 000	4 885 862	0,22
États-Unis du Mexique, 6,35 %, 9/02/2035		4 763 000	5 056 145	0,22
États-Unis du Mexique, 4,5 %, 31/01/2050		9 305 000	7 510 040	0,33
			188 810 354	8,35
Maroc				
Royaume du Maroc, 3 %, 15/12/2032		7 715 000	6 162 357	0,27
Office Cherifien des Phosphates S.A. (Royaume du Maroc), 6,875 %, 25/04/2044		4 555 000	4 412 656	0,20
Office Cherifien des Phosphates S.A. (Royaume du Maroc), 5,125 %, 23/06/2051		10 947 000	8 600 182	0,38
			19 175 195	0,85
Nigeria				
République fédérale du Nigeria, 6,125 %, 28/09/2028		4 176 000	3 238 572	0,14
République fédérale du Nigeria, 7,875 %, 16/02/2032		7 506 000	5 648 265	0,25
République fédérale du Nigeria, 7,375 %, 28/09/2033		7 182 000	5 117 175	0,23
République fédérale du Nigeria, 7,696 %, 23/02/2038		10 285 000	7 122 362	0,31
			21 126 374	0,93
Oman				
Oryx Funding Ltd. (Sultanat d'Oman), 5,8 %, 3/02/2031		7 220 000	7 097 520	0,31
Sultanat d'Oman, 6,25 %, 25/01/2031		5 145 000	5 324 663	0,24
Sultanat d'Oman, 6,5 %, 8/03/2047		9 702 000	9 265 410	0,41
Sultanat d'Oman, 6,75 %, 17/01/2048		29 279 000	28 847 720	1,27
Sultanat d'Oman, 7 %, 25/01/2051		27 922 000	28 254 272	1,25
			78 789 585	3,48
Pakistan				
République islamique du Pakistan, 6 %, 8/04/2026		4 151 000	1 784 930	0,08
République islamique du Pakistan, 6,875 %, 5/12/2027		2 400 000	1 008 000	0,05
République islamique du Pakistan, 7,375 %, 8/04/2031		7 182 000	2 986 275	0,13
République islamique du Pakistan, 8,875 %, 8/04/2051		2 953 000	1 201 576	0,05
			6 980 781	0,31
Panama				
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A. (République du Panama), 5,125 %, 11/08/2061		2 410 000	1 958 125	0,09
AES Panama Generation Holdings S.R.L., 4,375 %, 31/05/2030		4 786 000	4 245 423	0,19
Autoridad del Canal de Panama, 4,95 %, 29/07/2035		4 995 000	4 849 932	0,21
Banco General S.A., 5,25 % jusqu'au 4/05/2031, FLR jusqu'au 7/05/2071		1 934 000	1 663 913	0,07
Cable Onda S.A., 4,5 %, 30/01/2030		1 897 000	1 693 072	0,07
Empresa de Transmision Electrica S.A. (République du Panama), 5,125 %, 2/05/2049		4 305 000	3 615 500	0,16
Panama Canal Railway Co., 7 %, 1/11/2026		1 507 632	1 537 785	0,07
République du Panama, 3,362 %, 30/06/2031		5 635 000	4 708 831	0,21

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Panama, suite				
République du Panama, 3,298 %, 19/01/2033	USD	945 000	788 315	0,04
République du Panama, 6,4 %, 14/02/2035		5 341 000	5 631 492	0,25
République du Panama, 4,5 %, 19/01/2063		9 079 000	6 764 905	0,30
			37 457 293	1,66
Paraguay				
Banco Continental S.A.E.C.A., 2,75 %, 10/12/2025		2 070 000	1 850 062	0,08
République du Paraguay, 3,849 %, 28/06/2033		1 962 000	1 720 432	0,08
République du Paraguay, 6,1 %, 11/08/2044		2 183 000	2 160 200	0,09
République du Paraguay, 5,6 %, 13/03/2048		16 284 000	14 726 938	0,65
République du Paraguay, 5,4 %, 30/03/2050		17 426 000	15 528 939	0,69
Telefónica Celular del Paraguay S.A., 5,875 %, 15/04/2027		3 892 000	3 618 027	0,16
			39 604 598	1,75
Pérou				
Consorcio Transmantaro S.A. (République du Pérou), 5,2 %, 11/04/2038		1 716 000	1 594 095	0,07
Gas Natural de Lima y Callao S.A., 4,375 %, 1/04/2023		3 881 000	3 868 309	0,17
IIRSA Norte Finance Ltd. (République du Pérou), 8,75 %, 30/05/2024		191 250	197 465	0,01
Peru LNG, 5,375 %, 22/03/2030		5 466 000	4 532 626	0,20
République du Pérou, 2,844 %, 20/06/2030		2 408 000	2 075 549	0,09
République du Pérou, 2,783 %, 23/01/2031		3 982 000	3 370 492	0,15
République du Pérou, 1,862 %, 1/12/2032		2 719 000	2 031 332	0,09
San Miguel Industrias PET S.A., 3,5 %, 2/08/2028		6 930 000	5 962 364	0,26
			23 632 232	1,04
Philippines				
ICTSI Treasury B.V., 3,5 %, 16/11/2031		6 184 000	5 237 846	0,23
République des Philippines, 3,556 %, 29/09/2032		2 904 000	2 681 234	0,12
République des Philippines, 5,609 %, 13/04/2033		3 359 000	3 573 096	0,16
République des Philippines, 1,2 %, 28/04/2033	EUR	2 845 000	2 387 999	0,10
République des Philippines, 5 %, 17/07/2033	USD	6 614 000	6 720 412	0,30
République des Philippines, 1,75 %, 28/04/2041	EUR	2 421 000	1 766 592	0,08
République des Philippines, 5,5 %, 17/01/2048	USD	4 527 000	4 715 982	0,21
			27 083 161	1,20
Pologne				
Can-Pack S.A./Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,125 %, 1/11/2025		3 819 000	3 477 199	0,15
Can-Pack S.A./Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,875 %, 15/11/2029		4 794 000	3 980 890	0,18
République de Pologne, 5,75 %, 16/11/2032		5 480 000	5 920 044	0,26
Synthos S.A., 2,5 %, 7/06/2028	EUR	5 145 000	4 413 743	0,20
			17 791 876	0,79
Qatar				
ABQ Finance Ltd., 2 %, 6/07/2026	USD	2 365 000	2 131 944	0,09
CBQ Finance Ltd. Co., 2 %, 12/05/2026		4 807 000	4 379 652	0,19
Ooredoo International Finance Ltd. (État du Qatar), 2,625 %, 8/04/2031		6 130 000	5 373 803	0,24
Qatar Petroleum, 2,25 %, 12/07/2031		2 273 000	1 930 664	0,09
Qatar Petroleum, 3,125 %, 12/07/2041		3 593 000	2 843 464	0,13
Qatar Petroleum, 3,3 %, 12/07/2051		4 675 000	3 563 285	0,16
QNB Finance Ltd. (État du Qatar), 2,75 %, 12/02/2027		4 876 000	4 548 820	0,20
État du Qatar, 4,625 %, 2/06/2046		1 250 000	1 222 140	0,05
État du Qatar, 5,103 %, 23/04/2048		2 937 000	3 028 693	0,13
État du Qatar, 4,817 %, 14/03/2049		11 598 000	11 569 005	0,51
			40 591 470	1,79
République de Moldova				
Aragvi Finance International DAC, 8,45 %, 29/04/2026		5 729 000	4 280 250	0,19
Roumanie				
République de Roumanie, 5,45 %, 25/11/2027		6 104 000	5 999 011	0,26
République de Roumanie, 6,625 %, 17/02/2028		5 588 000	5 786 374	0,26
République de Roumanie, 1,75 %, 13/07/2030	EUR	3 991 000	3 172 760	0,14

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Roumanie, suite				
République de Roumanie, 2 %, 28/01/2032	EUR	3 848 000	2 965 162	0,13
République de Roumanie, 7,125 %, 17/01/2033	USD	6 478 000	6 834 290	0,30
République de Roumanie, 2 %, 14/04/2033	EUR	1 714 000	1 269 655	0,06
République de Roumanie, 6 %, 25/05/2034	USD	3 590 000	3 516 405	0,16
République de Roumanie, 2,625 %, 2/12/2040	EUR	2 928 000	1 893 130	0,08
République de Roumanie, 2,75 %, 14/04/2041		3 610 000	2 338 033	0,10
			33 774 820	1,49
Russie				
Gazprom PJSC (Fédération de Russie), 1,85 %, 17/11/2028		4 918 000	3 715 891	0,16
Fédération de Russie, 5,1 %, 28/03/2035	USD	2 200 000	374 000	0,02
			4 089 891	0,18
Arabie saoudite				
Arabian Centres Sukuk II Ltd., 5,625 %, 7/10/2026		4 583 000	4 351 100	0,19
BSF Finance, 5,5 %, 23/11/2027		5 450 000	5 572 625	0,25
Dar Al-Arkan Sukuk Co. Ltd., 6,875 %, 21/03/2023		2 604 000	2 597 490	0,11
Dar Al-Arkan Sukuk Co. Ltd., 6,875 %, 26/02/2027		7 694 000	7 509 559	0,33
Royaume d'Arabie Saoudite, 5,5 %, 25/10/2032		7 440 000	7 970 472	0,35
Royaume d'Arabie Saoudite, 4,875 %, 18/07/2033		3 593 000	3 655 878	0,16
Royaume d'Arabie Saoudite, 4,625 %, 4/10/2047		14 766 000	13 389 514	0,59
Royaume d'Arabie Saoudite, 5,25 %, 16/01/2050		7 027 000	6 952 654	0,31
Royaume d'Arabie Saoudite, 3,25 %, 17/11/2051		6 513 000	4 754 490	0,21
Royaume d'Arabie Saoudite, 5 %, 18/01/2053		3 590 000	3 420 337	0,15
SA Global Sukuk Ltd. (Royaume d'Arabie Saoudite), 2,694 %, 17/06/2031		2 516 000	2 224 823	0,10
Saudi Arabian Oil Co., 3,5 %, 16/04/2029		3 038 000	2 847 760	0,13
Saudi Arabian Oil Co., 2,25 %, 24/11/2030		3 902 000	3 303 542	0,15
Saudi Arabian Oil Co., 4,25 %, 16/04/2039		1 145 000	1 053 400	0,05
Saudi Arabian Oil Co., 3,5 %, 24/11/2070		5 928 000	4 149 600	0,18
Saudi Aramco (Royaume d'Arabie Saoudite), 4,5 %, 26/10/2046		11 667 000	10 440 052	0,46
			84 193 296	3,72
Sénégal				
République du Sénégal, 6,25 %, 23/05/2033		3 300 000	2 845 920	0,12
République du Sénégal, 6,75 %, 13/03/2048		2 034 000	1 518 503	0,07
			4 364 423	0,19
Serbie				
République de Serbie, 6,25 %, 26/05/2028		5 958 000	6 062 265	0,27
République de Serbie, 1,5 %, 26/06/2029	EUR	2 293 000	1 882 689	0,08
République de Serbie, 6,5 %, 26/09/2033	USD	5 015 000	5 024 529	0,22
			12 969 483	0,57
Singapour				
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 1,832 % jusqu'au 10/09/2025, FLR jusqu'au 10/09/2030		3 392 000	3 091 096	0,14
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 4,602 % jusqu'au 15/06/2027, FLR jusqu'au 15/06/2032		3 084 000	3 020 192	0,13
Puma International Financing S.A., 5 %, 24/01/2026		7 487 000	6 888 789	0,31
United Overseas Bank Ltd., 2 % jusqu'au 14/10/2026, FLR jusqu'au 14/10/2031		6 232 000	5 526 032	0,24
United Overseas Bank Ltd., 3,863 % jusqu'au 7/10/2027, FLR jusqu'au 7/10/2032		3 348 000	3 176 180	0,14
Vena Energy Capital Pte Ltd., 3,133 %, 26/02/2025		5 022 000	4 674 354	0,21
			26 376 643	1,17
Slovénie				
United Group B.V., 3,125 %, 15/02/2026	EUR	1 890 000	1 765 410	0,08
United Group B.V., 3,625 %, 15/02/2028		2 142 000	1 835 602	0,08
United Group B.V., 4,625 %, 15/08/2028		1 787 000	1 573 229	0,07
			5 174 241	0,23
Afrique du Sud				
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 7,125 %, 11/02/2025	USD	8 947 000	8 567 647	0,38
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 6,35 %, 10/08/2028		5 041 000	4 812 844	0,21
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 8,45 %, 10/08/2028		2 541 000	2 434 873	0,11

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Afrique du Sud, suite				
Petra Diamonds US$ Treasury PLC, 10,5 % (10,5 % PIK/9,75 % liquidités au 30/06/2023), 9,75 % liquidités au 8/03/2026 (p)	USD	2 964 614	2 875 676	0,13
République d'Afrique du Sud, 5,75 %, 30/09/2049		9 620 000	7 324 476	0,32
République d'Afrique du Sud, 7,3 %, 20/04/2052		7 958 000	7 162 200	0,32
Sasol Financing (USA) LLC, 5,5 %, 18/03/2031		9 355 000	8 162 237	0,36
			41 339 953	1,83
Corée du Sud				
Export–Import Bank of Korea, 4,5 %, 15/09/2032		2 994 000	2 988 431	0,13
Korea Development Bank, 4,25 %, 8/09/2032		4 532 000	4 416 378	0,20
SK hynix, Inc., 6,25 %, 17/01/2026		3 740 000	3 779 532	0,17
SK hynix, Inc., 6,375 %, 17/01/2028		4 948 000	5 023 177	0,22
			16 207 518	0,72
Sri Lanka				
République du Sri Lanka, 7,85 %, 14/03/2029		4 944 000	1 674 545	0,07
République du Sri Lanka, 7,55 %, 28/03/2030		6 346 000	2 149 342	0,10
			3 823 887	0,17
Organismes supranationaux				
West African Development Bank, 4,7 %, 22/10/2031		2 075 000	1 831 188	0,08
Thaïlande				
Bangkok Bank Public Co. Ltd., 3,733 % jusqu'au 25/09/2029, FLR jusqu'au 25/09/2034		3 990 000	3 504 896	0,15
Bangkok Bank Public Co. Ltd., 3,466 % jusqu'au 23/09/2031, FLR jusqu'au 23/09/2036		8 711 000	7 450 788	0,33
GC Treasury Center Co. Ltd. (Royaume de Thaïlande), 5,2 %, 30/03/2052		2 441 000	2 110 733	0,09
Kasikornbank PLC (Hong Kong Branch), 3,343 %, 2/10/2031		5 016 000	4 497 847	0,20
Thaioil Treasury Center Co. Ltd., 3,75 %, 18/06/2050		2 286 000	1 547 803	0,07
			19 112 067	0,84
Trinité-et-Tobago				
Consolidated Energy Finance S.A., 5,625 %, 15/10/2028		6 915 000	6 016 050	0,27
Turquie				
République turque, 5,6 %, 14/11/2024		1 676 000	1 610 485	0,07
République turque, 4,25 %, 13/03/2025		6 380 000	5 907 867	0,26
République turque, 4,75 %, 26/01/2026		4 124 000	3 716 648	0,16
République turque, 4,875 %, 9/10/2026		8 508 000	7 508 310	0,33
République turque, 9,875 %, 15/01/2028		5 124 000	5 252 100	0,23
République turque, 5,125 %, 17/02/2028		2 803 000	2 393 201	0,11
République turque, 6,125 %, 24/10/2028		5 314 000	4 669 391	0,21
République turque, 5,25 %, 13/03/2030		5 548 000	4 432 852	0,20
République turque, 5,95 %, 15/01/2031		2 757 000	2 264 655	0,10
République turque, 5,875 %, 26/06/2031		3 913 000	3 158 808	0,14
République turque, 9,375 %, 19/01/2033		4 581 000	4 486 192	0,20
République turque, 6,5 %, 20/09/2033		3 718 000	3 035 747	0,13
République turque, 6,625 %, 17/02/2045		1 653 000	1 236 940	0,05
République turque, 5,75 %, 11/05/2047		4 608 000	3 074 706	0,14
T.C. Ziraat Bankasi A.S. (République turque), 9,5 %, 1/08/2026		4 116 000	4 068 584	0,18
			56 816 486	2,51
Ukraine				
Gouvernement d'Ukraine, 7,75 %, 1/09/2029 (p)		1 821 000	400 392	0,02
Gouvernement d'Ukraine, 6,876 %, 21/05/2031 (p)		8 721 000	1 713 677	0,07
Gouvernement d'Ukraine, 7,375 %, 25/09/2034 (p)		15 570 000	3 075 075	0,14
Gouvernement d'Ukraine, 7,253 %, 15/03/2035 (p)		15 668 000	3 053 301	0,13
Gouvernement d'Ukraine, Obligation liée au PIB, 0 %, 31/05/2041		9 120 000	2 863 110	0,13
NAK Naftogaz Ukraine via Standard Bank London Holdings PLC, 7,625 %, 8/11/2026		2 890 000	592 450	0,03
NPC Ukrenergo (Gouvernement d'Ukraine), 6,875 %, 9/11/2028		3 863 000	673 128	0,03
PJSC State Savings Bank of Ukraine, 9,375 %, 10/03/2023		355 000	249 787	0,01
PJSC State Savings Bank of Ukraine, 9,625 %, 20/03/2025		3 093 250	1 517 626	0,07
Ukrainian Railways, 8,25 %, 9/07/2026		5 874 000	1 204 170	0,05

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Ukraine, suite				
Ukrainian Railways, 7,875 %, 15/07/2028	USD	3 568 000	661 864	0,03
			16 004 580	0,71
Émirats arabes unis				
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC, 3,5 %, 31/03/2027		4 248 000	4 048 344	0,18
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC, 4,5 %, 14/09/2027		2 869 000	2 844 900	0,13
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline, 4,6 %, 2/11/2047		8 180 000	7 774 174	0,34
Abu Dhabi Ports Co. PJSC, 2,5 %, 6/05/2031		2 002 000	1 708 507	0,08
DAE Funding LLC (Émirats arabes unis), 3,375 %, 20/03/2028		3 774 000	3 414 564	0,15
DAE Sukuk (DIFC) Ltd., 3,75 %, 15/02/2026		4 694 000	4 522 763	0,20
DP World Salaam (Émirats arabes unis), 6 % jusqu'au 1/01/2026, FLR jusqu'au 1/01/2070		4 190 000	4 190 000	0,18
Emirates Sembcorp Water & Power Co. (Émirats arabes unis), 4,45 %, 1/08/2035		4 264 000	4 141 623	0,18
First Abu Dhabi Bank PJSC, 5,125 %, 13/10/2027		4 731 000	4 838 611	0,21
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 1,75 %, 30/09/2027		3 070 946	2 848 040	0,13
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 2,625 %, 31/03/2036		5 330 000	4 353 302	0,19
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 2,94 %, 30/09/2040		7 899 450	6 452 802	0,29
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 3,25 %, 30/09/2040		7 647 000	6 022 742	0,27
GEMS Menasa Cayman Ltd./GEMS Education Delaware LLC, 7,125 %, 31/07/2026		3 438 000	3 393 941	0,15
MDGH - GMTN RSC Ltd. (Émirats arabes unis), 2,5 %, 3/06/2031		3 529 000	3 032 646	0,13
MDGH - GMTN RSC Ltd. (Émirats arabes unis), 5,5 %, 28/04/2033		5 864 000	6 263 080	0,28
National Central Cooling Co., PJSC (Émirats arabes unis), 2,5 %, 21/10/2027		4 764 000	4 309 038	0,19
Sweihan PV Power Co. PJSC, 3,625 %, 31/01/2049		4 119 217	3 436 589	0,15
			77 595 666	3,43
Royaume-Uni				
SCC Power PLC, 8 % (8 % cash or 4 % PIK) jusqu'au 15/06/2024, 8 % liquidités au 31/12/2028 (p)		2 990 328	917 732	0,04
SCC Power PLC, 4 % (4 % cash or 4 % PIK) jusqu'au 15/06/2024, 4 % liquidités au 17/05/2032 (p)		1 786 038	73 227	0,00
			990 959	0,04
États-Unis				
Hyundai Capital America, 2,375 %, 15/10/2027		2 367 000	2 101 095	0,09
Hyundai Capital America, 1,8 %, 10/01/2028		2 779 000	2 355 274	0,11
JBS USA LLC/JBS USA Finance, Inc., 3,625 %, 15/01/2032		5 227 000	4 366 636	0,19
JBS USA LLC/JBS USA Finance, Inc., 5,75 %, 1/04/2033		4 490 000	4 402 714	0,20
Obligations du Trésor américain, 3,5 %, 15/02/2039		10 457 000	10 348 345	0,46
Obligations du Trésor américain, 2,5 %, 15/02/2046 (g)		30 958 200	24 874 188	1,10
Bons du Trésor américain, 3,875 %, 30/09/2029		3 142 000	3 195 758	0,14
Bons du Trésor américain, 2,75 %, 15/08/2032		2 256 000	2 122 755	0,09
			53 766 765	2,38
Uruguay				
République orientale d'Uruguay, 8,5 %, 15/03/2028	UYU	89 503 000	2 143 837	0,09
République orientale d'Uruguay, 8,25 %, 21/05/2031		94 005 000	2 182 350	0,10
République orientale d'Uruguay, 5,75 %, 28/10/2034	USD	6 324 000	6 995 528	0,31
République orientale d'Uruguay, 5,1 %, 18/06/2050		1 311 000	1 322 694	0,06
République orientale d'Uruguay, 4,975 %, 20/04/2055		11 959 000	11 837 015	0,52
République orientale d'Uruguay, Obligation indexée sur l'inflation, 3,875 %, 2/07/2040	UYU	76 507 744	2 083 889	0,09
			26 565 313	1,17
Ouzbékistan				
Ipoteka Bank (République d'Ouzbékistan), 5,5 %, 19/11/2025	USD	5 274 000	4 918 005	0,22
National Bank of Uzbekistan, 4,85 %, 21/10/2025		5 607 000	5 242 545	0,23
République d'Ouzbékistan, 3,7 %, 25/11/2030		2 965 000	2 446 866	0,11
République d'Ouzbékistan, 3,9 %, 19/10/2031		2 504 000	2 052 088	0,09
Uzbek Industrial and Construction Bank, 5,75 %, 2/12/2024		5 293 000	5 107 745	0,22
Uzbekneftegaz JSC (République d'Ouzbékistan), 4,75 %, 16/11/2028		5 015 000	4 206 582	0,19
			23 973 831	1,06
Venezuela				
République du Venezuela, 9 %, 7/05/2023 (d)		4 486 000	392 525	0,02
République du Venezuela, 8,25 %, 13/10/2024 (d)		7 913 000	692 388	0,03

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Venezuela, suite				
République du Venezuela, 7,65 %, 21/04/2025 (d)	USD	13 400 000	1 072 000	0,05
République du Venezuela, 9,25 %, 15/09/2027 (d)		3 849 000	369 163	0,01
République du Venezuela, 7 %, 31/03/2038 (d)		22 178 500	1 774 280	0,08
			4 300 356	0,19
Vietnam				
Mong Duong Finance Holdings B.V., 5,125 %, 7/05/2029		6 794 000	6 046 661	0,27
République socialiste du Vietnam, 4,8 %, 19/11/2024		14 097 000	13 885 545	0,61
			19 932 206	0,88
Zambie				
République de Zambie, 8,97 %, 30/07/2027 (d)		11 277 000	5 599 730	0,25
Total des obligations (coût identifié, 2 414 075 002 $)			**2 101 260 165**	**92,89**
ACTIONS ORDINAIRES				
Mexique				
ICA Tenedora, S.A. de C.V. (b)		1 849 763	1 669 949	0,07
Royaume-Uni				
Petra Diamonds Ltd.		1 280 103	1 246 758	0,06
Total des actions ordinaires (coût identifié, 1 132 891 $)			**2 916 707**	**0,13**
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 136 125 000 $)	USD	136 125 000	136 125 000	6,02
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 2 551 332 893 $) (k)			**2 240 301 872**	**99,04**
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			**21 805 270**	**0,96**
ACTIF NET			**2 262 107 142**	**100,00**

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

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Local Currency Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Bermudes				
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032	USD	200 000	200 807	0,75
Brésil				
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2025	BRL	10 458 000	1 967 519	7,32
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2027		3 914 000	708 339	2,64
			2 675 858	9,96
Chili				
République du Chili, 2,5 %, 1/03/2025	CLP	475 000 000	556 584	2,07
République du Chili, 4,7 %, 1/09/2030		305 000 000	363 882	1,36
République du Chili, 7 %, 1/05/2034		90 000 000	128 890	0,48
République du Chili, 6 %, 1/01/2043	CLP	70 000 000	94 104	0,35
			1 143 460	4,26
Chine				
China Development Bank, 3,45 %, 20/09/2029	CNY	4 770 000	722 029	2,69
République populaire de Chine, 2,75 %, 17/02/2032		3 270 000	476 977	1,78
Republic of China, 3,25 %, 6/06/2026		2 970 000	449 553	1,67
			1 648 559	6,14
Colombie				
Empresas Publicas de Medellin, 8,375 %, 8/11/2027	COP	486 000 000	78 813	0,29
République de Colombie, 7,5 %, 26/08/2026		1 219 000 000	228 321	0,85
République de Colombie, 5,75 %, 3/11/2027		4 188 100 000	701 004	2,61

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Colombie, suite				
République de Colombie, "B", 7,75 %, 18/09/2030	COP	323 100 000	54 403	0,20
			1 062 541	3,95
République tchèque				
République tchèque, 2,4 %, 17/09/2025	CZK	3 320 000	140 374	0,52
République tchèque, 2 %, 13/10/2033		29 800 000	1 061 417	3,95
PPF Telecom Group B.V., 3,25 %, 29/09/2027	EUR	100 000	99 469	0,37
			1 301 260	4,84
République dominicaine				
République dominicaine, 13,625 %, 3/02/2033	DOP	8 000 000	140 969	0,52
Guatemala				
Central American Bottling Corp., 5,25 %, 27/04/2029	USD	89 000	85 466	0,32
Hongrie				
République de Hongrie, 5,5 %, 24/06/2025	HUF	81 460 000	200 239	0,74
République de Hongrie, 2,25 %, 20/04/2033		231 410 000	394 780	1,47
			595 019	2,21
Inde				
Shriram Transport Finance Co. Ltd., 4,4 %, 13/03/2024	USD	200 000	192 750	0,72
Indonésie				
République d'Indonésie, 9 %, 15/03/2029	IDR	1 748 000 000	130 996	0,49
République d'Indonésie, 7 %, 15/09/2030		6 502 000 000	441 988	1,64
République d'Indonésie, 6,375 %, 15/04/2032		2 265 000 000	147 606	0,55
République d'Indonésie, 7,5 %, 15/08/2032		5 620 000 000	394 026	1,47
République d'Indonésie, 7,5 %, 15/05/2038		3 908 000 000	273 414	1,02
République d'Indonésie, 8,375 %, 15/04/2039		1 790 000 000	135 192	0,50
République d'Indonésie, 7,125 %, 15/06/2042		1 027 000 000	69 424	0,26
			1 592 646	5,93
Israël				
Energean Israel Finance Ltd., 4,875 %, 30/03/2026	USD	111 000	103 646	0,39
Malaisie				
Gouvernement de Malaisie, 3,733 %, 15/06/2028	MYR	561 000	133 237	0,50
Gouvernement de Malaisie, 4,232 %, 30/06/2031		1 878 000	452 375	1,68
Gouvernement de Malaisie, 3,582 %, 15/07/2032		1 181 000	271 773	1,01
Gouvernement de Malaisie, 3,757 %, 22/05/2040		590 000	131 221	0,49
Gouvernement de Malaisie, 4,065 %, 15/06/2050		1 117 000	250 373	0,93
			1 238 979	4,61
Mexique				
Grupo Axo S.A.P.I. de C.V., 5,75 %, 8/06/2026	USD	200 000	176 717	0,66
Petroleos Mexicanos, 7,47 %, 12/11/2026	MXN	1 998 300	91 770	0,34
Red de Carreteras de Occidente SAPIB de C.V., 9 %, 10/06/2028		1 867 500	92 612	0,34
États-Unis du Mexique, 5 %, 6/03/2025		21 700 000	1 044 707	3,89
États-Unis du Mexique, 8,5 %, 31/05/2029		6 830 000	359 452	1,34
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 29/05/2031		10 200 000	512 077	1,91
États-Unis du Mexique, 7,5 %, 26/05/2033		4 500 000	220 704	0,82
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 23/11/2034		5 600 000	277 167	1,03
États-Unis du Mexique, 8 %, 7/11/2047		10 810 000	528 872	1,97
			3 304 078	12,30
Pérou				
Banco de Credito del Peru, 4,65 %, 17/09/2024	PEN	686 000	165 568	0,62
Peru LNG, 5,375 %, 22/03/2030	USD	200 000	165 848	0,62
République du Pérou, 6,95 %, 12/08/2031	PEN	1 059 000	258 104	0,96
République du Pérou, 6,15 %, 12/08/2032		729 000	165 709	0,62
République du Pérou, 6,9 %, 12/08/2037		203 000	46 865	0,17
			802 094	2,99
Pologne				
République de Pologne, 2,75 %, 25/04/2028	PLN	282 000	55 944	0,21

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Pologne, suite				
République de Pologne, 1,25 %, 25/10/2030	PLN	2 677 000	442 428	1,64
République de Pologne, 1,75 %, 25/04/2032		5 170 000	842 749	3,14
			1 341 121	4,99
Roumanie				
République de Roumanie, 4,75 %, 24/02/2025	RON	4 350 000	918 767	3,42
République de Roumanie, 7,125 %, 17/01/2033	USD	76 000	80 180	0,30
			998 947	3,72
Russie				
Fédération de Russie, 7,75 %, 16/09/2026 (c)(d)	RUB	19 665 000	35 711	0,13
Afrique du Sud				
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 7,85 %, 2/04/2026	ZAR	2 000 000	111 002	0,41
République d'Afrique du Sud, 8 %, 31/01/2030		19 093 000	1 005 345	3,74
République d'Afrique du Sud, 7 %, 28/02/2031		4 827 000	230 642	0,86
République d'Afrique du Sud, 8,875 %, 28/02/2035		7 455 000	370 094	1,38
République d'Afrique du Sud, 9 %, 31/01/2040		10 049 000	476 172	1,77
Transnet SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 13,5 %, 18/04/2028		1 700 000	109 923	0,41
			2 303 178	8,57
Corée du Sud				
SK hynix, Inc., 6,375 %, 17/01/2028	USD	200 000	203 039	0,76
Sri Lanka				
République du Sri Lanka, 6,75 %, 18/04/2028 (d)		200 000	67 730	0,25
Thaïlande				
Royaume de Thaïlande, 3,775 %, 25/06/2032	THB	37 616 000	1 259 075	4,68
Royaume de Thaïlande, 1,6 %, 17/06/2035		5 493 000	146 400	0,54
Royaume de Thaïlande, 3,3 %, 17/06/2038		4 837 000	152 409	0,57
Royaume de Thaïlande, 2 %, 17/06/2042		11 132 000	286 567	1,07
			1 844 451	6,86
Uruguay				
République orientale d'Uruguay, 8,5 %, 15/03/2028	UYU	12 683 000	303 792	1,13
République orientale d'Uruguay, 8,25 %, 21/05/2031		2 536 000	58 874	0,22
			362 666	1,35
Total des obligations (coût identifié, 24 796 066 $)			23 244 975	86,52
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 2 915 000 $)	USD	2 915 000	2 915 000	10,85
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 27 711 066 $) (k)			26 159 975	97,37
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			706 242	2,63
ACTIF NET			26 866 217	100,00

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

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Boissons alcoolisées			
Ambev S.A., ADR	317 119	843 537	1,02
China Resources Beer Holdings Co. Ltd.	132 000	992 380	1,20
Jiangsu Yanghe Brewery JSC Ltd., "A"	9 900	257 282	0,31
Kweichow Moutai Co. Ltd., "A"	4 960	1 354 897	1,64
Wuliangye Yibin Co. Ltd.	16 600	513 456	0,62
		3 961 552	4,79

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Industrie automobile			
BYD Co. Ltd.	11 000	346 365	0,42
Hero MotoCorp Ltd.	20 264	684 787	0,83
Mahindra & Mahindra Ltd.	52 210	880 557	1,06
		1 911 709	2,31
Biotechnologies			
Hugel, Inc.	7 600	876 730	1,06
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
B3 Brasil Bolsa Balcao S.A.	402 400	1 027 344	1,24
Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC (c)	808 503	0	0,00
		1 027 344	1,24
Services aux entreprises			
Cognizant Technology Solutions Corp., "A"	14 571	972 614	1,17
Kingsoft Cloud Holdings, ADR	35 396	169 901	0,21
Tata Consultancy Services Ltd.	38 270	1 577 382	1,91
Tech Mahindra Ltd.	70 904	881 795	1,06
		3 601 692	4,35
Produits chimiques			
UPL Ltd.	156 514	1 452 361	1,75
Logiciels			
NAVER Corp.	8 050	1 341 353	1,62
NetEase, Inc., ADR	14 716	1 303 985	1,58
		2 645 338	3,20
Logiciels - Systèmes			
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	353 000	1 177 529	1,42
Samsung Electronics Co. Ltd.	97 082	4 852 537	5,86
		6 030 066	7,28
Conglomérats			
LG Corp.	6 526	440 642	0,53
Construction			
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	171 500	649 592	0,79
Gree Electric Appliances, Inc., "A"	168 400	863 066	1,04
Midea Group Co. Ltd., "A"	76 900	630 536	0,76
Techtronic Industries Co. Ltd.	97 000	1 250 597	1,51
Zhejiang Supor Co. Ltd., "A"	59 512	455 889	0,55
		3 849 680	4,65
Biens de consommation			
AmorePacific Corp.	3 362	400 913	0,49
Électronique			
Delta Electronics, Inc.	82 000	795 071	0,96
SK Hynix, Inc.	2 821	205 314	0,25
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	378 330	6 674 571	8,06
		7 674 956	9,27
Énergie - Sociétés intégrées			
China Petroleum & Chemical Corp.	2 278 000	1 232 005	1,49
Galp Energia SGPS S.A., "B"	92 798	1 268 633	1,53
LUKOIL PJSC (c)	14 635	0	0,00
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	114 858	1 332 353	1,61
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	33 388	344 564	0,42
		4 177 555	5,05
Ingénierie - Construction			
Doosan Bobcat, Inc.	20 354	578 782	0,70
Alimentation et boissons			
Gruma S.A.B. de C.V.	44 806	651 704	0,79
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd., "A"	261 500	1 265 706	1,53
Orion Corp.	7 174	727 407	0,88

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Alimentation et boissons, suite			
Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	198 000	328 773	0,39
		2 973 590	3,59
Magasins d'alimentation et pharmacies			
BIM Birlesik Magazalar A.S.	43 952	291 641	0,35
Raia Drogasil S.A.	28 618	139 981	0,17
		431 622	0,52
Produits forestiers et papier			
Suzano S.A.	41 535	379 324	0,46
Assurances			
AIA Group Ltd.	116 800	1 319 021	1,59
Discovery Ltd.	85 394	677 263	0,82
Ping An Insurance Co. of China Ltd., "H"	229 000	1 787 470	2,16
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	7 119	1 175 953	1,42
		4 959 707	5,99
Internet			
Baidu, Inc., ADR	1 871	251 986	0,30
MakeMyTrip Ltd.	16 167	468 520	0,57
Tencent Holdings Ltd.	101 300	4 937 651	5,96
		5 658 157	6,83
Loisirs et jouets			
NCsoft Corp.	594	221 059	0,27
VTech Holdings Ltd.	35 100	231 876	0,28
		452 935	0,55
Machines et outils			
AirTAC International Group	8 000	274 371	0,33
Grandes banques			
Banco Bradesco S.A., ADR	93 814	261 741	0,32
Bandhan Bank Ltd.	189 568	566 651	0,68
Erste Group Bank AG	19 811	750 428	0,91
Nedbank Group Ltd.	45 451	589 517	0,71
		2 168 337	2,62
Technologies et services médicaux et de santé			
Burning Rock Biotech Ltd., ADR	39 883	116 060	0,14
Métaux et exploitation minière			
PT United Tractors Tbk	545 200	892 906	1,08
Vale S.A., ADR	23 255	434 403	0,52
		1 327 309	1,60
Gaz naturel - Distribution			
China Resources Gas Group Ltd.	148 500	624 025	0,75
Réseaux et télécommunications			
GDS Holdings Ltd., "A"	52 200	152 450	0,19
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
China Construction Bank Corp.	1 650 750	1 072 258	1,29
China Merchants Bank Co Ltd. "A"	71 400	437 534	0,53
Credicorp Ltd.	7 535	1 011 951	1,22
Emirates NBD PJSC	155 822	549 371	0,66
Grupo Financiero Inbursa S.A. de C.V.	71 498	153 775	0,19
HDFC Bank Ltd.	77 477	1 524 399	1,84
Housing Development Finance Corp. Ltd.	36 514	1 172 302	1,42
KB Financial Group, Inc.	9 375	427 159	0,52
Komercní banka A.S.	7 009	236 109	0,28
Muthoot Finance Ltd.	13 970	178 604	0,22
Sberbank of Russia PJSC (c)	630 893	0	0,00
SK Square Co. Ltd.	6 220	184 510	0,22

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Autres banques et établissements financiers diversifiés, suite				
Tisco Financial Group PCL		251 300	780 317	0,94
			7 728 289	9,33
Produits pharmaceutiques				
Genomma Lab Internacional S.A., "B"		284 333	266 961	0,32
Métaux et minéraux précieux				
Gold Fields Ltd., ADR		53 770	615 129	0,74
Polymetal International PLC		77 528	223 635	0,27
			838 764	1,01
Immobilier				
Emaar Properties PJSC		549 406	832 916	1,00
ESR Group Ltd.		164 000	329 894	0,40
Hang Lung Properties Ltd.		175 000	329 416	0,40
			1 492 226	1,80
Restaurants				
Yum China Holdings, Inc.		32 682	2 013 538	2,43
Produits chimiques spéciaux				
Saudi Basic Industries Corp.		16 018	397 764	0,48
Magasins spécialisés				
Alibaba Group Holding Ltd.		250 636	3 463 357	4,18
JD.com, Inc., "A"		13 688	407 212	0,49
JD.com, Inc., ADR		1 328	79 056	0,10
Lojas Renner S.A.		256 552	1 093 162	1,32
Meituan, "B"		15 730	350 262	0,42
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios S.A.		77 688	364 084	0,44
Vipshop Holdings Ltd., ADR		49 301	762 686	0,92
Walmart de Mexico S.A.B. de C.V.		238 792	935 360	1,13
			7 455 179	9,00
Télécommunications mobiles				
Advanced Info Service Public Co. Ltd.		71 300	422 270	0,51
Etihad Etisalat Co.		70 052	661 308	0,80
PT Telekom Indonesia		2 452 700	629 946	0,76
			1 713 524	2,07
Services téléphoniques				
Hellenic Telecommunications Organization S.A.		36 638	576 355	0,70
Total des actions ordinaires (coût identifié, 85 660 393 $)			**80 629 807**	**97,38**
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 2 089 000 $)	USD	2 089 000	2 089 000	2,52
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 87 749 393 $) (k)			**82 718 807**	**99,90**
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			**81 254**	**0,10**
ACTIF NET			**82 800 061**	**100,00**

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

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Research Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Boissons alcoolisées			
China Resources Beer Holdings Co. Ltd.	8 000	60 144	2,09
Kweichow Moutai Co. Ltd., "A"	200	54 633	1,90
Wuliangye Yibin Co. Ltd.	1 200	37 117	1,29
		151 894	5,28

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Research Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Industrie automobile			
BYD Co. Ltd.	2 000	62 975	2,19
Biotechnologies			
Hugel, Inc.	167	19 265	0,67
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
B3 Brasil Bolsa Balcao S.A.	16 800	42 891	1,49
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	1 100	49 437	1,72
Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC (c)	16 286	0	0,00
		92 328	3,21
Services aux entreprises			
Tata Consultancy Services Ltd.	1 044	43 031	1,50
Tech Mahindra Ltd.	1 026	12 760	0,44
		55 791	1,94
Produits chimiques			
UPL Ltd.	4 751	44 087	1,53
Logiciels			
Kingsoft Corp.	10 600	39 252	1,37
NAVER Corp.	231	38 491	1,34
NetEase, Inc., ADR	394	34 912	1,21
		112 655	3,92
Logiciels - Systèmes			
Samsung Electronics Co. Ltd.	3 284	164 147	5,71
Construction			
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	8 500	32 196	1,12
Midea Group Co. Ltd., "A"	7 400	60 676	2,11
Techtronic Industries Co. Ltd.	5 500	70 910	2,46
Zhejiang Supor Co. Ltd., "A"	3 200	24 513	0,85
		188 295	6,54
Biens de consommation			
AmorePacific Corp.	338	40 306	1,40
Services de consommation			
Localiza Rent a Car S.A.	4 911	57 282	1,99
Localiza Rent a Car S.A.	21	245	0,01
		57 527	2,00
Équipements électriques			
Advantech Co. Ltd.	2 000	22 835	0,79
Électronique			
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	13 000	229 348	7,97
Énergie - Sociétés indépendantes			
Reliance Industries Ltd.	1 715	49 396	1,72
Énergie - Sociétés intégrées			
China Petroleum & Chemical Corp.	42 000	22 715	0,79
Galp Energia SGPS S.A., "B"	3 624	49 543	1,72
LUKOIL PJSC (c)	486	0	0,00
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	3 852	44 683	1,55
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	1 464	15 109	0,53
		132 050	4,59
Ingénierie - Construction			
Doosan Bobcat, Inc.	1 062	30 199	1,05
Alimentation et boissons			
Gruma S.A.B. de C.V.	4 243	61 714	2,14
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd., "A"	9 800	47 434	1,65
		109 148	3,79

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Research Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Magasins d'alimentation et pharmacies			
BIM Birlesik Magazalar A.S.	3 644	24 179	0,84
Assurances			
AIA Group Ltd.	6 600	74 534	2,59
Internet			
Tencent Holdings Ltd.	3 000	146 229	5,08
Grandes banques			
Bandhan Bank Ltd.	10 645	31 820	1,11
Nedbank Group Ltd.	2 246	29 131	1,01
		60 951	2,12
Technologies et services médicaux et de santé			
Burning Rock Biotech Ltd., ADR	1 276	3 713	0,13
Métaux et exploitation minière			
PT United Tractors Tbk	38 500	63 054	2,19
Vale S.A., ADR	1 619	30 243	1,05
		93 297	3,24
Gaz naturel - Distribution			
China Resources Gas Group Ltd.	12 900	54 208	1,88
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Chailease Holding Co.	8 560	64 769	2,25
China Merchants Bank Co Ltd. "A"	8 500	52 087	1,81
Credicorp Ltd.	334	44 856	1,56
Emirates NBD PJSC	12 284	43 309	1,51
HDFC Bank Ltd.	2 862	56 311	1,96
KB Financial Group, Inc.	664	30 254	1,05
Komercní banka A.S.	1 282	43 186	1,50
Kotak Mahindra Bank Ltd.	1 859	39 404	1,37
PT Bank Central Asia Tbk	44 800	25 390	0,88
Sberbank of Russia PJSC (c)	11 518	0	0,00
TCS Group Holding PLC, GDR (c)	271	0	0,00
		399 566	13,89
Métaux et minéraux précieux			
Polymetal International PLC	3 475	10 024	0,35
Immobilier			
ESR Group Ltd.	15 000	30 173	1,05
Restaurants			
Yum China Holdings, Inc.	1 685	103 813	3,61
Produits chimiques spéciaux			
Borouge PLC	19 430	13 753	0,48
Saudi Basic Industries Corp.	1 331	33 052	1,15
		46 805	1,63
Magasins spécialisés			
JD.com, Inc., "A"	1 652	49 146	1,71
Meituan, "B"	310	6 903	0,24
Walmart de Mexico S.A.B. de C.V.	11 398	44 647	1,55
		100 696	3,50
Télécommunications mobiles			
Advanced Info Service Public Co. Ltd.	8 400	49 749	1,73
Services téléphoniques			
Hellenic Telecommunications Organization S.A.	2 322	36 527	1,27
Services publics - Énergie électrique			
Energisa S.A., IEU	2 400	19 975	0,69
Total des actions ordinaires (coût identifié, 3 205 625 $)		2 816 685	97,90

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Research Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 138 000 $)	USD	138 000	138 000	4,80
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 3 343 625 $) (k)			2 954 685	102,70
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			(77 759)	(2,70)
ACTIF NET			2 876 926	100,00

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

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Aérospatiale et défense				
Thales S.A., 0 %, 26/03/2026	EUR	600 000	539 580	0,70
Compagnies aériennes				
EasyJet Finco B.V., 1,875 %, 3/03/2028		510 000	435 484	0,56
Boissons alcoolisées				
Pernod Ricard S.A., 3,75 %, 2/11/2032		700 000	713 273	0,92
Créances adossées à des actifs et titrisées				
AA Bond Co. Ltd., 3,25 %, 31/07/2028	GBP	630 000	571 074	0,74
RAC Bond Co. PLC, 4,87 %, 6/05/2026		210 000	223 914	0,29
			794 988	1,03
Industrie automobile				
General Motors Financial Co., Inc., 1 %, 24/02/2025	EUR	790 000	749 072	0,97
Mercedes-Benz Financial Services (Canada), 3 %, 23/02/2027		300 000	296 778	0,39
RENK AG, 5,75 %, 15/07/2025		310 000	302 169	0,39
			1 348 019	1,75
Radio-télévision				
Prosus N.V., 2,085 %, 19/01/2030		260 000	211 641	0,28
Ubisoft Entertainment S.A., 0,878 %, 24/11/2027		700 000	527 675	0,68
Warnermedia Holdings, Inc., 5,141 %, 15/03/2052	USD	270 000	206 275	0,27
			945 591	1,23
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Euroclear Bank S.A., 3,625 %, 13/10/2027	EUR	450 000	453 204	0,58
Euroclear Investments S.A., 1,5 %, 11/04/2030		600 000	524 158	0,68
London Stock Exchange Group PLC, 0,25 %, 6/04/2028		500 000	430 500	0,56
			1 407 862	1,82
Construction				
Holcim Sterling Finance (Netherlands) B.V., 2,25 %, 4/04/2034	GBP	600 000	503 232	0,65
Services aux entreprises				
Euronet Worldwide, Inc., 1,375 %, 22/05/2026	EUR	330 000	293 640	0,38
Visa, Inc., 2,375 %, 15/06/2034		660 000	602 759	0,78
			896 399	1,16
Télévision par câble				
SES S.A., 3,5 %, 14/01/2029		470 000	440 178	0,57
Produits chimiques				
Arkema S.A., 3,5 %, 23/01/2031		200 000	195 545	0,25
Conglomérats				
ABB Finance B.V., 3,25 %, 16/01/2027		100 000	100 212	0,13
ABB Finance B.V., 3,375 %, 16/01/2031		300 000	297 225	0,38
			397 437	0,51
Biens de consommation				
GSK Consumer Healthcare S.A., 1,25 %, 29/03/2026		610 000	567 190	0,73

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services de consommation				
Booking Holdings, Inc., 1,8 %, 3/03/2027	EUR	400 000	375 756	0,49
Booking Holdings, Inc., 4,75 %, 15/11/2034		106 000	112 675	0,14
			488 431	0,63
Équipements électriques				
Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1,125 %, 8/02/2027		440 000	383 900	0,50
Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1 %, 26/05/2029		790 000	618 330	0,80
			1 002 230	1,30
Électronique				
Infineon Technologies AG, 1,625 %, 24/06/2029		600 000	535 212	0,69
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Ceske Drahy A.S. (République tchèque), 5,625 %, 12/10/2027		430 000	442 003	0,58
CEZ A.S. (République tchèque), 2,375 %, 6/04/2027		877 000	819 820	1,06
			1 261 823	1,64
Énergie - Sociétés intégrées				
Exxon Mobil Corp., 1,408 %, 26/06/2039		500 000	338 354	0,44
Galp Energia SGPS S.A., 2 %, 15/01/2026		400 000	374 976	0,49
MOL PLC, 1,5 %, 8/10/2027		270 000	227 265	0,29
			940 595	1,22
Ingénierie - Construction				
Bouygues S.A., 4,625 %, 7/06/2032		200 000	215 075	0,28
Divertissement				
Carnival Corp., 7,625 %, 1/03/2026		130 000	117 052	0,15
Établissements financiers				
CTP N.V., 1,5 %, 27/09/2031		540 000	366 131	0,47
EXOR N.V., 0,875 %, 19/01/2031		720 000	562 449	0,73
Grand City Properties S.A., 2,5 % jusqu'au 24/10/2023, FLR jusqu'au 24/10/2069		400 000	196 000	0,25
Logicor Financing S.à r.l., 1,625 %, 17/01/2030		270 000	205 547	0,27
Logicor Financing S.à r.l., 0,875 %, 14/01/2031		276 000	188 320	0,24
P3 Group S.à r.l., 0,875 %, 26/01/2026		450 000	393 429	0,51
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 1,75 %, 14/01/2025		490 000	439 047	0,57
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,875 % jusqu'au 30/01/2027, FLR jusqu'au 30/01/2171		900 000	343 350	0,45
VGP N.V., 1,5 %, 8/04/2029		600 000	409 134	0,53
Vonovia SE, REIT, 1,625 %, 1/09/2051		800 000	423 178	0,55
			3 526 585	4,57
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev N.V., 1,5 %, 18/04/2030		420 000	372 379	0,48
Asahi Group Holdings Ltd., 0,541 %, 23/10/2028		1 320 000	1 105 590	1,43
Carlsberg Breweries A.S., 0,875 %, 1/07/2029		440 000	373 334	0,49
			1 851 303	2,40
Industrie				
CPI Property Group S.A., 3,75 % jusqu'au 27/07/2028, FLR jusqu'au 27/01/2170		550 000	261 489	0,34
Investor AB, 2,75 %, 10/06/2032		120 000	113 738	0,15
Investor AB, 0,375 %, 29/10/2035		380 000	258 936	0,33
			634 163	0,82
Assurances				
AIA Group Ltd., 0,88 % jusqu'au 9/09/2028, FLR jusqu'au 9/09/2033		237 000	191 145	0,25
Argentum Netherlands B.V., 5,125 %, 1/06/2048	USD	260 000	226 248	0,29
ASR Nederland N.V., 7 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2043	EUR	280 000	297 696	0,39
			715 089	0,93
Assurances IARD				
Berkshire Hathaway, Inc., 0,5 %, 15/01/2041		460 000	263 258	0,34
QBE Insurance Group Ltd., 2,5 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2038	GBP	242 000	213 910	0,28
			477 168	0,62
Obligations quasi souveraines du marché international				
Aeroports de Paris, 2,75 %, 2/04/2030	EUR	500 000	470 870	0,61

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations quasi souveraines du marché international, suite				
Caixa Geral de Depositos S.A. (République portugaise), 5,75 %, 31/10/2028	EUR	600 000	624 912	0,81
Electricite de France S.A., 2,875 % jusqu'au 15/03/2027, FLR jusqu'au 15/03/2070		200 000	171 000	0,22
EnBW International Finance B.V., 3,5 %, 24/07/2028		300 000	297 423	0,39
EnBW International Finance B.V., 4,049 %, 22/11/2029		440 000	447 246	0,58
ESB Finance DAC, 1 %, 19/07/2034		430 000	322 896	0,42
La Banque Postale S.A., 4,375 %, 17/01/2030		300 000	300 928	0,39
RTE Reseau de Transport d'Electricite, 0,75 %, 12/01/2034		300 000	224 343	0,29
			2 859 618	3,71
Obligations souveraines du marché international				
République fédérale d'Allemagne, 2,2 %, 12/12/2024		2 500 000	2 479 825	3,21
République fédérale d'Allemagne, 1,3 %, 15/10/2027		2 170 000	2 074 694	2,69
République fédérale d'Allemagne, 1,7 %, 15/08/2032		750 000	715 035	0,93
			5 269 554	6,83
Autorités locales				
Province d'Ontario, 0,625 %, 17/04/2025		1 620 000	1 531 224	1,98
Machines et outils				
Sarens Finance Co. N.V., 5,75 %, 21/02/2027		194 000	158 611	0,21
Grandes banques				
Banco de Sabadell S.A., 5,25 % jusqu'au 7/02/2028, FLR jusqu'au 7/02/2029		200 000	199 855	0,26
Banco de Sabadell S.A., 5 % jusqu'au 19/11/2027, FLR jusqu'au 19/02/2170		200 000	168 352	0,22
Bank of America Corp., 0,694 % jusqu'au 22/03/2030, FLR jusqu'au 22/03/2031		880 000	698 889	0,91
Bank of Ireland Group PLC, 4,875 % jusqu'au 16/07/2027, FLR jusqu'au 16/07/2028		300 000	304 576	0,39
Barclays Bank PLC, 8,407 % jusqu'au 14/11/2027, FLR jusqu'au 14/11/2032	GBP	115 000	140 317	0,18
BNP Paribas S.A., 3,875 %, 10/01/2031	EUR	300 000	303 810	0,39
Crédit Agricole Group, 3,875 %, 28/11/2034		500 000	499 725	0,65
Credit Suisse AG (London), 2,125 %, 31/05/2024		290 000	279 654	0,36
Credit Suisse Group AG, 7,75 % jusqu'au 1/03/2028, FLR jusqu'au 1/03/2029		375 000	389 905	0,51
Danske Bank A.S., 4,298 % jusqu'au 1/04/2027, FLR jusqu'au 1/04/2028	USD	510 000	452 034	0,59
Danske Bank A.S., 4,125 % jusqu'au 10/01/2030, FLR jusqu'au 10/01/2031	EUR	320 000	320 614	0,42
Erste Group Bank AG, 0,875 %, 22/05/2026		400 000	362 757	0,47
Erste Group Bank AG, 0,25 %, 14/09/2029		400 000	317 576	0,41
JPMorgan Chase & Co., 1,963 % jusqu'au 23/03/2029, FLR jusqu'au 23/03/2030		617 000	550 717	0,71
Lloyds Banking Group PLC, 1,75 % jusqu'au 7/09/2023, FLR jusqu'au 7/09/2028		270 000	265 357	0,34
Nationwide Building Society, 6,178 % jusqu'au 7/12/2026, FLR jusqu'au 7/12/2027	GBP	100 000	117 328	0,15
Nationwide Building Society, 0,25 %, 14/09/2028	EUR	540 000	442 539	0,57
NatWest Markets PLC, 6,375 %, 8/11/2027	GBP	122 000	145 993	0,19
Royal Bank of Canada, 0,625 %, 10/09/2025	EUR	2 440 000	2 280 697	2,96
Société Générale S.A., 4 %, 16/11/2027		300 000	304 666	0,39
Société Générale S.A., 4,25 %, 6/12/2030		200 000	198 095	0,26
Standard Chartered PLC, 0,85 % jusqu'au 27/01/2027, FLR jusqu'au 27/01/2028		670 000	588 641	0,76
Standard Chartered PLC, 0,8 % jusqu'au 17/11/2028, FLR jusqu'au 17/11/2029		900 000	744 746	0,97
Svenska Handelsbanken AB, 0,01 %, 2/12/2027		360 000	304 798	0,39
TD Bank, 5,288 %, 11/01/2028	GBP	330 000	383 756	0,50
UBS Group AG, 0,25 %, 24/02/2028	EUR	430 000	359 832	0,47
UBS Group AG, 4,375 % jusqu'au 11/01/2030, FLR jusqu'au 11/01/2031		280 000	284 181	0,37
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026	USD	410 000	342 138	0,44
			11 751 548	15,23
Technologies et services médicaux et de santé				
Alcon Finance B.V., 2,375 %, 31/05/2028	EUR	810 000	757 164	0,98
Becton, Dickinson and Co., 1,208 %, 4/06/2026		410 000	379 731	0,49
Thermo Fisher Scientific (Finance I) Co., 2 %, 18/10/2051		755 000	499 023	0,65
Thermo Fisher Scientific, Inc., 2,375 %, 15/04/2032		390 000	352 606	0,46
			1 988 524	2,58
Équipements médicaux				
Boston Scientific Corp., 0,625 %, 1/12/2027		860 000	752 555	0,98

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Équipements médicaux, suite				
DH Europe Finance II S.à r.l., 0,45 %, 18/03/2028	EUR	780 000	671 761	0,87
			1 424 316	1,85
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 4,75 %, 21/09/2032		370 000	379 909	0,49
Glencore Capital Finance DAC, 1,125 %, 10/03/2028		440 000	375 471	0,49
			755 380	0,98
Gaz naturel - Distribution				
ENGIE S.A. , 4,25 %, 11/01/2043		100 000	100 773	0,13
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 0,75 %, 15/03/2029		860 000	707 489	0,92
APA Infrastructure Ltd., 2,5 %, 15/03/2036	GBP	890 000	704 799	0,91
			1 412 288	1,83
Réseaux et télécommunications				
Orange S.A., 1,375 %, 16/01/2030	EUR	400 000	350 042	0,45
Orange S.A., 3,625 %, 16/11/2031		700 000	709 221	0,92
			1 059 263	1,37
Pétrole				
Neste Oyj, 0,75 %, 25/03/2028		500 000	436 168	0,57
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
AIB Group PLC, 2,25 % jusqu'au 4/04/2027, FLR jusqu'au 4/04/2028		410 000	376 113	0,49
AIB Group PLC, 5,75 % jusqu'au 16/02/2028, FLR jusqu'au 16/02/2029		210 000	221 596	0,29
Alpha Bank, 4,25 %, 13/02/2030		400 000	339 720	0,44
Arion Banki HF, 4,875 %, 21/12/2024		440 000	434 059	0,56
Bank of Cyprus PCL, 2,5 % jusqu'au 24/06/2026, FLR jusqu'au 24/06/2027		270 000	226 340	0,29
Belfius Bank S.A., 5,25 %, 19/04/2033		300 000	300 341	0,39
CaixaBank S.A., 5,375 % jusqu'au 14/11/2029, FLR jusqu'au 14/11/2030		200 000	209 146	0,27
CaixaBank S.A., 6,875 % jusqu'au 25/10/2028, FLR jusqu'au 25/10/2033	GBP	200 000	228 032	0,30
Coöperatieve Rabobank U.A., 4,625 % jusqu'au 27/01/2030, FLR jusqu'au 27/01/2028	EUR	500 000	512 731	0,66
Deutsche Bank AG, 4,296 % jusqu'au 24/05/2023, FLR jusqu'au 24/05/2028	USD	200 000	179 844	0,23
Deutsche Bank AG, 4 % jusqu'au 24/06/2027, FLR jusqu'au 24/06/2032	EUR	400 000	369 243	0,48
Groupe des Assurances du Credit Mutuel, 1,85 % jusqu'au 21/04/2032, FLR jusqu'au 21/04/2042		300 000	225 120	0,29
Intesa Sanpaolo S.p.A., 2,625 %, 11/03/2036	GBP	180 000	142 003	0,18
Macquarie Group Ltd., 4,08 %, 31/05/2029		400 000	420 232	0,55
Macquarie Group Ltd., 0,95 %, 21/05/2031	EUR	880 000	676 873	0,88
Virgin Money UK PLC, 2,625 %, 19/08/2031	GBP	144 000	139 493	0,18
			5 000 886	6,48
Produits pharmaceutiques				
Roche Holdings, Inc., 2,076 %, 13/12/2031	USD	950 000	737 681	0,96
Imprimerie et édition				
Informa PLC, 3,125 %, 5/07/2026	GBP	168 000	177 886	0,23
Wolters Kluwer N.V., 0,75 %, 3/07/2030	EUR	740 000	608 807	0,79
			786 693	1,02
Immobilier - Distribution				
Hammerson Ireland Finance DAC, 1,75 %, 3/06/2027		236 000	192 254	0,25
WEA Finance LLC, 2,875 %, 15/01/2027	USD	330 000	266 645	0,34
			458 899	0,59
Produits chimiques spéciaux				
Covestro AG, 4,75 %, 15/11/2028	EUR	400 000	408 172	0,53
Hypermarchés				
ELO SACA, 4,875 %, 8/12/2028		500 000	481 250	0,62
Iceland Bondco PLC, 4,375 %, 15/05/2028	GBP	220 000	190 855	0,25
			672 105	0,87
Organismes supranationaux				
European Stability Mechanism, 1 %, 23/06/2027	EUR	3 040 000	2 811 416	3,64
European Stability Mechanism, 0,5 %, 5/03/2029		420 000	366 134	0,47

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Organismes supranationaux, suite				
European Stability Mechanism, 0,01 %, 15/10/2031	EUR	470 000	367 962	0,48
European Stability Mechanism, 1,8 %, 2/11/2046		700 000	554 101	0,72
			4 099 613	5,31
Télécommunications mobiles				
Cellnex Telecom S.A., 1,75 %, 23/10/2030		400 000	324 232	0,42
Vodafone Group PLC, 1,5 %, 24/07/2027		1 430 000	1 325 032	1,72
			1 649 264	2,14
Services téléphoniques				
Deutsche Telekom AG, 1,75 %, 25/03/2031		840 000	745 498	0,96
Deutsche Telekom AG, 1,375 %, 5/07/2034		550 000	438 414	0,57
			1 183 912	1,53
Tabac				
B.A.T. Capital Corp., 2,125 %, 15/08/2025	GBP	350 000	369 599	0,48
Imperial Brands Finance PLC, 1,375 %, 27/01/2025	EUR	760 000	726 462	0,94
			1 096 061	1,42
Transports - Services				
Autostrade per L'Italia S.p.A., 4,75 %, 24/01/2031		230 000	228 868	0,29
Holding d'Infrastructures de Transport, 1,475 %, 18/01/2031		800 000	655 200	0,85
Transurban Finance Co., 1,75 %, 29/03/2028		597 000	541 897	0,70
Transurban Finance Co., 1,45 %, 16/05/2029		420 000	367 922	0,48
			1 793 887	2,32
Services publics - Énergie électrique				
AusNet Services Holdings Pty Ltd., 0,625 %, 25/08/2030		1 040 000	818 613	1,06
Duke Energy Carolinas LLC, 2,85 %, 15/03/2032	USD	550 000	442 796	0,57
Duke Energy Corp., 5 %, 8/12/2027		500 000	467 427	0,60
E.ON SE, 3,875 %, 12/01/2035	EUR	190 000	188 594	0,24
Enel Finance International N.V., 2,25 %, 12/07/2031	USD	480 000	344 523	0,45
Enel S.p.A., 1,875 % jusqu'au 8/09/2030, FLR jusqu'au 8/03/2170	EUR	300 000	219 750	0,28
Florida Power & Light Co., 2,45 %, 3/02/2032	USD	930 000	738 005	0,96
National Grid Electricity Transmission PLC, 2 %, 17/04/2040	GBP	300 000	221 335	0,29
National Grid PLC, 3,875 %, 16/01/2029	EUR	450 000	451 149	0,58
National Grid PLC, 0,75 %, 1/09/2033		510 000	367 771	0,48
National Grid PLC, 4,275 %, 16/01/2035		160 000	159 525	0,21
Xcel Energy, Inc., 4,6 %, 1/06/2032	USD	810 000	737 711	0,96
			5 157 199	6,68
Services publics - Gaz				
EP Infrastructure A.S., 1,698 %, 30/07/2026	EUR	610 000	498 797	0,65
EP Infrastructure A.S., 2,045 %, 9/10/2028		360 000	269 073	0,35
			767 870	1,00
Total des obligations (coût identifié, 77 381 725 €)			73 509 013	95,25
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT				
Fonds communs de placement				
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 1,77 % (v) (coût identifié, 1 932 059 €)		1 932 059	1 932 059	2,51
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 79 313 784 €)			75 441 072	97,76

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES				
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5,25 %	EUR	4 240 000	25 701	0,03
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		2 180 000	16 857	0,02
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		3 050 000	23 584	0,03
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		1 640 000	12 681	0,02
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		1 020 000	7 887	0,01
Total des options de vente achetées (primes versées, 132 179 €)			86 710	0,11
Total des Options d'Achat Achetées				
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 5 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mars 2023 @ 4,75 %	EUR	2 370 000	55 027	0,07
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 5 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mars 2023 @ 4,75 %		2 370 000	55 027	0,07
iTraxx Europe Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 1 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Février 2023 @ 0,9 %		13 120 000	61 968	0,08
Total des Options d'Achat Achetées (primes versées, 74 192 €)			172 022	0,22
Total des investissements (coût identifié, 79 520 155 €)			75 699 804	98,09
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			1 472 497	1,91
ACTIF NET			77 172 301	100,00

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

MFS Meridian Funds - European Core Equity Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
MTU Aero Engines Holding AG	5 280	1 209 365	0,94
Rolls-Royce Holdings PLC	782 398	942 795	0,73
		2 152 160	1,67
Compagnies aériennes			
Aena S.A.	10 218	1 409 783	1,09
Ryanair Holdings PLC, ADR	9 079	756 033	0,59
		2 165 816	1,68
Boissons alcoolisées			
Carlsberg A.S., "B"	10 101	1 313 842	1,02
Diageo PLC	89 839	3 586 147	2,79
Heineken Holding N.V.	39 182	2 969 288	2,31
Pernod Ricard S.A.	19 644	3 738 647	2,90
		11 607 924	9,02
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	84 213	2 356 052	1,83
Compagnie Financiere Richemont S.A.	22 504	3 191 643	2,48
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	6 532	5 248 817	4,08
Swatch Group Ltd.	2 595	862 243	0,67
		11 658 755	9,06
Industrie automobile			
Aptiv PLC	13 047	1 357 205	1,06
Knorr-Bremse AG	20 388	1 226 542	0,95
		2 583 747	2,01

MFS Meridian Funds - European Core Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Radio-télévision			
WPP Group PLC	152 660	1 638 059	1,27
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Deutsche Boerse AG	7 770	1 277 117	0,99
IG Group Holdings PLC	167 520	1 515 719	1,18
London Stock Exchange Group PLC	13 138	1 107 195	0,86
Rathbones Group PLC	30 848	734 748	0,57
		4 634 779	3,60
Services aux entreprises			
Applus Services, S.A.	135 332	958 522	0,74
Brenntag AG	20 256	1 386 617	1,08
Compass Group PLC	50 207	1 101 071	0,85
Experian PLC	41 566	1 397 848	1,09
Hays PLC	770 396	1 081 904	0,84
Intertek Group PLC	26 247	1 297 689	1,01
		7 223 651	5,61
Logiciels			
Check Point Software Technologies Ltd.	5 641	660 015	0,51
Dassault Systemes SE	28 222	964 833	0,75
		1 624 848	1,26
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	20 494	1 185 867	0,92
Biens de consommation			
Beiersdorf AG	6 474	722 498	0,56
Essity AB	68 501	1 646 744	1,28
Reckitt Benckiser Group PLC	33 906	2 220 949	1,73
		4 590 191	3,57
Services de consommation			
Booking Holdings, Inc.	630	1 410 553	1,10
Équipements électriques			
Legrand S.A.	27 034	2 222 659	1,73
Schneider Electric SE	30 366	4 529 337	3,52
		6 751 996	5,25
Divertissement			
CTS Eventim AG	12 517	804 843	0,63
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	46 513	2 340 069	1,82
Nestlé S.A.	29 840	3 349 508	2,60
		5 689 577	4,42
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	13 792	1 972 411	1,53
Whitbread PLC	38 652	1 338 581	1,04
		3 310 992	2,57
Assurances			
Beazley PLC	189 008	1 429 094	1,11
Hiscox Ltd.	78 110	1 002 248	0,78
Willis Towers Watson PLC	7 959	1 860 919	1,44
		4 292 261	3,33
Internet			
Moneysupermarket.com Group PLC	280 525	759 673	0,59
Scout24 AG	19 035	1 016 088	0,79
		1 775 761	1,38
Loisirs et jouets			
Prosus N.V.	16 003	1 190 550	0,93
Machines et outils			
GEA Group AG	42 252	1 747 120	1,36

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2023

MFS Meridian Funds - European Core Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Grandes banques			
BNP Paribas	17 409	1 097 642	0,85
Erste Group Bank AG	71 566	2 493 561	1,94
ING Groep N.V.	113 590	1 508 061	1,17
UBS Group AG	91 523	1 792 520	1,39
		6 891 784	5,35
Équipements médicaux			
ConvaTec Group PLC	423 526	1 126 007	0,88
EssilorLuxottica	7 527	1 266 911	0,98
QIAGEN N.V.	25 307	1 129 957	0,88
Smith & Nephew PLC	40 840	517 165	0,40
Sonova Holding AG	2 506	576 289	0,45
		4 616 329	3,59
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Allfunds Group PLC	101 934	749 566	0,58
Julius Baer Group Ltd.	24 478	1 442 760	1,12
Jyske Bank A.S.	13 641	901 761	0,70
Sydbank A.S.	22 879	957 860	0,75
		4 051 947	3,15
Produits pharmaceutiques			
Bayer AG	45 662	2 605 238	2,02
Merck KGaA	21 514	4 114 516	3,20
Novo Nordisk A.S., "B"	18 923	2 410 454	1,87
Roche Holding AG	15 039	4 323 403	3,36
		13 453 611	10,45
Imprimerie et édition			
Wolters Kluwer N.V.	10 728	1 075 481	0,84
Immobilier			
Grand City Properties S.A.	45 176	441 931	0,34
LEG Immobilien SE	14 519	1 041 047	0,81
TAG Immobilien AG	72 705	572 601	0,44
Vonovia SE, REIT	87 446	2 262 228	1,76
		4 317 807	3,35
Produits chimiques spéciaux			
Akzo Nobel N.V.	29 252	2 001 374	1,55
Croda International PLC	25 723	2 016 205	1,57
L'Air Liquide S.A.	14 814	2 171 563	1,69
Linde PLC	14 458	4 372 117	3,40
Symrise AG	20 532	2 001 459	1,55
		12 562 718	9,76
Magasins spécialisés			
Hermes International	922	1 589 402	1,23
Télécommunications mobiles			
Cellnex Telecom S.A.	16 614	599 697	0,47
Total des actions ordinaires (coût identifié, 118 152 527 €)		127 198 226	98,83

	Prix d'exercice	Premier exercice			
WARRANTS					
Industrie de la confection					
Compagnie Financiere Richemont S.A. (1 action contre 2 warrants, Expiration 4/12/23) (coût identifié, 0 €)	CHF 67	20/11/23	45 698	48 669	0,04

MFS Meridian Funds - European Core Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT			
Fonds communs de placement			
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 1,77 % (v) (coût identifié, 889 402 €)	889 402	889 402	0,69
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 119 041 929 €) (k)		128 136 297	99,56
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		569 649	0,44
ACTIF NET		128 705 946	100,00

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

MFS Meridian Funds - European Research Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
MTU Aero Engines Holding AG	78 933	18 079 321	0,81
Rolls-Royce Holdings PLC	11 269 211	13 579 475	0,61
Thales S.A.	96 940	11 780 920	0,52
		43 439 716	1,94
Compagnies aériennes			
Ryanair Holdings PLC, ADR	233 641	19 455 929	0,87
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	1 312 413	52 388 222	2,34
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	692 569	19 376 204	0,86
Compagnie Financiere Richemont S.A.	282 126	40 012 685	1,79
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	119 233	95 810 202	4,28
		155 199 091	6,93
Industrie automobile			
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	831 123	24 261 563	1,08
Knorr-Bremse AG	162 394	9 769 623	0,44
		34 031 186	1,52
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Deutsche Boerse AG	193 557	31 814 023	1,42
Euronext N.V.	485 186	36 169 112	1,62
IG Group Holdings PLC	3 203 929	28 989 115	1,29
London Stock Exchange Group PLC	378 567	31 903 437	1,42
		128 875 687	5,75
Services aux entreprises			
Eurofins Scientific SE	295 532	19 496 137	0,87
Experian PLC	1 217 405	40 940 859	1,83
		60 436 996	2,70
Logiciels			
Dassault Systemes SE	370 311	12 659 927	0,56
SimCorp A/S	219 783	14 113 849	0,63
		26 773 776	1,19
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	387 500	22 422 338	1,00
Cancom SE	217 064	6 859 357	0,31
		29 281 695	1,31
Biens de consommation			
Reckitt Benckiser Group PLC	423 265	27 725 181	1,24
Équipements électriques			
Legrand S.A.	252 466	20 757 044	0,93

MFS Meridian Funds - European Research Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Équipements électriques, suite			
Schneider Electric SE	427 302	63 735 578	2,84
		84 492 622	3,77
Électronique			
ASML Holding N.V.	107 976	65 776 146	2,93
Énergie - Sociétés intégrées			
Aker BP ASA	632 281	17 720 309	0,79
Eni S.p.A.	2 033 857	28 853 385	1,29
Galp Energia SGPS S.A., "B"	1 692 497	21 283 150	0,95
TotalEnergies SE	954 381	54 539 964	2,43
		122 396 808	5,46
Énergie - Renouvelables			
Orsted A/S	231 840	19 008 409	0,85
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	359 269	18 074 823	0,81
Nestlé S.A. (g)	924 579	103 782 996	4,63
		121 857 819	5,44
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Ocado Group PLC	1 213 700	8 920 666	0,40
Tesco PLC	6 420 031	17 938 479	0,80
		26 859 145	1,20
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	250 338	35 801 150	1,60
Whitbread PLC	577 121	19 986 629	0,89
		55 787 779	2,49
Marchandises générales			
B&M European Value Retail S.A.	3 925 418	20 023 132	0,89
Assurances			
Beazley PLC	4 642 686	35 103 462	1,57
Hiscox Ltd.	1 819 981	23 352 609	1,04
Sampo OYJ, "A"	542 417	26 174 186	1,17
		84 630 257	3,78
Internet			
Scout24 AG	265 095	14 150 771	0,63
Machines et outils			
GEA Group AG	460 626	19 046 885	0,85
Schindler Holding AG	64 236	12 586 920	0,56
Weir Group PLC	533 129	10 797 369	0,48
		42 431 174	1,89
Grandes banques			
ABN AMRO Group N.V., GDR	1 874 807	28 557 248	1,27
Bank of Ireland Group PLC	2 712 210	26 611 041	1,19
BNP Paribas	833 716	52 566 017	2,34
NatWest Group PLC	10 178 542	35 621 722	1,59
UBS Group AG	1 884 064	36 900 248	1,65
		180 256 276	8,04
Équipements médicaux			
ConvaTec Group PLC	4 502 151	11 969 636	0,53
QIAGEN N.V.	560 455	25 024 316	1,12
		36 993 952	1,65
Métaux et exploitation minière			
Glencore PLC	5 556 054	34 313 212	1,53
Services pétroliers			
Tenaris S.A.	1 188 631	19 387 416	0,86
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Allfunds Group PLC	3 697 160	27 186 859	1,21

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2023

MFS Meridian Funds - European Research Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Prix d'exercice	Premier exercice	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite					
Autres banques et établissements financiers diversifiés, suite					
Julius Baer Group Ltd.			254 038	14 973 281	0,67
				42 160 140	1,88
Produits pharmaceutiques					
Bayer AG			451 971	25 787 130	1,15
Novartis AG			572 743	47 646 815	2,12
Roche Holding AG			266 312	76 559 224	3,42
Sanofi			470 313	42 511 236	1,90
				192 504 405	8,59
Imprimerie et édition					
Wolters Kluwer N.V.			430 918	43 199 508	1,93
Immobilier					
Big Yellow Group PLC, REIT			363 784	5 004 424	0,22
Safestore Holdings PLC, REIT			911 545	10 450 855	0,47
				15 455 279	0,69
Restaurants					
Sodexo			188 975	17 221 661	0,77
Produits chimiques spéciaux					
Akzo Nobel N.V.			271 004	18 541 647	0,83
Croda International PLC			313 461	24 569 514	1,09
Linde PLC			190 954	57 744 723	2,58
Symrise AG			254 571	24 815 581	1,11
				125 671 465	5,61
Magasins spécialisés					
Just Eat Takeaway			299 661	7 098 888	0,32
NEXT PLC			263 219	19 854 070	0,88
Zalando SE			240 747	10 269 154	0,46
				37 222 112	1,66
Télécommunications mobiles					
Cellnex Telecom S.A.			1 067 611	38 536 369	1,72
Services téléphoniques					
Wireless Infrastructure Italian S.p.A.			3 214 606	32 417 588	1,45
Tabac					
British American Tobacco PLC			1 403 280	49 365 103	2,20
Services publics - Énergie électrique					
E.ON SE			3 187 950	31 862 024	1,42
Iberdrola S.A.			3 626 883	39 012 556	1,74
National Grid PLC			2 590 720	30 311 867	1,36
				101 186 447	4,52
Total des actions ordinaires (coût identifié, 1 954 765 127 €)				2 200 912 474	98,22
WARRANTS					
Industrie de la confection					
Compagnie Financiere Richemont S.A. (1 action contre 2 warrants, Expiration 4/12/23) (coût identifié, 0 €)	CHF 67	20/11/23	858 960	914 810	0,04
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT					
Fonds communs de placement					
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 1,77 % (v) (coût identifié, 16 245 852 €)			16 245 852	16 245 852	0,73
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 1 971 010 979 €) (k)				2 218 073 136	98,99
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF				22 727 535	1,01
ACTIF NET				2 240 800 671	100,00

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

MFS Meridian Funds - European Smaller Companies Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
LISI Group	78 581	1 603 052	0,51
Compagnies aériennes			
Enav S.p.A.	987 730	4 187 226	1,35
Boissons alcoolisées			
Carlsberg A.S., "B"	39 932	5 193 975	1,67
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	87 186	2 439 228	0,78
Devro PLC	1 760 894	6 150 415	1,98
		8 589 643	2,76
Biotechnologies			
Probi AB	20 184	323 115	0,10
Radio-télévision			
4imprint Group PLC	41 064	2 132 786	0,69
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Euronext N.V.	37 005	2 758 608	0,89
Rathbones Group PLC	83 661	1 992 667	0,64
		4 751 275	1,53
Services aux entreprises			
Amadeus Fire AG	8 554	1 094 070	0,35
Bunzl PLC	110 872	3 743 587	1,20
Compass Group PLC	211 189	4 631 508	1,49
Gruppo Mutuionline S.p.A.	156 910	4 626 814	1,49
Intertek Group PLC	55 140	2 726 199	0,88
Johnson Service Group PLC	1 949 162	2 500 298	0,80
Karnov Group AB	841 440	4 460 373	1,43
RS Group PLC	483 550	5 181 635	1,67
		28 964 484	9,31
Produits chimiques			
Borregaard ASA	214 789	3 047 065	0,98
IMCD Group N.V.	31 561	4 604 091	1,48
		7 651 156	2,46
Logiciels			
Lectra	59 339	2 273 641	0,73
SimCorp A/S	13 511	867 639	0,28
		3 141 280	1,01
Logiciels - Systèmes			
Alten S.A.	6 035	851 353	0,27
Amadeus IT Group S.A.	59 128	3 421 388	1,10
Cancom SE	49 383	1 560 533	0,50
Kardex AG	16 493	2 956 742	0,95
		8 790 016	2,82
Construction			
Bellway PLC	80 583	1 948 567	0,63
Breedon Group PLC	11 272 153	8 756 245	2,81
Forterra PLC	2 605 452	6 308 142	2,03
Marshalls PLC	134 936	522 975	0,17
		17 535 929	5,64
Biens de consommation			
Essity AB	136 327	3 277 261	1,05
Henkel AG & Co. KGaA	26 557	1 629 831	0,52
Sarantis S.A.	450 657	3 470 059	1,12
		8 377 151	2,69
Conteneurs			
Elopak ASA	1 248 311	2 749 356	0,88
Mayr-Melnhof Karton AG	34 960	5 376 848	1,73

MFS Meridian Funds - European Smaller Companies Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Conteneurs, suite			
Vetropack Holding AG	136 064	5 762 260	1,85
Vidrala S.A.	56 841	5 273 130	1,70
Viscofan S.A.	57 866	3 429 722	1,10
		22 591 316	7,26
Équipements électriques			
Legrand S.A.	61 375	5 046 080	1,62
Électronique			
ASM International N.V.	4 084	1 273 331	0,41
Cembre S.p.A.	240 760	7 222 800	2,32
		8 496 131	2,73
Énergie - Sociétés intégrées			
Galp Energia SGPS S.A., "B"	520 961	6 551 085	2,10
Divertissement			
CTS Eventim AG	58 191	3 741 681	1,20
Alimentation et boissons			
Bakkafrost P/f	60 964	3 475 764	1,12
Cloetta AB, "B"	980 790	1 875 486	0,60
Cranswick PLC (g)	326 478	11 780 794	3,79
		17 132 044	5,51
Meubles et appareils			
Howden Joinery Group PLC	176 965	1 387 467	0,45
SEB S.A.	24 653	2 373 272	0,76
		3 760 739	1,21
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	13 116	1 875 735	0,60
Assurances			
Linea Directa Aseguradora S.A.	2 232 374	2 142 302	0,69
Unipol Gruppo S.p.A.	465 509	2 239 171	0,72
		4 381 473	1,41
Internet			
Auto Trader Group PLC	150 193	1 072 226	0,34
Moneysupermarket.com Group PLC	545 141	1 476 263	0,47
Rightmove PLC	254 132	1 700 437	0,55
Scout24 AG	27 235	1 453 804	0,47
		5 702 730	1,83
Machines et outils			
GEA Group AG	120 917	4 999 918	1,61
Rotork PLC	295 782	1 074 030	0,34
SIG Combibloc Group AG	70 415	1 606 107	0,52
Spirax-Sarco Engineering PLC	10 238	1 344 578	0,43
		9 024 633	2,90
Technologies et services médicaux et de santé			
Selcuk Ecza Deposu Ticaret ve Sanayi A.S.	2 124 771	4 021 259	1,29
Équipements médicaux			
ConvaTec Group PLC	967 685	2 572 734	0,83
Gerresheimer AG	120 350	8 156 804	2,62
Össur hf.	415 163	1 840 087	0,59
Paul Hartmann AG	833	194 922	0,06
Smith & Nephew PLC	317 289	4 017 895	1,29
Sonova Holding AG	12 632	2 904 900	0,94
		19 687 342	6,33
Gaz naturel - Distribution			
DCC PLC	77 088	4 039 731	1,30
Italgas S.p.A.	972 573	5 229 230	1,68
		9 268 961	2,98

MFS Meridian Funds - European Smaller Companies Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Produits pharmaceutiques			
BioGaia AB, "B"	58 861	475 900	0,15
Métaux et minéraux précieux			
Barrick Gold Corp.	149 074	2 681 565	0,86
Chemins de fer et transport maritime			
Irish Continental Group PLC	613 592	2 638 445	0,85
James Fisher & Sons PLC	125 473	521 909	0,17
		3 160 354	1,02
Immobilier			
Big Yellow Group PLC, REIT	86 922	1 195 750	0,38
Irish Residential Properties PLC, REIT	1 002 318	1 144 647	0,37
LEG Immobilien SE	65 855	4 721 962	1,52
Tritax Big Box PLC, REIT	1 000 053	1 775 223	0,57
Unite Group PLC, REIT	249 653	2 831 658	0,91
		11 669 240	3,75
Restaurants			
Greggs PLC	176 517	5 392 679	1,73
Sodexo	77 805	7 090 522	2,28
		12 483 201	4,01
Produits chimiques spéciaux			
Corticeira Amorim, SGPS S.A.	261 124	2 379 528	0,76
Croda International PLC	98 409	7 713 436	2,48
Essentra PLC	2 064 220	5 071 171	1,63
Symrise AG	112 732	10 989 115	3,53
		26 153 250	8,40
Magasins spécialisés			
Just Eat Takeaway	174 347	4 130 233	1,33
Télécommunications mobiles			
Cellnex Telecom S.A.	128 963	4 655 034	1,50
Total des actions ordinaires (coût identifié, 254 796 048 €)		287 931 074	92,53
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT			
Fonds communs de placement			
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 1,77 % (v) (coût identifié, 13 984 795 €)	13 987 387	13 987 388	4,49
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 268 780 843 €) (k)		301 918 462	97,02
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		9 261 968	2,98
ACTIF NET		311 180 430	100,00

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

MFS Meridian Funds - European Value Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Airbus SE	469 404	54 102 143	1,37
Safran S.A.	745 495	98 470 538	2,48
		152 572 681	3,85
Compagnies aériennes			
Ryanair Holdings PLC, ADR	600 693	50 021 360	1,26
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	2 432 655	97 105 462	2,45
Heineken N.V.	583 961	53 455 790	1,35

MFS Meridian Funds - European Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Boissons alcoolisées, suite			
Pernod Ricard S.A.	437 225	83 212 688	2,10
		233 773 940	5,90
Industrie de la confection			
Adidas AG	272 722	40 193 768	1,01
Burberry Group PLC	2 241 936	62 723 294	1,58
Compagnie Financiere Richemont S.A.	750 292	106 410 603	2,69
		209 327 665	5,28
Industrie automobile			
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	2 291 763	66 899 546	1,69
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Deutsche Boerse AG	370 580	60 910 433	1,54
Services aux entreprises			
Brenntag AG	507 978	34 773 436	0,88
Experian PLC	1 926 648	64 792 427	1,63
Intertek Group PLC	934 438	46 199 932	1,16
Rentokil Initial PLC	11 348 732	63 332 078	1,60
		209 097 873	5,27
Logiciels			
Dassault Systemes SE	1 782 485	60 938 317	1,54
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	2 056 780	119 013 722	3,00
Cancom SE	555 661	17 559 231	0,44
Temenos AG	342 925	22 554 459	0,57
		159 127 412	4,01
Construction			
CRH PLC	1 031 107	44 123 927	1,11
Biens de consommation			
Beiersdorf AG	356 894	39 829 370	1,00
L'Oréal S.A.	204 672	77 768 779	1,96
Reckitt Benckiser Group PLC	724 808	47 477 191	1,20
		165 075 340	4,16
Équipements électriques			
Legrand S.A.	1 195 618	98 300 345	2,48
Schneider Electric SE	869 678	129 719 567	3,27
Spectris PLC	1 180 273	43 025 614	1,09
		271 045 526	6,84
Électronique			
Infineon Technologies AG	2 587 486	85 167 102	2,15
Alimentation et boissons			
Nestlé S.A.	1 482 500	166 409 026	4,20
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	263 353	37 662 441	0,95
Assurances			
Aon PLC	191 184	56 042 404	1,41
Beazley PLC	4 232 588	32 002 701	0,81
Willis Towers Watson PLC	207 797	48 585 663	1,23
Zurich Insurance Group AG	203 847	92 735 670	2,34
		229 366 438	5,79
Machines et outils			
Aalberts Industries N.V.	951 212	41 398 977	1,05
CNH Industrial N.V.	2 409 085	39 019 981	0,99
GEA Group AG	1 096 634	45 345 816	1,14
Schindler Holding AG	209 073	40 967 451	1,03
Weir Group PLC	2 743 637	55 566 400	1,40
		222 298 625	5,61

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2023

MFS Meridian Funds - European Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Prix d'exercice	Premier exercice	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite					
Grandes banques					
Erste Group Bank AG			1 203 211	41 923 261	1,06
ING Groep N.V.			4 546 880	60 366 002	1,52
UBS Group AG			3 592 153	70 353 946	1,78
				172 643 209	4,36
Technologies et services médicaux et de santé					
Alcon, Inc.			823 129	57 090 454	1,44
ICON PLC			89 386	18 969 083	0,48
				76 059 537	1,92
Métaux et exploitation minière					
Anglo American PLC			1 322 776	52 446 917	1,32
Autres banques et établissements financiers diversifiés					
AIB Group PLC			15 383 336	59 217 091	1,49
Allfunds Group PLC			3 263 644	23 999 023	0,61
Julius Baer Group Ltd.			1 243 010	73 264 387	1,85
Jyske Bank A.S.			484 416	32 023 127	0,81
				188 503 628	4,76
Produits pharmaceutiques					
Bayer AG			1 069 101	60 997 380	1,54
Merck KGaA			214 940	41 106 912	1,04
Roche Holding AG			482 718	138 771 498	3,50
Sanofi			1 058 658	95 691 295	2,41
				336 567 085	8,49
Immobilier					
LEG Immobilien SE			391 346	28 060 448	0,71
Vonovia SE, REIT			1 249 405	32 322 108	0,81
				60 382 556	1,52
Restaurants					
Sodexo			461 169	42 027 233	1,06
Produits chimiques spéciaux					
Croda International PLC			678 710	53 198 244	1,34
Symrise AG			823 434	80 268 346	2,03
				133 466 590	3,37
Magasins spécialisés					
Zalando SE			1 041 680	44 433 252	1,12
Télécommunications mobiles					
Cellnex Telecom S.A.			2 314 107	83 529 752	2,11
Services publics - Énergie électrique					
E.ON SE			4 261 760	42 594 237	1,08
Iberdrola S.A.			9 962 773	107 164 538	2,70
RWE AG			1 254 950	51 201 960	1,29
				200 960 735	5,07
Total des actions ordinaires (coût identifié, 3 133 624 624 €)				3 814 838 146	96,25
ACTIONS PRIVILÉGIÉES					
Biens de consommation					
Henkel AG & Co. KGaA (coût identifié, 41 142 925 €)			558 043	36 496 012	0,92
WARRANTS					
Industrie de la confection					
Compagnie Financiere Richemont S.A. (1 action contre 2 warrants, Expiration 4/12/23) (coût identifié, 0 €)	CHF 67	20/11/23	2 382 326	2 537 226	0,06

MFS Meridian Funds - European Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT			
Fonds communs de placement			
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 1,77 % (v) (coût identifié, 91 002 128 €)	91 012 547	91 012 546	2,30
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 3 265 769 677 €) (k)		3 944 883 930	99,53
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		18 671 354	0,47
ACTIF NET		3 963 555 284	100,00

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

MFS Meridian Funds - Global Concentrated Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Honeywell International, Inc.	118 365	24 676 735	3,70
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	601 776	26 114 853	3,91
Industrie de la confection			
Compagnie Financiere Richemont S.A.	186 391	28 738 833	4,31
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	44 049	38 480 520	5,76
		67 219 353	10,07
Radio-télévision			
Walt Disney Co.	180 256	19 555 973	2,93
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	105 695	29 494 190	4,42
Télévision par câble			
Charter Communications, Inc., "A"	42 067	16 166 769	2,42
Comcast Corp., "A"	561 542	22 096 678	3,31
		38 263 447	5,73
Produits chimiques			
3M Co.	120 142	13 825 941	2,07
Logiciels			
Oracle Corp.	260 289	23 025 165	3,45
Biens de consommation			
Reckitt Benckiser Group PLC	282 675	20 129 780	3,02
Équipements électriques			
Legrand S.A.	258 778	23 130 209	3,47
Schneider Electric SE	201 346	32 649 731	4,89
		55 779 940	8,36
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	388 787	21 264 523	3,19
Nestlé S.A.	189 898	23 173 529	3,47
		44 438 052	6,66
Grandes banques			
Goldman Sachs Group, Inc.	77 435	28 326 497	4,24
Équipements médicaux			
Boston Scientific Corp.	545 751	25 240 984	3,78
Medtronic PLC	388 077	32 478 164	4,86
Thermo Fisher Scientific, Inc.	64 375	36 714 994	5,50
Waters Corp.	53 374	17 537 629	2,63
		111 971 771	16,77
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Visa, Inc., "A"	176 596	40 654 165	6,09

MFS Meridian Funds - Global Concentrated Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Prix d'exercice	Premier exercice	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite					
Produits pharmaceutiques					
Roche Holding AG			93 695	29 282 813	4,39
Chemins de fer et transport maritime					
Canadian National Railway Co.			237 057	28 231 118	4,23
Produits chimiques spéciaux					
Akzo Nobel N.V.			166 390	12 376 260	1,86
Linde PLC			79 062	25 992 074	3,89
				38 368 334	5,75
Transport par camion					
United Parcel Service, Inc., "B"			102 732	19 029 048	2,85
Total des actions ordinaires (coût identifié, 495 782 180 $)				658 387 175	98,64
WARRANTS					
Industrie de la confection					
Compagnie Financiere Richemont S.A. (1 action contre 2 warrants, Expiration 4/12/23) (coût identifié, 0 $)	CHF 67	20/11/23	626 024	724 834	0,11
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)					
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 9 288 000 $)		USD	9 288 000	9 288 000	1,39
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 505 070 180 $) (k)				668 400 009	100,14
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF				(910 310)	(0,14)
ACTIF NET				667 489 699	100,00

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

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Aérospatiale et défense				
Raytheon Technologies Corp., 2,82 %, 1/09/2051	USD	507 000	358 304	0,45
Compagnies aériennes				
EasyJet Finco B.V., 1,875 %, 3/03/2028	EUR	400 000	371 323	0,47
Boissons alcoolisées				
Pernod Ricard S.A., 3,75 %, 2/11/2032		100 000	110 776	0,14
Industrie de la confection				
Tapestry, Inc., 3,05 %, 15/03/2032	USD	385 000	315 580	0,40
Créances adossées à des actifs et titrisées				
AA Bond Co. Ltd., 3,25 %, 31/07/2028	GBP	460 000	453 314	0,57
RAC Bond Co. PLC, 4,87 %, 6/05/2026		200 000	231 836	0,29
			685 150	0,86
Industrie automobile				
Hyundai Capital America, 2 %, 15/06/2028	USD	612 000	518 778	0,65
Hyundai Capital America, 6,375 %, 8/04/2030		311 000	326 873	0,41
Mercedes-Benz Financial Services (Canada), 3 %, 23/02/2027	EUR	180 000	193 585	0,25
RENK AG, 5,75 %, 15/07/2025		310 000	328 504	0,41
			1 367 740	1,72
Radio-télévision				
Discovery, Inc., 4,125 %, 15/05/2029	USD	128 000	117 669	0,15
Prosus N.V., 2,085 %, 19/01/2030	EUR	250 000	221 236	0,28
Prosus N.V., 3,68 %, 21/01/2030	USD	220 000	190 300	0,24
Ubisoft Entertainment S.A., 0,878 %, 24/11/2027	EUR	200 000	163 904	0,20

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Radio-télévision, suite				
Warnermedia Holdings, Inc., 4,279 %, 15/03/2032	USD	499 000	444 087	0,56
			1 137 196	1,43
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Ameriprise Financial, Inc., 4,5 %, 13/05/2032		173 000	173 295	0,22
Low Income Investment Fund, 3,386 %, 1/07/2026		45 000	43 329	0,05
Low Income Investment Fund, 3,711 %, 1/07/2029		115 000	106 129	0,13
			322 753	0,40
Construction				
Holcim Sterling Finance (Netherlands) B.V., 2,25 %, 4/04/2034	GBP	260 000	237 072	0,30
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030	USD	336 000	307 020	0,38
			544 092	0,68
Services aux entreprises				
Euronet Worldwide, Inc., 1,375 %, 22/05/2026	EUR	320 000	309 557	0,39
Fiserv, Inc., 4,4 %, 1/07/2049	USD	267 000	229 177	0,29
Mastercard, Inc., 3,85 %, 26/03/2050		223 000	202 512	0,25
Visa, Inc., 4,15 %, 14/12/2035		66 000	65 220	0,08
Visa, Inc., 3,65 %, 15/09/2047		470 000	414 469	0,52
			1 220 935	1,53
Télévision par câble				
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 6,384 %, 23/10/2035		204 000	208 636	0,26
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 4,8 %, 1/03/2050		209 000	164 578	0,21
Comcast Corp., 3,75 %, 1/04/2040		237 000	209 437	0,26
SES S.A., 3,5 %, 14/01/2029	EUR	240 000	244 360	0,31
Time Warner Cable, Inc., 4,5 %, 15/09/2042	USD	72 000	57 265	0,07
			884 276	1,11
Produits chimiques				
Alpek SAB de C.V., 3,25 %, 25/02/2031		213 000	178 522	0,23
Arkema S.A., 3,5 %, 23/01/2031	EUR	100 000	106 294	0,13
			284 816	0,36
Logiciels				
Microsoft Corp., 2,525 %, 1/06/2050	USD	227 000	161 763	0,20
Microsoft Corp., 2,921 %, 17/03/2052		265 000	202 619	0,25
Microsoft Corp., 2,675 %, 1/06/2060		24 000	16 652	0,02
Microsoft Corp., 3,041 %, 17/03/2062		290 000	219 567	0,28
VeriSign, Inc., 4,75 %, 15/07/2027		137 000	135 812	0,17
			736 413	0,92
Logiciels - Systèmes				
Apple, Inc., 4,5 %, 23/02/2036		383 000	392 489	0,49
Conglomérats				
ABB Finance B.V., 3,25 %, 16/01/2027	EUR	100 000	108 945	0,14
ABB Finance B.V., 3,375 %, 16/01/2031		120 000	129 252	0,16
Grupo KUO S.A.B. de C.V., 5,75 %, 7/07/2027	USD	469 000	444 687	0,56
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		401 000	407 101	0,51
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,95 %, 15/09/2028		770 000	764 869	0,96
			1 854 854	2,33
Biens de consommation				
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 3 %, 26/06/2027		464 000	438 167	0,55
Services de consommation				
Booking Holdings, Inc., 4,75 %, 15/11/2034	EUR	106 000	122 494	0,16
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPFG, 0 %, 15/02/2027	USD	194 000	146 206	0,18
			268 700	0,34
Équipements électriques				
Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1,125 %, 8/02/2027	EUR	430 000	407 872	0,51

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Équipements électriques, suite				
Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1 %, 26/05/2029	EUR	560 000	476 508	0,60
			884 380	1,11
Électronique				
Broadcom, Inc., 3,469 %, 15/04/2034	USD	140 000	116 078	0,15
Broadcom, Inc., 3,137 %, 15/11/2035		341 000	264 737	0,33
			380 815	0,48
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Airport Authority Hong Kong, 3,25 %, 12/01/2052		307 000	237 470	0,30
Ceske Drahy A.S. (République tchèque), 5,625 %, 12/10/2027	EUR	430 000	480 524	0,60
CEZ A.S. (République tchèque), 2,375 %, 6/04/2027		290 000	294 718	0,37
Huarong Finance 2017 Co. Ltd. (République populaire de Chine), 4,95 %, 7/11/2047	USD	270 000	192 328	0,24
Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd., 4,25 %, 27/07/2027		309 000	301 646	0,38
MDGH - GMTN RSC Ltd. (Émirats arabes unis), 2,5 %, 7/11/2024		469 000	449 322	0,56
MDGH - GMTN RSC Ltd. (Émirats arabes unis), 2,5 %, 3/06/2031		470 000	403 894	0,51
Ooredoo International Finance Ltd. (État du Qatar), 2,625 %, 8/04/2031		470 000	412 021	0,52
PT Pertamina (Persero) (République d'Indonésie), 3,65 %, 30/07/2029		401 000	369 978	0,46
Qatar Petroleum, 2,25 %, 12/07/2031		470 000	399 213	0,50
Qatar Petroleum, 3,125 %, 12/07/2041		213 000	168 566	0,21
			3 709 680	4,65
Obligations souveraines des marchés émergents				
État du Qatar, 4 %, 14/03/2029		200 000	199 179	0,25
État du Qatar, 4,4 %, 16/04/2050		200 000	188 826	0,23
États-Unis du Mexique, 2,659 %, 24/05/2031		1 016 000	851 627	1,07
			1 239 632	1,55
Énergie - Sociétés indépendantes				
Energean Israel Finance Ltd., 4,875 %, 30/03/2026		140 000	130 725	0,16
Énergie - Sociétés intégrées				
BP Capital Markets PLC, 3,625 % jusqu'au 22/06/2029, FLR jusqu'au 22/06/2170	EUR	210 000	202 033	0,25
Galp Energia SGPS S.A., 2 %, 15/01/2026		300 000	305 741	0,38
MOL PLC, 1,5 %, 8/10/2027		170 000	155 564	0,20
			663 338	0,83
Ingénierie - Construction				
Bouygues S.A., 4,625 %, 7/06/2032		100 000	116 910	0,15
Divertissement				
Carnival Corp., 7,625 %, 1/03/2026		130 000	127 253	0,16
Royal Caribbean Cruises Ltd., 4,25 %, 1/07/2026	USD	232 000	201 260	0,25
			328 513	0,41
Établissements financiers				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,65 %, 21/07/2027		892 000	828 795	1,04
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,3 %, 30/01/2032		150 000	125 941	0,16
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,85 %, 29/10/2041		150 000	117 021	0,15
Avolon Holdings Funding Ltd., 5,25 %, 15/05/2024		107 000	105 714	0,13
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,25 %, 15/04/2026		63 000	59 827	0,07
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,375 %, 1/05/2026		422 000	401 059	0,50
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,528 %, 18/11/2027		184 000	158 793	0,20
CTP N.V., 0,875 %, 20/01/2026	EUR	300 000	275 413	0,35
CTP N.V., 1,5 %, 27/09/2031		420 000	309 586	0,39
EXOR N.V., 0,875 %, 19/01/2031		220 000	186 837	0,23
Grand City Properties S.A., 2,5 % jusqu'au 24/10/2023, FLR jusqu'au 24/10/2069		400 000	213 081	0,27
Logicor Financing S.à r.l., 1,625 %, 17/01/2030		350 000	289 671	0,36
Logicor Financing S.à r.l., 0,875 %, 14/01/2031		130 000	96 432	0,12
P3 Group S.à r.l., 0,875 %, 26/01/2026		420 000	399 202	0,50
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 1,75 %, 14/01/2025		500 000	487 051	0,61
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,875 % jusqu'au 30/01/2027, FLR jusqu'au 30/01/2171		890 000	369 126	0,46
VGP N.V., 1,5 %, 8/04/2029		300 000	222 395	0,28

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Établissements financiers, suite				
Vonovia SE, REIT, 1,625 %, 1/09/2051	EUR	300 000	172 522	0,22
			4 818 466	6,04
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4,375 %, 15/04/2038	USD	29 000	27 503	0,03
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 5,55 %, 23/01/2049		284 000	304 597	0,38
Bacardi Ltd., 5,15 %, 15/05/2038		369 000	361 686	0,45
Constellation Brands, Inc., 3,15 %, 1/08/2029		153 000	139 618	0,18
Constellation Brands, Inc., 2,25 %, 1/08/2031		859 000	708 746	0,89
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3 %, 2/02/2029		230 000	197 420	0,25
Kraft Heinz Foods Co., 3,875 %, 15/05/2027		421 000	410 140	0,52
PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, 3,398 %, 9/06/2031		494 000	425 457	0,53
			2 575 167	3,23
Jeux et hôtellerie				
Marriott International, Inc., 2,85 %, 15/04/2031		244 000	207 674	0,26
VICI Properties LP, REIT, 4,95 %, 15/02/2030		595 000	575 394	0,72
			783 068	0,98
Industrie				
CPI Property Group S.A., 3,75 % jusqu'au 27/07/2028, FLR jusqu'au 27/01/2170	EUR	380 000	196 411	0,25
Trustees of the University of Pennsylvania, 2,396 %, 1/10/2050	USD	176 000	119 904	0,15
			316 315	0,40
Assurances				
AIA Group Ltd., 0,88 % jusqu'au 9/09/2028, FLR jusqu'au 9/09/2033	EUR	560 000	491 013	0,61
Argentum Netherlands B.V., 5,125 %, 1/06/2048	USD	210 000	198 664	0,25
ASR Nederland N.V., 7 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2043	EUR	280 000	323 640	0,41
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042	USD	91 000	78 966	0,10
Equitable Holdings, Inc., 5,594 %, 11/01/2033		352 000	360 395	0,45
			1 452 678	1,82
Assurances - Santé				
UnitedHealth Group, Inc., 5,3 %, 15/02/2030		334 000	351 174	0,44
UnitedHealth Group, Inc., 4,625 %, 15/07/2035		524 000	529 218	0,66
			880 392	1,10
Assurances IARD				
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 2,6 %, 2/12/2031		184 000	156 007	0,20
Marsh & McLennan Cos., Inc., 2,25 %, 15/11/2030		521 000	440 460	0,55
QBE Insurance Group Ltd., 2,5 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2038	GBP	230 000	221 020	0,28
			817 487	1,03
Obligations quasi souveraines du marché international				
Caixa Geral de Depositos S.A. (République portugaise), 5,75 %, 31/10/2028	EUR	200 000	226 458	0,29
Electricite de France S.A., 2,875 % jusqu'au 15/03/2027, FLR jusqu'au 15/03/2070		400 000	371 806	0,47
EnBW International Finance B.V., 3,5 %, 24/07/2028		230 000	247 897	0,31
EnBW International Finance B.V., 4,049 %, 22/11/2029		80 000	88 404	0,11
La Banque Postale S.A., 4,375 %, 17/01/2030		300 000	327 154	0,41
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties, 2,5 %, 15/10/2031	USD	287 000	225 333	0,28
RTE Reseau de Transport d'Electricite, 0,75 %, 12/01/2034	EUR	200 000	162 596	0,20
			1 649 648	2,07
Obligations souveraines du marché international				
Gouvernement des Bermudes, 2,375 %, 20/08/2030	USD	200 000	171 000	0,22
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		200 000	200 807	0,25
			371 807	0,47
Autorités locales				
Province de l'Alberta, 4,5 %, 1/12/2040	CAD	70 000	55 782	0,07
Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18/06/2050		275 000	172 285	0,22
			228 067	0,29
Machines et outils				
CNH Industrial Capital LLC, 1,875 %, 15/01/2026	USD	401 000	371 219	0,46

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Machines et outils, suite				
Sarens Finance Co. N.V., 5,75 %, 21/02/2027	EUR	185 000	164 435	0,21
			535 654	0,67
Grandes banques				
Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 2,57 % jusqu'au 25/11/2030, FLR jusqu'au 25/11/2035	USD	325 000	250 643	0,32
Banco de Sabadell S.A., 5,25 % jusqu'au 7/02/2028, FLR jusqu'au 7/02/2029	EUR	200 000	217 272	0,27
Banco de Sabadell S.A., 5 % jusqu'au 19/11/2027, FLR jusqu'au 19/02/2170		200 000	183 024	0,23
Bank of America Corp., 3,5 %, 19/04/2026	USD	480 000	467 038	0,59
Bank of America Corp., 2,687 % jusqu'au 22/04/2031, FLR jusqu'au 22/04/2032		872 000	736 188	0,92
Bank of Ireland Group PLC, 4,875 % jusqu'au 16/07/2027, FLR jusqu'au 16/07/2028	EUR	100 000	110 373	0,14
Barclays Bank PLC, 8,407 % jusqu'au 14/11/2027, FLR jusqu'au 14/11/2032	GBP	115 000	152 546	0,19
BNP Paribas S.A., 3,875 %, 10/01/2031	EUR	300 000	330 287	0,41
Commonwealth Bank of Australia, 2,688 %, 11/03/2031	USD	479 000	385 101	0,48
Crédit Agricole Group, 3,875 %, 28/11/2034	EUR	200 000	217 311	0,27
Credit Suisse AG (London), 2,125 %, 31/05/2024		200 000	209 673	0,26
Credit Suisse Group AG, 7,75 % jusqu'au 1/03/2028, FLR jusqu'au 1/03/2029		185 000	209 117	0,26
Danske Bank A.S., 4,125 % jusqu'au 10/01/2030, FLR jusqu'au 10/01/2031		310 000	337 664	0,42
Goldman Sachs Group, Inc., 2,383 % jusqu'au 21/07/2031, FLR jusqu'au 21/07/2032	USD	405 000	331 613	0,42
Goldman Sachs Group, Inc., 3,436 % jusqu'au 24/02/2042, FLR jusqu'au 24/02/2043		340 000	273 490	0,34
HSBC Holdings PLC, 2,099 % jusqu'au 4/06/2025, FLR jusqu'au 4/06/2026		465 000	430 969	0,54
JPMorgan Chase & Co., 1,47 % jusqu'au 22/09/2026, FLR jusqu'au 22/09/2027		217 000	192 240	0,24
JPMorgan Chase & Co., 1,953 % jusqu'au 4/02/2031, FLR jusqu'au 4/02/2032		277 000	222 601	0,28
JPMorgan Chase & Co., 4,26 %, 22/02/2048		44 000	39 551	0,05
JPMorgan Chase & Co., 3,109 % jusqu'au 22/04/2050, FLR jusqu'au 22/04/2051		1 332 000	974 272	1,22
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2,494 % jusqu'au 13/10/2031, FLR jusqu'au 13/10/2032		200 000	163 034	0,21
Morgan Stanley, 3,125 %, 27/07/2026		150 000	142 164	0,18
Morgan Stanley, 1,593 % jusqu'au 4/05/2026, FLR jusqu'au 4/05/2027		707 000	634 893	0,80
Morgan Stanley, 3,622 % jusqu'au 1/04/2030, FLR jusqu'au 1/04/2031		233 000	214 318	0,27
Nationwide Building Society, 6,178 % jusqu'au 7/12/2026, FLR jusqu'au 7/12/2027	GBP	100 000	127 554	0,16
NatWest Markets PLC, 6,375 %, 8/11/2027		127 000	165 221	0,21
Société Générale S.A., 4,25 %, 6/12/2030	EUR	200 000	215 359	0,27
Standard Chartered PLC, 0,8 % jusqu'au 17/11/2028, FLR jusqu'au 17/11/2029		200 000	179 923	0,23
TD Bank, 5,288 %, 11/01/2028	GBP	100 000	126 424	0,16
Toronto-Dominion Bank, 4,108 %, 8/06/2027	USD	417 000	410 197	0,52
UBS Group AG, 4,375 % jusqu'au 11/01/2030, FLR jusqu'au 11/01/2031	EUR	270 000	297 914	0,37
UBS Group AG, 2,746 % jusqu'au 11/02/2032, FLR jusqu'au 11/02/2033	USD	610 000	501 981	0,63
Unicaja Banco S.A., 1 % jusqu'au 1/12/2025, FLR jusqu'au 1/12/2026	EUR	300 000	293 690	0,37
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026	USD	430 000	390 100	0,49
Wells Fargo & Co., 3,35 % jusqu'au 2/03/2032, FLR jusqu'au 2/03/2033		1 106 000	975 273	1,22
			11 109 018	13,94
Technologies et services médicaux et de santé				
Alcon Finance B.V., 2,375 %, 31/05/2028	EUR	180 000	182 923	0,23
Alcon Finance Corp., 3,8 %, 23/09/2049	USD	464 000	380 118	0,48
Becton, Dickinson and Co., 4,298 %, 22/08/2032		135 000	131 780	0,16
HCA, Inc., 5,25 %, 15/06/2026		148 000	148 173	0,19
HCA, Inc., 5,125 %, 15/06/2039		210 000	197 940	0,25
New York Society for the Relief of the Ruptured & Crippled, 2,667 %, 1/10/2050		350 000	231 447	0,29
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 6,015 %, 15/11/2048		102 000	100 633	0,13
Thermo Fisher Scientific (Finance I) Co., 2 %, 18/10/2051	EUR	260 000	186 826	0,23
Thermo Fisher Scientific, Inc., 1,75 %, 15/10/2028	USD	187 000	162 967	0,20
			1 722 807	2,16
Équipements médicaux				
Boston Scientific Corp., 0,625 %, 1/12/2027	EUR	250 000	237 832	0,30
DH Europe Finance II S.à r.l., 0,45 %, 18/03/2028		250 000	234 072	0,29

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 5,625 %, 1/04/2030	USD	464 000	478 443	0,60
Anglo American Capital PLC, 4,75 %, 21/09/2032	EUR	150 000	167 440	0,21
Glencore Capital Finance DAC, 1,125 %, 10/03/2028		440 000	408 194	0,51
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031	USD	423 000	362 282	0,46
			1 416 359	1,78
Secteur intermédiaire				
Enbridge, Inc., 5,375 %, 27/09/2077	CAD	450 000	316 226	0,40
Energy Transfer LP, 5,55 %, 15/02/2028	USD	170 000	172 759	0,22
Energy Transfer LP, 7,125 % jusqu'au 15/05/2030, FLR jusqu'au 15/05/2171		264 000	241 164	0,30
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 2,16 %, 31/03/2034		434 590	374 985	0,47
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp., 3,55 %, 15/12/2029		554 000	498 265	0,63
Sabine Pass Liquefaction LLC, 5 %, 15/03/2027		281 000	281 519	0,35
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,2 %, 15/03/2028		60 000	58 149	0,07
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,5 %, 15/05/2030		412 000	399 926	0,50
Targa Resources Corp., 4,2 %, 1/02/2033		40 000	36 250	0,05
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		243 000	208 067	0,26
			2 587 310	3,25
Obligations municipales				
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Subordinate Rev., Taxable, "A", 2,641 %, 1/07/2037		155 000	142 103	0,18
Michigan Finance Authority Hospital Rev., Taxable (Trinity Health Credit Group), 3,384 %, 1/12/2040		270 000	229 083	0,28
Oklahoma Development Finance Authority, Health System Rev., Taxable (OU Medicine Project), C, 5,45 %, 15/08/2028		154 000	126 071	0,16
			497 257	0,62
Gaz naturel - Distribution				
ENGIE S.A. , 4,25 %, 11/01/2043	EUR	100 000	109 555	0,14
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 0,75 %, 15/03/2029		300 000	268 307	0,34
APA Infrastructure Ltd., 2,5 %, 15/03/2036	GBP	360 000	309 933	0,39
			578 240	0,73
Réseaux et télécommunications				
AT&T, Inc., 3,5 %, 15/09/2053	USD	255 000	188 176	0,24
Orange S.A., 3,625 %, 16/11/2031	EUR	300 000	330 441	0,41
Verizon Communications, Inc., 2,1 %, 22/03/2028	USD	172 000	153 391	0,19
Verizon Communications, Inc., 2,55 %, 21/03/2031		606 000	517 249	0,65
			1 189 257	1,49
Pétrole				
Neste Oyj, 0,75 %, 25/03/2028	EUR	300 000	284 508	0,36
Puma International Financing S.A., 5 %, 24/01/2026	USD	259 000	238 306	0,30
			522 814	0,66
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
AIB Group PLC, 5,75 % jusqu'au 16/02/2028, FLR jusqu'au 16/02/2029	EUR	210 000	240 908	0,30
Alpha Bank, 4,25 %, 13/02/2030		450 000	415 493	0,52
Arion Banki HF, 4,875 %, 21/12/2024		450 000	482 612	0,60
Bank of Cyprus PCL, 2,5 % jusqu'au 24/06/2026, FLR jusqu'au 24/06/2027		260 000	236 952	0,30
Belfius Bank S.A., 5,25 %, 19/04/2033		300 000	326 516	0,41
BPCE S.A., 2,277 % jusqu'au 20/01/2031, FLR jusqu'au 20/01/2032	USD	400 000	315 658	0,40
CaixaBank S.A., 5,375 % jusqu'au 14/11/2029, FLR jusqu'au 14/11/2030	EUR	100 000	113 687	0,14
CaixaBank S.A., 6,875 % jusqu'au 25/10/2028, FLR jusqu'au 25/10/2033	GBP	200 000	247 905	0,31
Deutsche Bank AG, 4 % jusqu'au 24/06/2027, FLR jusqu'au 24/06/2032	EUR	200 000	200 711	0,25
Groupe BPCE S.A., 4,5 %, 15/03/2025	USD	464 000	451 785	0,57
Groupe des Assurances du Credit Mutuel, 1,85 % jusqu'au 21/04/2032, FLR jusqu'au 21/04/2042	EUR	300 000	244 739	0,31
Intesa Sanpaolo S.p.A., 2,625 %, 11/03/2036	GBP	480 000	411 675	0,52
Macquarie Group Ltd., 4,08 %, 31/05/2029		390 000	445 434	0,56
Virgin Money UK PLC, 5,125 % jusqu'au 11/12/2025, FLR jusqu'au 11/12/2030		220 000	257 952	0,32
			4 392 027	5,51

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Lutte contre la pollution				
Waste Connections, Inc., 4,2 %, 15/01/2033	USD	167 000	162 232	0,20
Imprimerie et édition				
Informa PLC, 3,125 %, 5/07/2026	GBP	168 000	193 389	0,24
Chemins de fer et transport maritime				
Canadian Pacific Railway Co., 2,45 %, 2/12/2031	USD	357 000	308 297	0,39
Immobilier - Bureaux				
Corporate Office Property LP, REIT, 2,25 %, 15/03/2026		81 000	73 305	0,09
Corporate Office Property LP, REIT, 2 %, 15/01/2029		443 000	351 270	0,44
Corporate Office Property LP, REIT, 2,75 %, 15/04/2031		235 000	183 422	0,23
			607 997	0,76
Immobilier - Autres				
EPR Properties, REIT, 3,6 %, 15/11/2031		283 000	218 781	0,27
Lexington Realty Trust Co., 2,7 %, 15/09/2030		312 000	257 681	0,32
W.P. Carey, Inc., REIT, 2,4 %, 1/02/2031		452 000	378 998	0,48
			855 460	1,07
Immobilier - Distribution				
Brixmor Operating Partnership LP, REIT, 4,05 %, 1/07/2030		298 000	272 537	0,34
Hammerson Ireland Finance DAC, 1,75 %, 3/06/2027	EUR	220 000	194 839	0,25
Regency Centers Corp., 3,7 %, 15/06/2030	USD	129 000	116 833	0,15
STORE Capital Corp., REIT, 2,75 %, 18/11/2030		439 000	343 045	0,43
WEA Finance LLC, 2,875 %, 15/01/2027		320 000	281 099	0,35
			1 208 353	1,52
Distribution				
AutoZone, Inc., 4,75 %, 1/08/2032		173 000	173 001	0,22
Home Depot, Inc., 4,875 %, 15/02/2044		396 000	403 032	0,51
Home Depot, Inc., 3,625 %, 15/04/2052		177 000	147 616	0,18
			723 649	0,91
Produits chimiques spéciaux				
Covestro AG, 4,75 %, 15/11/2028	EUR	200 000	221 872	0,28
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,832 %, 15/10/2027	USD	290 000	250 963	0,31
			472 835	0,59
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		376 000	307 651	0,39
Hypermarchés				
ELO SACA, 4,875 %, 8/12/2028	EUR	300 000	313 915	0,39
Iceland Bondco PLC, 4,375 %, 15/05/2028	GBP	210 000	198 057	0,25
			511 972	0,64
Organismes supranationaux				
European Stability Mechanism, 1 %, 23/06/2027	EUR	1 160 000	1 166 270	1,46
European Stability Mechanism, 0,5 %, 5/03/2029		820 000	777 131	0,98
European Stability Mechanism, 0,01 %, 15/10/2031		1 820 000	1 549 053	1,94
International Bank for Reconstruction and Development, 4,25 %, 24/06/2025	AUD	75 000	53 525	0,07
			3 545 979	4,45
Télécommunications mobiles				
Cellnex Telecom S.A., 1,75 %, 23/10/2030	EUR	400 000	352 489	0,44
Crown Castle, Inc., REIT, 3,7 %, 15/06/2026	USD	198 000	191 027	0,24
Rogers Communications, Inc., 3,8 %, 15/03/2032		285 000	256 536	0,32
Rogers Communications, Inc., 3,7 %, 15/11/2049		370 000	274 937	0,35
T-Mobile USA, Inc., 3,875 %, 15/04/2030		562 000	526 359	0,66
			1 601 348	2,01
Services téléphoniques				
Deutsche Telekom AG, 1,375 %, 5/07/2034	EUR	350 000	303 305	0,38
TELUS Corp., 2,85 %, 13/11/2031	CAD	630 000	410 145	0,51
			713 450	0,89

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Tabac				
B.A.T. Capital Corp., 2,125 %, 15/08/2025	GBP	360 000	413 290	0,52
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 17/11/2027	USD	160 000	163 525	0,20
			576 815	0,72
Transports - Services				
Autostrade per L'Italia S.p.A., 4,75 %, 24/01/2031	EUR	215 000	232 587	0,29
ERAC USA Finance LLC, 7 %, 15/10/2037	USD	143 000	166 305	0,21
Holding d'Infrastructures de Transport, 1,475 %, 18/01/2031	EUR	400 000	356 151	0,45
Transurban Finance Co., 1,45 %, 16/05/2029		250 000	238 087	0,30
Triton International Ltd., 3,15 %, 15/06/2031	USD	320 000	257 271	0,32
			1 250 401	1,57
Services publics - Énergie électrique				
American Transmission Systems, Inc., 2,65 %, 15/01/2032		85 000	72 357	0,09
Bruce Power LP, 2,68 %, 21/12/2028	CAD	610 000	416 861	0,52
E.ON SE, 3,875 %, 12/01/2035	EUR	180 000	194 239	0,24
Enel Finance International N.V., 2,25 %, 12/07/2031	USD	400 000	312 123	0,39
Enel Finance International N.V., 4,75 %, 25/05/2047		464 000	395 524	0,50
Enel S.p.A., 2,25 % jusqu'au 10/03/2027, FLR jusqu'au 10/03/2070	EUR	220 000	207 387	0,26
Enel S.p.A., 1,875 % jusqu'au 8/09/2030, FLR jusqu'au 8/03/2170		275 000	218 993	0,28
Evergy, Inc., 2,9 %, 15/09/2029	USD	590 000	524 686	0,66
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		286 000	242 039	0,30
National Grid Electricity Transmission PLC, 2 %, 17/04/2040	GBP	340 000	272 707	0,34
National Grid PLC, 3,875 %, 16/01/2029	EUR	160 000	174 388	0,22
National Grid PLC, 4,275 %, 16/01/2035		150 000	162 588	0,20
Southern California Edison Co., 3,65 %, 1/02/2050	USD	375 000	294 782	0,37
Virginia Electric & Power Co., 3,5 %, 15/03/2027		130 000	125 419	0,16
Virginia Electric & Power Co., 2,875 %, 15/07/2029		446 000	404 568	0,51
Xcel Energy, Inc., 4,6 %, 1/06/2032		132 000	130 697	0,16
			4 149 358	5,20
Services publics - Gaz				
EP Infrastructure A.S., 1,698 %, 30/07/2026	EUR	380 000	337 806	0,42
EP Infrastructure A.S., 2,045 %, 9/10/2028		200 000	162 512	0,21
			500 318	0,63
Total des obligations (coût identifié, 85 413 596 $)			**75 462 358**	**94,67**
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 2 734 000 $)	USD	2 734 000	2 734 000	3,43
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 88 147 596 $)			**78 196 358**	**98,10**

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES				
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5,25 %	EUR	4 030 000	26 557	0,03
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		2 080 000	17 485	0,02
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		2 920 000	24 547	0,03
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		1 560 000	13 114	0,02
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		970 000	8 154	0,01
Total des options de vente achetées (primes versées, 136 201 $)			**89 857**	**0,11**
Total des Options d'Achat Achetées				
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 5 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mars 2023 @ 4,75 %	EUR	2 290 000	57 804	0,07
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 5 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mars 2023 @ 4,75 %		2 280 000	57 551	0,07
iTraxx Europe Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 1 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Février 2023 @ 0,9 %		13 320 000	68 395	0,09
Total des Options d'Achat Achetées (primes versées, 75 637 $)			**183 750**	**0,23**
Total des investissements (coût identifié, 88 359 434 $)			**78 469 965**	**98,44**
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			**1 245 930**	**1,56**
ACTIF NET			**79 715 895**	**100,00**

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

MFS Meridian Funds - Global Equity Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Honeywell International, Inc.	355 127	74 036 877	2,15
MTU Aero Engines Holding AG	71 632	17 836 933	0,52
Rolls-Royce Holdings PLC	13 417 206	17 576 854	0,51
		109 450 664	3,18
Compagnies aériennes			
Aena S.A.	188 836	28 324 399	0,82
Boissons alcoolisées			
Carlsberg A.S., "B"	129 183	18 267 273	0,53
Diageo PLC	1 683 435	73 054 856	2,13
Heineken N.V.	519 430	51 692 500	1,50
Pernod Ricard S.A.	245 913	50 881 001	1,48
		193 895 630	5,64
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	988 584	30 068 296	0,87
Compagnie Financiere Richemont S.A.	376 097	57 988 791	1,69
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	100 710	87 978 687	2,56
		176 035 774	5,12
Industrie automobile			
Aptiv PLC	127 516	14 420 784	0,42
Radio-télévision			
Omnicom Group, Inc.	116 632	10 029 186	0,29
Walt Disney Co.	426 825	46 306 244	1,35
WPP Group PLC	2 047 088	23 879 787	0,69
		80 215 217	2,33

MFS Meridian Funds - Global Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Charles Schwab Corp.	747 456	57 868 044	1,68
Deutsche Boerse AG	100 955	18 039 610	0,53
London Stock Exchange Group PLC	216 946	19 876 319	0,58
		95 783 973	2,79
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	272 959	76 169 209	2,22
Adecco S.A.	225 163	8 350 154	0,24
Brenntag AG	208 681	15 530 134	0,45
Cognizant Technology Solutions Corp., "A"	515 109	34 383 526	1,00
Compass Group PLC	784 831	18 711 855	0,54
Equifax, Inc.	175 682	39 036 540	1,14
Fidelity National Information Services, Inc.	535 789	40 205 607	1,17
Fiserv, Inc.	458 931	48 958 759	1,42
PayPal Holdings, Inc.	167 731	13 668 399	0,40
		295 014 183	8,58
Télévision par câble			
Comcast Corp., "A"	2 110 063	83 030 979	2,41
Produits chimiques			
3M Co.	270 993	31 185 874	0,91
PPG Industries, Inc.	280 323	36 537 300	1,06
		67 723 174	1,97
Logiciels			
Check Point Software Technologies Ltd.	278 376	35 409 427	1,03
Oracle Corp.	710 310	62 834 023	1,83
		98 243 450	2,86
Logiciels - Systèmes			
Samsung Electronics Co. Ltd.	661 983	33 088 491	0,96
Construction			
Otis Worldwide Corp.	247 291	20 334 739	0,59
Biens de consommation			
Colgate-Palmolive Co.	245 776	18 317 685	0,53
Essity AB	1 909 192	49 896 305	1,45
International Flavors & Fragrances, Inc.	423 788	47 659 198	1,39
Reckitt Benckiser Group PLC	624 311	44 458 276	1,29
		160 331 464	4,66
Équipements électriques			
Amphenol Corp., "A"	299 475	23 889 121	0,70
Legrand S.A.	462 425	41 332 674	1,20
Schneider Electric SE	636 346	103 188 172	3,00
		168 409 967	4,90
Électronique			
Hoya Corp.	149 800	16 495 365	0,48
Microchip Technology, Inc.	246 087	19 101 273	0,56
		35 596 638	1,04
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	937 635	51 283 508	1,49
Nestlé S.A.	647 148	78 972 409	2,30
		130 255 917	3,79
Jeux et hôtellerie			
Marriott International, Inc., "A"	125 210	21 809 078	0,64
Whitbread PLC	395 926	14 906 521	0,43
		36 715 599	1,07

MFS Meridian Funds - Global Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Assurances			
Aon PLC	156 916	50 005 991	1,45
Willis Towers Watson PLC	237 505	60 371 396	1,76
		110 377 387	3,21
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	519 950	51 391 858	1,50
eBay, Inc.	542 340	26 845 830	0,78
		78 237 688	2,28
Machines et outils			
Carrier Global Corp.	206 543	9 403 903	0,28
Kubota Corp.	2 319 500	34 808 868	1,01
		44 212 771	1,29
Grandes banques			
Erste Group Bank AG	392 085	14 851 937	0,43
Goldman Sachs Group, Inc.	180 792	66 135 521	1,92
UBS Group AG	2 317 276	49 340 210	1,44
		130 327 668	3,79
Équipements médicaux			
Abbott Laboratories	454 499	50 244 865	1,46
Boston Scientific Corp.	1 206 388	55 795 445	1,62
Cooper Cos., Inc.	89 805	31 335 659	0,91
EssilorLuxottica	79 927	14 625 387	0,43
Medtronic PLC	1 041 239	87 141 292	2,54
Olympus Corp.	775 700	14 573 219	0,42
Sonova Holding AG	60 467	15 117 048	0,44
Stryker Corp.	246 831	62 648 176	1,82
Thermo Fisher Scientific, Inc.	166 758	95 107 090	2,77
Waters Corp.	88 140	28 961 041	0,84
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	90 274	11 495 491	0,34
		467 044 713	13,59
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
American Express Co.	270 158	47 258 739	1,38
Grupo Financiero Banorte S.A. de C.V.	1 261 693	10 465 141	0,30
Julius Baer Group Ltd.	235 719	15 104 365	0,44
Visa, Inc., A (g)	462 583	106 491 232	3,10
		179 319 477	5,22
Produits pharmaceutiques			
Bayer AG	654 435	40 592 758	1,18
Merck KGaA	251 813	52 355 867	1,53
Roche Holding AG	260 963	81 559 643	2,37
		174 508 268	5,08
Chemins de fer et transport maritime			
Canadian National Railway Co.	466 757	55 586 091	1,62
Canadian Pacific Railway Ltd.	868 164	68 498 140	1,99
Union Pacific Corp.	141 316	28 855 314	0,84
		152 939 545	4,45
Produits chimiques spéciaux			
Akzo Nobel N.V.	405 227	30 141 203	0,88
L'Air Liquide S.A.	202 414	32 257 471	0,94
Linde PLC	43 943	14 542 497	0,42
Linde PLC	222 321	73 089 270	2,12
		150 030 441	4,36
Magasins spécialisés			
Hermes International	8 574	16 068 517	0,47
Télécommunications mobiles			
Liberty Broadband Corp.	473 054	42 470 788	1,23

MFS Meridian Funds - Global Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Prix d'exercice	Premier exercice	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite					
Transport par camion					
United Parcel Service, Inc., "B"			190 464	35 279 647	1,03
Total des actions ordinaires (coût identifié, 2 528 912 727 $)				3 407 687 952	99,13
WARRANTS					
Industrie de la confection					
Compagnie Financiere Richemont S.A. (1 action contre 2 warrants, Expiration 4/12/23) (coût identifié, 0 $)	CHF 67	20/11/23	1 059 514	1 226 745	0,04
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)					
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 21 555 000 $)		USD	21 555 000	21 555 000	0,63
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 2 550 467 727 $) (k)				3 430 469 697	99,80
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF				6 951 646	0,20
ACTIF NET				3 437 421 343	100,00

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

MFS Meridian Funds - Global Equity Income Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
General Dynamics Corp.	598	139 370	2,82
Thales S.A.	108	14 269	0,29
		153 639	3,11
Boissons alcoolisées			
Kirin Holdings Co. Ltd.	2 600	40 045	0,81
Industrie de la confection			
Compagnie Financiere Richemont S.A.	174	26 828	0,54
Industrie automobile			
Magna International, Inc.	879	57 065	1,16
Mercedes-Benz Group AG	287	21 264	0,43
Stellantis N.V.	1 684	26 388	0,53
		104 717	2,12
Biotechnologies			
Biogen, Inc.	48	13 963	0,28
Gilead Sciences, Inc.	576	48 350	0,98
		62 313	1,26
Radio-télévision			
Omnicom Group, Inc.	278	23 905	0,48
Services aux entreprises			
Amdocs Ltd.	416	38 243	0,77
Produits chimiques			
Nutrien Ltd.	163	13 493	0,27
Logiciels			
Microsoft Corp.	289	71 617	1,45
Logiciels - Systèmes			
Hitachi Ltd.	400	21 003	0,42
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	14 000	46 701	0,95
Lenovo Group Ltd.	28 000	22 527	0,46
Samsung Electronics Co. Ltd.	759	37 938	0,77

MFS Meridian Funds - Global Equity Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels - Systèmes, suite			
Seagate Technology Holdings PLC	418	28 332	0,57
		156 501	3,17
Construction			
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	6 500	24 620	0,50
Biens de consommation			
Colgate-Palmolive Co.	1 137	84 741	1,72
Kimberly-Clark Corp.	935	121 559	2,46
		206 300	4,18
Électronique			
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	561	52 021	1,06
Texas Instruments, Inc.	918	162 679	3,29
		214 700	4,35
Énergie - Sociétés indépendantes			
Coterra Energy, Inc.	1 166	29 185	0,59
Valero Energy Corp.	210	29 406	0,60
		58 591	1,19
Énergie - Sociétés intégrées			
China Petroleum & Chemical Corp.	148 000	80 042	1,62
Eni S.p.A.	4 134	63 758	1,29
Exxon Mobil Corp.	417	48 376	0,98
LUKOIL PJSC (c)	73	0	0,00
Suncor Energy, Inc.	487	16 903	0,34
TotalEnergies SE	1 123	69 769	1,41
		278 848	5,64
Alimentation et boissons			
Archer Daniels Midland Co.	572	47 390	0,96
Coca-Cola FEMSA S.A.B. de C.V.	287	21 864	0,44
General Mills, Inc.	1 826	143 085	2,90
J.M. Smucker Co.	465	71 052	1,44
		283 391	5,74
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Albertsons Cos., Inc., "A"	1 278	27 093	0,55
BIM Birlesik Magazalar A.S.	5 015	33 277	0,67
Tesco PLC	18 057	54 851	1,11
		115 221	2,33
Assurances			
Equitable Holdings, Inc.	2 442	78 315	1,59
Everest Re Group Ltd.	28	9 791	0,20
Hartford Financial Services Group, Inc.	415	32 208	0,65
Manulife Financial Corp.	6 117	121 048	2,45
MetLife, Inc.	848	61 921	1,25
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	259	42 783	0,87
Zurich Insurance Group AG	92	45 501	0,92
		391 567	7,93
Loisirs et jouets			
Brunswick Corp.	251	21 167	0,43
Nintendo Co. Ltd., ADR	1 903	20 495	0,42
Polaris, Inc.	161	18 489	0,37
		60 151	1,22
Machines et outils			
GEA Group AG	372	16 723	0,34
Timken Co.	152	12 517	0,25
Volvo Group	2 325	46 082	0,93
		75 322	1,52

MFS Meridian Funds - Global Equity Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Grandes banques			
BNP Paribas	1 647	112 894	2,28
DBS Group Holdings Ltd.	5 800	158 777	3,21
Erste Group Bank AG	481	18 220	0,37
Regions Financial Corp.	1 337	31 473	0,64
		321 364	6,50
Technologies et services médicaux et de santé			
McKesson Corp.	217	82 174	1,66
Métaux et exploitation minière			
Fortescue Metals Group Ltd.	475	7 535	0,15
Glencore PLC	3 740	25 111	0,51
Rio Tinto PLC	2 256	176 366	3,57
Vale S.A.	3 700	68 886	1,39
		277 898	5,62
Gaz naturel - Gazoducs			
Plains GP Holdings LP	909	11 899	0,24
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
China Construction Bank Corp.	38 000	24 683	0,50
KB Financial Group, Inc.	310	14 125	0,29
Sberbank of Russia PJSC (c)	7 088	0	0,00
SLM Corp.	2 068	36 335	0,73
Tisco Financial Group PCL	6 700	20 804	0,42
		95 947	1,94
Produits pharmaceutiques			
Bayer AG	1 446	89 691	1,81
Johnson & Johnson	846	138 253	2,80
Merck & Co., Inc.	2 276	244 465	4,95
Organon & Co.	2 704	81 472	1,65
Pfizer, Inc.	987	43 586	0,88
Roche Holding AG	504	157 517	3,19
Sanofi	340	33 411	0,68
		788 395	15,96
Chemins de fer et transport maritime			
A.P. Moller-Maersk A/S	3	6 525	0,13
Orient Overseas International Ltd.	500	8 316	0,17
		14 841	0,30
Immobilier			
Extra Space Storage, Inc., REIT	210	33 144	0,67
National Retail Properties, Inc., REIT	519	24 575	0,50
Simon Property Group, Inc., REIT	246	31 601	0,64
W.P. Carey, Inc., REIT	313	26 771	0,54
		116 091	2,35
Restaurants			
Cracker Barrel Old Country Store, Inc.	120	13 389	0,27
Darden Restaurants, Inc.	112	16 573	0,34
Sodexo	207	20 508	0,42
Texas Roadhouse, Inc.	204	20 488	0,41
		70 958	1,44
Produits chimiques spéciaux			
Chemours Co.	431	15 684	0,32
Télécommunications mobiles			
KDDI Corp.	3 800	118 728	2,41
PT Telekom Indonesia	69 300	17 799	0,36
Vodafone Group PLC	21 095	24 303	0,49
		160 830	3,26

MFS Meridian Funds - Global Equity Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Services téléphoniques				
AT&T, Inc.		1 305	26 583	0,54
Hellenic Telecommunications Organization S.A.		2 227	35 033	0,71
Orange S.A.		2 597	27 481	0,55
			89 097	1,80
Tabac				
British American Tobacco PLC		2 038	77 942	1,58
Japan Tobacco, Inc.		1 700	34 612	0,70
Philip Morris International, Inc.		255	26 581	0,54
			139 135	2,82
Services publics - Énergie électrique				
American Electric Power Co., Inc.		316	29 691	0,60
E.ON SE		4 449	48 341	0,98
Edison International		865	59 599	1,21
Iberdrola S.A.		2 423	28 334	0,57
Transmissora Alianca de Energia Eletrica S.A., IEU		1 534	11 199	0,23
Vistra Corp.		505	11 645	0,23
			188 809	3,82
Total des actions ordinaires (coût identifié, 4 669 338 $)			4 773 134	96,61
ACTIONS PRIVILÉGIÉES				
Logiciels - Systèmes				
Samsung Electronics Co. Ltd.		370	16 673	0,34
Métaux et exploitation minière				
Gerdau S.A.		8 300	53 531	1,08
Total des actions privilégiées (coût identifié, 65 711 $)			70 204	1,42
ACTIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES				
Équipements médicaux				
Boston Scientific Corp., 5,5 % (coût identifié, 12 431 $)		113	12 897	0,26
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 121 000 $)	USD	121 000	121 000	2,45
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 4 868 480 $) (k)			4 977 235	100,74
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			(36 527)	(0,74)
ACTIF NET			4 940 708	100,00

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

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Aérospatiale et défense				
Bombardier, Inc., 7,5 %, 15/03/2025	USD	258 000	258 323	0,11
Bombardier, Inc., 7,125 %, 15/06/2026		308 000	307 264	0,13
Bombardier, Inc., 7,5 %, 1/02/2029		230 000	229 777	0,10
F-Brasile S.p.A./F-Brasile U.S. LLC, 7,375 %, 15/08/2026		665 000	544 888	0,23
Moog, Inc., 4,25 %, 15/12/2027		752 000	697 480	0,29
TransDigm, Inc., 6,25 %, 15/03/2026		490 000	489 827	0,21
TransDigm, Inc., 6,375 %, 15/06/2026		355 000	350 557	0,15
TransDigm, Inc., 5,5 %, 15/11/2027		400 000	381 990	0,16
TransDigm, Inc., 4,625 %, 15/01/2029		486 000	438 450	0,18
			3 698 556	1,56

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Créances adossées à des actifs et titrisées				
COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust, 2006-2A, F, CDO, FLR, 5,63 %, 26/04/2050 (p)	USD	660 079	66	0,00
Industrie automobile				
Clarios Global LP/Clarios U.S. Finance Co., 8,5 %, 15/05/2027		610 000	607 567	0,26
Dana, Inc., 5,375 %, 15/11/2027		440 000	418 095	0,18
Dana, Inc., 4,25 %, 1/09/2030		215 000	181 955	0,08
Dornoch Debt Merger Sub, Inc., 6,625 %, 15/10/2029		536 000	402 450	0,17
Ford Motor Co., 5,113 %, 3/05/2029		665 000	630 226	0,26
Ford Motor Credit Co. LLC, 4,134 %, 4/08/2025		930 000	888 122	0,37
RAC Bond Co. PLC, 5,25 %, 4/11/2027	GBP	801 000	805 949	0,34
Real Hero Merger Sub 2, Inc., 6,25 %, 1/02/2029	USD	415 000	308 138	0,13
RENK AG, 5,75 %, 15/07/2025	EUR	635 000	672 902	0,28
TI Automotive Finance PLC, 3,75 %, 15/04/2029		935 000	782 694	0,33
			5 698 098	2,40
Industries de base				
PeopleCert Wisdom, 5,75 %, 15/09/2026		565 000	574 314	0,24
Radio-télévision				
Advantage Sales & Marketing, Inc., 6,5 %, 15/11/2028	USD	453 000	344 280	0,14
Banijay Group S.A.S., 6,5 %, 1/03/2026	EUR	525 000	550 949	0,23
Gray Escrow II, Inc., 5,375 %, 15/11/2031	USD	974 000	749 030	0,32
iHeartCommunications, Inc., 8,375 %, 1/05/2027		597 000	535 061	0,22
Scripps Escrow II, Inc., 5,875 %, 15/07/2027		477 000	425 723	0,18
Summer (BC) Bidco B LLC, 5,5 %, 31/10/2026		485 000	398 628	0,17
Summer (BC) Holdco S.à r.l., "A", 9,25 %, 31/10/2027	EUR	513 600	452 914	0,19
WMG Acquisition Corp., 3,875 %, 15/07/2030	USD	606 000	534 189	0,22
WMG Acquisition Corp., 2,25 %, 15/08/2031	EUR	687 000	582 750	0,25
			4 573 524	1,92
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
AG TTMT Escrow Issuer LLC, 8,625 %, 30/09/2027	USD	583 000	601 522	0,25
Aretec Escrow Issuer, Inc., 7,5 %, 1/04/2029		495 000	439 313	0,19
LPL Holdings, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		660 000	628 082	0,26
LPL Holdings, Inc., 4 %, 15/03/2029		431 000	385 745	0,16
LPL Holdings, Inc., 4,375 %, 15/05/2031		295 000	258 305	0,11
NFP Corp., 4,875 %, 15/08/2028		395 000	344 728	0,15
NFP Corp., 6,875 %, 15/08/2028		469 000	405 526	0,17
			3 063 221	1,29
Construction				
ABC Supply Co., Inc., 4 %, 15/01/2028		1 035 000	942 957	0,40
Foundation Building Materials LLC, 6 %, 1/03/2029		450 000	361 962	0,15
GYP Holding III Corp., 4,625 %, 1/05/2029		755 000	636 597	0,27
Interface, Inc., 5,5 %, 1/12/2028		775 000	651 116	0,27
MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Co., 5,5 %, 1/02/2030		385 000	320 116	0,13
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 9,75 %, 15/07/2028		453 000	429 573	0,18
Patrick Industries, Inc., 7,5 %, 15/10/2027		635 000	628 301	0,26
SRM Escrow Issuer LLC, 6 %, 1/11/2028		430 000	392 599	0,17
SRS Distribution, Inc., 6,125 %, 1/07/2029		530 000	455 752	0,19
Standard Industries, Inc., 2,25 %, 21/11/2026	EUR	730 000	685 807	0,29
Standard Industries, Inc., 4,75 %, 15/01/2028	USD	494 000	462 952	0,19
Standard Industries, Inc., 4,375 %, 15/07/2030		574 000	490 696	0,21
Standard Industries, Inc., 3,375 %, 15/01/2031		150 000	119 133	0,05
White Cap Buyer LLC, 6,875 %, 15/10/2028		485 000	441 458	0,19
			7 019 019	2,95
Services aux entreprises				
Entegris Escrow Corp., 5,95 %, 15/06/2030		239 000	229 519	0,10
HealthEquity, Inc., 4,5 %, 1/10/2029		495 000	443 173	0,19

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services aux entreprises, suite				
Iron Mountain, Inc., 4,875 %, 15/09/2027	USD	415 000	390 739	0,16
Iron Mountain, Inc., 5,25 %, 15/03/2028		305 000	290 025	0,12
Nexi S.p.A., 2,125 %, 30/04/2029	EUR	1 250 000	1 083 166	0,46
StoneCo Ltd., 3,95 %, 16/06/2028	USD	1 192 000	904 132	0,38
Verscend Escrow Corp., 9,75 %, 15/08/2026		629 000	631 187	0,27
ZI Technologies LLC/ZI Finance Corp. Co., 3,875 %, 1/02/2029		175 000	150 938	0,06
			4 122 879	1,74
Télévision par câble				
Cable One, Inc., 4 %, 15/11/2030		568 000	468 332	0,20
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 5,125 %, 1/05/2027		365 000	347 863	0,15
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,75 %, 1/03/2030		1 405 000	1 227 675	0,52
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,5 %, 15/08/2030		755 000	645 117	0,27
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,25 %, 1/02/2031		695 000	578 970	0,24
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,25 %, 15/01/2034		340 000	265 047	0,11
CSC Holdings LLC, 5,375 %, 1/02/2028		410 000	345 938	0,15
CSC Holdings LLC, 5,75 %, 15/01/2030		845 000	532 350	0,22
CSC Holdings LLC, 4,125 %, 1/12/2030		620 000	458 347	0,19
DISH DBS Corp., 7,75 %, 1/07/2026		250 000	203 040	0,09
DISH DBS Corp., 5,25 %, 1/12/2026		490 000	422 319	0,18
DISH DBS Corp., 5,125 %, 1/06/2029		425 000	270 253	0,11
DISH Network Corp., 11,75 %, 15/11/2027		210 000	218 232	0,09
LCPR Senior Secured Financing DAC, 6,75 %, 15/10/2027		668 000	650 832	0,27
LCPR Senior Secured Financing DAC, 5,125 %, 15/07/2029		210 000	184 800	0,08
Sirius XM Holdings, Inc., 3,875 %, 1/09/2031		645 000	531 725	0,22
Sirius XM Radio, Inc., 4 %, 15/07/2028		447 000	397 875	0,17
Sirius XM Radio, Inc., 5,5 %, 1/07/2029		1 000 000	937 150	0,39
Summer BidCo B.V., 9 %, 15/11/2025	EUR	842 052	685 560	0,29
Telenet Finance Luxembourg S.A., 5,5 %, 1/03/2028	USD	1 000 000	929 000	0,39
United Group B.V., 3,125 %, 15/02/2026	EUR	280 000	261 542	0,11
Videotron Ltd., 5,125 %, 15/04/2027	USD	368 000	353 251	0,15
Videotron Ltd., 3,625 %, 15/06/2029		219 000	190 542	0,08
Virgin Media Finance PLC, 3,75 %, 15/07/2030	EUR	530 000	462 567	0,20
Virgin Media Finance PLC, 5 %, 15/07/2030	USD	700 000	587 573	0,25
Virgin Media Receivables Financing Notes II DAC Co., 4,875 %, 15/07/2028	GBP	530 000	546 414	0,23
Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC, 5 %, 15/07/2028	USD	900 000	816 840	0,34
Ziggo Bond Finance B.V., 2,875 %, 15/01/2030	EUR	890 000	790 983	0,33
Ziggo Bond Finance B.V., 5,125 %, 28/02/2030	USD	1 005 000	830 633	0,35
			15 140 770	6,37
Produits chimiques				
Axalta Coating Systems Ltd., 4,75 %, 15/06/2027		376 000	355 320	0,15
Axalta Coating Systems Ltd., 3,375 %, 15/02/2029		820 000	705 200	0,30
Consolidated Energy Finance S.A., 5,625 %, 15/10/2028		446 000	388 020	0,16
Element Solutions, Inc., 3,875 %, 1/09/2028		707 000	625 695	0,26
Herens Midco S.à r.l., 5,25 %, 15/05/2029	EUR	425 000	313 609	0,13
HT Troplast GmbH, 9,25 %, 15/07/2025		555 000	582 250	0,25
Ingevity Corp., 3,875 %, 1/11/2028	USD	665 000	582 865	0,25
LSF11 A5 HoldCo LLC, 6,625 %, 15/10/2029		517 000	424 248	0,18
S.P.C.M. S.A., 3,375 %, 15/03/2030		618 000	523 137	0,22
Sasol Financing (USA) LLC, 5,5 %, 18/03/2031		1 060 000	924 850	0,39
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC, 4,375 %, 1/11/2026	EUR	825 000	795 953	0,33
			6 221 147	2,62
Logiciels				
Camelot Finance S.A., 4,5 %, 1/11/2026	USD	360 000	342 407	0,14
Clarivate Analytics (US) LLC, 4,875 %, 1/07/2029		445 000	391 566	0,17

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Logiciels, suite				
Clarivate Science Holdings Corp., 3,875 %, 1/07/2028	USD	145 000	129 384	0,05
Clarivate Science Holdings Corp., 4,875 %, 1/07/2029		70 000	61 595	0,03
Dun & Bradstreet Corp., 5 %, 15/12/2029		540 000	478 170	0,20
Neptune Bidco U.S., Inc., 9,29 %, 15/04/2029		356 000	346 043	0,15
			1 749 165	0,74
Logiciels - Systèmes				
Fair Isaac Corp., 5,25 %, 15/05/2026		945 000	938 149	0,39
Fair Isaac Corp., 4 %, 15/06/2028		122 000	113 277	0,05
Sabre GLBL, Inc., 7,375 %, 1/09/2025		137 000	134 379	0,06
Sabre GLBL, Inc., 11,25 %, 15/12/2027		223 000	236 380	0,10
SS&C Technologies Holdings, Inc., 5,5 %, 30/09/2027		869 000	835 756	0,35
Viavi Solutions, Inc., 3,75 %, 1/10/2029		715 000	623 837	0,26
Virtusa Corp., 7,125 %, 15/12/2028		420 000	352 800	0,15
			3 234 578	1,36
Conglomérats				
BWX Technologies, Inc., 4,125 %, 30/06/2028		378 000	341 147	0,14
BWX Technologies, Inc., 4,125 %, 15/04/2029		962 000	861 018	0,36
Chart Industries, Inc., 9,5 %, 1/01/2031		219 000	228 524	0,10
Gates Global LLC, 6,25 %, 15/01/2026		625 000	615 524	0,26
Griffon Corp., 5,75 %, 1/03/2028		587 000	555 549	0,23
Grupo KUO S.A.B. de C.V., 5,75 %, 7/07/2027		1 145 000	1 085 643	0,46
Industria Macchine Automatiche S.p.A., 3,75 %, 15/01/2028	EUR	535 000	508 922	0,21
Madison IAQ LLC, 5,875 %, 30/06/2029	USD	678 000	537 817	0,23
Regal Rexnord Corp., 6,3 %, 15/02/2030		373 000	380 334	0,16
TriMas Corp., 4,125 %, 15/04/2029		1 088 000	968 592	0,41
			6 083 070	2,56
Construction				
Empire Communities Corp., 7 %, 15/12/2025		440 000	398 200	0,17
Mattamy Group Corp., 5,25 %, 15/12/2027		190 000	173 850	0,07
Mattamy Group Corp., 4,625 %, 1/03/2030		500 000	421 695	0,18
Meritage Homes Corp., 3,875 %, 15/04/2029		485 000	429 831	0,18
Taylor Morrison Communities, Inc., 5,75 %, 15/01/2028		622 000	603 349	0,25
Weekley Homes LLC/Weekley Finance Corp., 4,875 %, 15/09/2028		422 000	367 246	0,16
			2 394 171	1,01
Biens de consommation				
Energizer Gamma Acquisition B.V., 3,5 %, 30/06/2029	EUR	270 000	238 535	0,10
Energizer Holdings, Inc., 4,375 %, 31/03/2029	USD	447 000	388 184	0,16
Mattel, Inc., 3,375 %, 1/04/2026		540 000	503 552	0,21
Mattel, Inc., 5,875 %, 15/12/2027		157 000	156 607	0,07
Mattel, Inc., 6,2 %, 1/10/2040		65 000	60 352	0,02
Mattel, Inc., 5,45 %, 1/11/2041		195 000	166 892	0,07
Natura & Co. Luxembourg Holdings S.à r.l., 6 %, 19/04/2029		569 000	502 171	0,21
Newell Brands, Inc., 6,375 %, 15/09/2027		304 000	305 578	0,13
Newell Brands, Inc., 6,625 %, 15/09/2029		355 000	358 868	0,15
Prestige Consumer Healthcare, Inc., 5,125 %, 15/01/2028		395 000	377 324	0,16
Prestige Consumer Healthcare, Inc., 3,75 %, 1/04/2031		270 000	229 257	0,10
Spectrum Brands, Inc., 3,875 %, 15/03/2031		355 000	286 212	0,12
SWF Escrow Issuer Corp., 6,5 %, 1/10/2029		395 000	259 681	0,11
			3 833 213	1,61
Services de consommation				
Allied Universal Holdco LLC, 6,625 %, 15/07/2026		251 000	241 650	0,10
Allied Universal Holdco LLC, 9,75 %, 15/07/2027		525 000	501 375	0,21
Allied Universal Holdco LLC, 6 %, 1/06/2029		200 000	160 920	0,07
ANGI Group LLC, 3,875 %, 15/08/2028		670 000	513 575	0,22
Arches Buyer, Inc., 6,125 %, 1/12/2028		575 000	484 300	0,20

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services de consommation, suite				
GoDaddy, Inc., 3,5 %, 1/03/2029	USD	953 000	824 154	0,35
GW B-CR Security Corp., 9,5 %, 1/11/2027		404 000	398 986	0,17
Match Group Holdings II LLC, 5 %, 15/12/2027		400 000	383 546	0,16
Match Group Holdings II LLC, 4,625 %, 1/06/2028		685 000	630 042	0,26
Match Group Holdings II LLC, 4,125 %, 1/08/2030		230 000	197 800	0,08
Match Group Holdings II LLC, 3,625 %, 1/10/2031		45 000	36 113	0,01
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5,75 %, 15/01/2029		360 000	279 914	0,12
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5,25 %, 15/04/2030		410 000	307 500	0,13
TriNet Group, Inc., 3,5 %, 1/03/2029		751 000	630 637	0,27
Verisure Midholding AB, 5,25 %, 15/02/2029	EUR	790 000	709 030	0,30
WASH Multi-Family Acquisition, Inc., 5,75 %, 15/04/2026	USD	442 000	407 842	0,17
			6 707 384	2,82
Conteneurs				
ARD Finance S.A., 5 %, 30/06/2027 (p)	EUR	400 000	328 380	0,14
ARD Finance S.A., 6,5 %, 30/06/2027 (p)	USD	410 000	321 620	0,14
Ardagh Metal Packaging, 3 %, 1/09/2029	EUR	615 000	519 146	0,22
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC, 3,25 %, 1/09/2028	USD	330 000	289 585	0,12
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC, 4 %, 1/09/2029		564 000	466 349	0,20
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh MP Holdings USA, Inc., 5,25 %, 15/08/2027		710 000	581 408	0,25
Can-Pack S.A./Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,875 %, 15/11/2029		1 814 000	1 506 328	0,63
Crown Americas LLC, 5,25 %, 1/04/2030		480 000	462 000	0,19
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. V, 4,25 %, 30/09/2026		950 000	907 870	0,38
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. VI, 4,75 %, 1/02/2026		55 000	53 732	0,02
Huhtamaki Oyj, 4,25 %, 9/06/2027	EUR	700 000	746 188	0,31
LABL, Inc., 5,875 %, 1/11/2028	USD	175 000	158 156	0,07
San Miguel Industrias PET S.A., 3,5 %, 2/08/2028		1 050 000	903 389	0,38
Titan Holdings II B.V., 5,125 %, 15/07/2029	EUR	665 000	585 594	0,25
Trivium Packaging Finance B.V., 8,5 %, 15/08/2027	USD	380 000	365 461	0,15
			8 195 206	3,45
Équipements électriques				
CommScope Technologies LLC, 5 %, 15/03/2027		714 000	545 123	0,23
Électronique				
Entegris, Inc., 4,375 %, 15/04/2028		220 000	199 100	0,09
Entegris, Inc., 3,625 %, 1/05/2029		257 000	219 175	0,09
Infineon Technologies AG, 3,625 %, 31/12/2049	EUR	800 000	799 607	0,34
Sensata Technologies B.V., 5,625 %, 1/11/2024	USD	195 000	195 045	0,08
Sensata Technologies B.V., 5 %, 1/10/2025		750 000	741 746	0,31
Sensata Technologies B.V., 5,875 %, 1/09/2030		305 000	299 281	0,13
Sensata Technologies, Inc., 4,375 %, 15/02/2030		270 000	244 420	0,10
Synaptics, Inc., 4 %, 15/06/2029		580 000	502 230	0,21
			3 200 604	1,35
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Bulgarian Energy Holdings, 2,45 %, 22/07/2028	EUR	1 099 000	973 935	0,41
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 7,125 %, 11/02/2025	USD	895 000	857 052	0,36
Petroleos Mexicanos, 6,5 %, 13/03/2027		655 000	618 312	0,26
Petroleos Mexicanos, 6,84 %, 23/01/2030		450 000	391 510	0,17
Petroleos Mexicanos, 10 %, 7/02/2033		676 000	660 452	0,28
Petroleos Mexicanos, 6,5 %, 2/06/2041		1 815 000	1 307 526	0,55
Petroleos Mexicanos, 7,69 %, 23/01/2050		860 000	642 077	0,27
T.C. Ziraat Bankasi A.S. (République turque), 9,5 %, 1/08/2026		581 000	574 307	0,24
			6 025 171	2,54
Énergie - Sociétés indépendantes				
Antero Resources Corp., 7,625 %, 1/02/2029		390 000	398 814	0,17
CNX Resources Corp., 6 %, 15/01/2029		487 000	447 055	0,19
CNX Resources Corp., 7,375 %, 15/01/2031		96 000	93 359	0,04

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Énergie - Sociétés indépendantes, suite				
Comstock Resources, Inc., 6,75 %, 1/03/2029	USD	685 000	631 912	0,26
CrownRock LP/CrownRock Finance, Inc., "F", 5 %, 1/05/2029		620 000	567 889	0,24
Encino Acquisition Partners Holdings LLC, 8,5 %, 1/05/2028		390 000	363 601	0,15
Energean PLC, 6,5 %, 30/04/2027		676 000	632 601	0,27
Kosmos Energy Ltd., 7,125 %, 4/04/2026		560 000	506 374	0,21
Leviathan Bond Ltd., 6,5 %, 30/06/2027		716 000	704 365	0,30
Moss Creek Resources Holdings, Inc., 7,5 %, 15/01/2026		345 000	318 573	0,13
Permian Resources Operating LLC, 7,75 %, 15/02/2026		90 000	89 946	0,04
Permian Resources Operating LLC, 5,875 %, 1/07/2029		487 000	456 466	0,19
SM Energy Co., 6,5 %, 15/07/2028		445 000	423 293	0,18
Southwestern Energy Co., 8,375 %, 15/09/2028		170 000	178 558	0,07
Southwestern Energy Co., 5,375 %, 15/03/2030		435 000	405 094	0,17
Tap Rock Resources LLC, 7 %, 1/10/2026		146 000	138 189	0,06
			6 356 089	2,67
Divertissement				
Carnival Corp. PLC, 7,625 %, 1/03/2026		624 000	567 840	0,24
Carnival Corp. PLC, 5,75 %, 1/03/2027		320 000	265 600	0,11
Carnival Corp. PLC, 9,875 %, 1/08/2027		200 000	205 500	0,09
Life Time, Inc., 5,75 %, 15/01/2026		435 000	418 044	0,18
Life Time, Inc., 8 %, 15/04/2026		135 000	131 117	0,05
Merlin Entertainments, 5,75 %, 15/06/2026		400 000	380 842	0,16
Motion Bondco DAC, 6,625 %, 15/11/2027		400 000	361 992	0,15
NCL Corp. Ltd., 5,875 %, 15/03/2026		421 000	364 157	0,15
NCL Corp. Ltd., 5,875 %, 15/02/2027		130 000	120 867	0,05
Royal Caribbean Cruises Ltd., 5,375 %, 15/07/2027		330 000	287 061	0,12
Royal Caribbean Cruises Ltd., 5,5 %, 1/04/2028		580 000	498 800	0,21
SeaWorld Parks & Entertainment, 5,25 %, 15/08/2029		390 000	352 487	0,15
			3 954 307	1,66
Établissements financiers				
Atrium European Real Estate Ltd., 3,625 % jusqu'au 4/11/2026, FLR jusqu'au 4/05/2170	EUR	725 000	291 628	0,12
Avation Capital S.A., 8,25 %, 31/10/2026 (p)	USD	488 639	417 786	0,18
Credit Acceptance Corp., 5,125 %, 31/12/2024		530 000	494 956	0,21
Encore Capital Group, Inc., 5,375 %, 15/02/2026	GBP	665 000	741 960	0,31
Encore Capital Group, Inc., 4,25 %, 1/06/2028		456 000	441 030	0,19
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)	USD	1 166 379	1 064 418	0,45
Howard Hughes Corp., 4,125 %, 1/02/2029		686 000	592 375	0,25
Nationstar Mortgage Holdings, Inc., 6 %, 15/01/2027		754 000	699 335	0,29
OneMain Finance Corp., 6,875 %, 15/03/2025		300 000	299 058	0,13
OneMain Finance Corp., 7,125 %, 15/03/2026		485 000	481 826	0,20
Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc., 3,625 %, 1/03/2029		715 000	603 238	0,25
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,875 % jusqu'au 30/01/2027, FLR jusqu'au 30/01/2171	EUR	995 000	412 674	0,17
SLM Corp., 3,125 %, 2/11/2026	USD	270 000	238 464	0,10
			6 778 748	2,85
Alimentation et boissons				
Aragvi Finance International DAC, 8,45 %, 29/04/2026		508 000	379 537	0,16
B&G Foods, Inc., 5,25 %, 1/04/2025		355 000	323 529	0,14
B&G Foods, Inc., 5,25 %, 15/09/2027		130 000	105 138	0,04
BellRing Brands, Inc., 7 %, 15/03/2030		590 000	585 635	0,25
Central American Bottling Corp., 5,25 %, 27/04/2029		976 000	937 243	0,39
Coca-Cola Icecek A.S., 4,5 %, 20/01/2029		1 080 000	943 186	0,40
Lamb Weston Holdings, Inc., 4,125 %, 31/01/2030		610 000	549 762	0,23
Performance Food Group Co., 5,5 %, 15/10/2027		610 000	587 122	0,25
Post Holdings, Inc., 5,625 %, 15/01/2028		435 000	418 688	0,18
Post Holdings, Inc., 4,625 %, 15/04/2030		825 000	726 000	0,30

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Alimentation et boissons, suite				
Premier Foods Finance PLC, 3,5 %, 15/10/2026	GBP	840 000	926 711	0,39
Primo Water Holding, Inc., 4,375 %, 30/04/2029	USD	754 000	657 669	0,28
U.S. Foods Holding Corp., 4,75 %, 15/02/2029		665 000	608 338	0,25
			7 748 558	3,26
Jeux et hôtellerie				
Allwyn International A.S., 3,875 %, 15/02/2027	EUR	885 000	896 944	0,38
Boyd Gaming Corp., 4,75 %, 1/12/2027	USD	335 000	318 474	0,13
Boyd Gaming Corp., 4,75 %, 15/06/2031		150 000	134 972	0,06
Caesars Entertainment, Inc., 4,625 %, 15/10/2029		330 000	282 150	0,12
Caesars Entertainment, Inc., 7 %, 15/02/2030		376 000	382 580	0,16
Caesars Resort Collection LLC/CRC Finco, Inc., 8,125 %, 1/07/2027		526 000	533 890	0,23
CCM Merger, Inc., 6,375 %, 1/05/2026		478 000	462 465	0,19
Gamma Bidco S.p.A., 6,25 %, 15/07/2025	EUR	524 000	563 970	0,24
Hilton Domestic Operating Co., Inc., 3,75 %, 1/05/2029	USD	685 000	608 355	0,26
Hilton Domestic Operating Co., Inc., 3,625 %, 15/02/2032		661 000	555 075	0,23
International Game Technology PLC, 4,125 %, 15/04/2026		740 000	701 167	0,30
International Game Technology PLC, 6,25 %, 15/01/2027		200 000	200 000	0,08
Marriott Ownership Resorts, Inc., 4,5 %, 15/06/2029		285 000	248 095	0,10
NH Hotel Group S.A., 4 %, 2/07/2026	EUR	760 000	774 297	0,33
Sands China Ltd., 4,3 %, 8/01/2026	USD	530 000	502 730	0,21
Sands China Ltd., 4,875 %, 18/06/2030		395 000	359 849	0,15
Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US Finco, Inc., 6,625 %, 1/03/2030		457 000	407 084	0,17
VICI Properties LP / VICI Note Co., Inc., 4,25 %, 1/12/2026		570 000	537 938	0,23
VICI Properties LP / VICI Note Co., Inc., 5,75 %, 1/02/2027		65 000	64 659	0,03
Wyndham Hotels & Resorts, Inc., 4,375 %, 15/08/2028		654 000	603 188	0,25
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp., 5,125 %, 1/10/2029		620 000	553 350	0,23
			9 691 232	4,08
Industrie				
Albion Financing 1 S.à r.l., 6,125 %, 15/10/2026		310 000	278 140	0,12
Albion Financing 2 S.à r.l., 8,75 %, 15/04/2027		220 000	186 450	0,08
APi Escrow Corp., 4,75 %, 15/10/2029		775 000	691 012	0,29
Arabian Centres Sukuk II Ltd., 5,625 %, 7/10/2026		892 000	846 865	0,36
Williams Scotsman International, Inc., 4,625 %, 15/08/2028		602 000	557 786	0,23
			2 560 253	1,08
Assurances IARD				
Alliant Holdings Intermediate LLC, 6,75 %, 15/10/2027		225 000	210 449	0,09
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 5,875 %, 1/11/2029		5 000	4 356	0,00
AssuredPartners, Inc., 5,625 %, 15/01/2029		545 000	466 182	0,20
GTCR (AP) Finance, Inc., 8 %, 15/05/2027		105 000	103 101	0,04
Hub International Ltd., 5,625 %, 1/12/2029		791 000	707 844	0,30
Ryan Specialty Group, 4,375 %, 1/02/2030		289 000	260 461	0,11
			1 752 393	0,74
Obligations quasi souveraines du marché international				
Electricite de France S.A., 3,375 % jusqu'au 15/09/2030, FLR jusqu'au 15/09/2071	EUR	1 000 000	858 849	0,36
Machines et outils				
Sarens Finance Co. N.V., 5,75 %, 21/02/2027		679 000	603 520	0,25
Terex Corp., 5 %, 15/05/2029	USD	735 000	686 306	0,29
			1 289 826	0,54
Grandes banques				
Toronto Dominion Bank, 8,125 % jusqu'au 31/10/2027, FLR jusqu'au 31/10/2082		425 000	451 031	0,19
UniCredit S.p.A., 3,875 % jusqu'au 3/06/2027, FLR jusqu'au 3/06/2070	EUR	755 000	645 632	0,27
			1 096 663	0,46
Technologies et services médicaux et de santé				
180 Medical, Inc., 3,875 %, 15/10/2029	USD	700 000	620 383	0,26
Avantor Funding, Inc., 4,625 %, 15/07/2028		678 000	639 076	0,27

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Technologies et services médicaux et de santé, suite				
Catalent Pharma Solutions, Inc., 2,375 %, 1/03/2028	EUR	175 000	157 433	0,07
Catalent, Inc., 3,125 %, 15/02/2029	USD	1 219 000	1 008 405	0,42
Charles River Laboratories International, Inc., 3,75 %, 15/03/2029		1 062 000	945 907	0,40
Chrome Holdco S.A.S., 5 %, 31/05/2029	EUR	635 000	533 806	0,22
CHS/Community Health Systems, Inc., 8 %, 15/12/2027	USD	340 000	320 448	0,14
CHS/Community Health Systems, Inc., 6,125 %, 1/04/2030		870 000	522 990	0,22
CHS/Community Health Systems, Inc., 5,25 %, 15/05/2030		275 000	221 903	0,09
DaVita, Inc., 4,625 %, 1/06/2030		615 000	518 137	0,22
Encompass Health Corp., 5,75 %, 15/09/2025		210 000	208 426	0,09
Encompass Health Corp., 4,75 %, 1/02/2030		460 000	421 664	0,18
Encompass Health Corp., 4,625 %, 1/04/2031		85 000	74 817	0,03
IQVIA Holdings, Inc., 5 %, 15/10/2026		435 000	424 125	0,18
IQVIA Holdings, Inc., 5 %, 15/05/2027		695 000	674 435	0,28
Laboratoire Eimer Selas, 5 %, 1/02/2029	EUR	525 000	437 962	0,18
Legacy LifePoint Health LLC, 4,375 %, 15/02/2027	USD	195 000	170 625	0,07
Regional Care/LifePoint Health, Inc., 9,75 %, 1/12/2026		310 000	271 817	0,11
Syneos Health, Inc., 3,625 %, 15/01/2029		860 000	695 525	0,29
Tenet Healthcare Corp., 6,125 %, 1/10/2028		1 003 000	937 885	0,40
Tenet Healthcare Corp., 4,375 %, 15/01/2030		176 000	156 452	0,07
Tenet Healthcare Corp., 6,125 %, 15/06/2030		248 000	240 736	0,10
U.S. Acute Care Solutions LLC, 6,375 %, 1/03/2026		445 000	402 547	0,17
			10 605 504	4,46
Équipements médicaux				
Garden SpinCo Corp., 8,625 %, 20/07/2030		573 000	613 112	0,26
Mozart Debt Merger Sub, Inc., 5,25 %, 1/10/2029		310 000	259 558	0,11
Teleflex, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		689 000	657 797	0,27
			1 530 467	0,64
Métaux et exploitation minière				
Baffinland Iron Mines Corp./Baffinland Iron Mines LP, 8,75 %, 15/07/2026		814 000	790 486	0,33
Coeur Mining, Inc., 5,125 %, 15/02/2029		627 000	504 863	0,21
Compass Minerals International, Inc., 6,75 %, 1/12/2027		566 000	552 214	0,23
Eldorado Gold Corp., 6,25 %, 1/09/2029		330 000	302 408	0,13
Ero Copper Corp., 6,5 %, 15/02/2030		574 000	488 854	0,21
FMG Resources Ltd., 4,375 %, 1/04/2031		955 000	840 400	0,35
GrafTech Finance, Inc., 4,625 %, 15/12/2028		646 000	550 571	0,23
Kaiser Aluminum Corp., 4,625 %, 1/03/2028		702 000	640 926	0,27
Kaiser Aluminum Corp., 4,5 %, 1/06/2031		277 000	234 234	0,10
Novelis Corp., 3,25 %, 15/11/2026		296 000	267 975	0,11
Novelis Corp., 4,75 %, 30/01/2030		580 000	524 900	0,22
Novelis Corp., 3,875 %, 15/08/2031		296 000	249 824	0,11
Novelis Sheet Ingot GmbH, 3,375 %, 15/04/2029	EUR	540 000	510 062	0,22
Petra Diamonds US$ Treasury PLC, 10,5 % (10,5 % PIK/9,75 % liquidités au 30/06/2023), 9,75 % liquidités au 8/03/2026 (p)	USD	240 732	233 510	0,10
Petra Diamonds US$ Treasury PLC, 10,5 % (10,5 % PIK/9,75 % liquidités au 30/06/2023), 9,75 % liquidités au 8/03/2026 (p)		719 789	698 195	0,29
TMS International Corp., 6,25 %, 15/04/2029		130 000	97 648	0,04
			7 487 070	3,15
Secteur intermédiaire				
Cheniere Energy Partners LP, 4,5 %, 1/10/2029		362 000	339 599	0,14
DT Midstream, Inc., 4,125 %, 15/06/2029		388 000	340 470	0,14
DT Midstream, Inc., 4,375 %, 15/06/2031		778 000	680 534	0,29
EQM Midstream Partners LP, 6 %, 1/07/2025		63 000	62 024	0,03
EQM Midstream Partners LP, 5,5 %, 15/07/2028		1 190 000	1 097 775	0,46
EQM Midstream Partners LP, 4,5 %, 15/01/2029		330 000	289 430	0,12
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp., 8 %, 15/01/2027		179 000	176 709	0,08

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Secteur intermédiaire, suite				
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp., 8,875 %, 15/04/2030	USD	449 000	456 296	0,19
Kinetik Holdings, Inc., 5,875 %, 15/06/2030		892 000	847 400	0,36
Peru LNG, 5,375 %, 22/03/2030		855 000	709 000	0,30
Tallgrass Energy Partners LP, 5,5 %, 15/01/2028		725 000	667 642	0,28
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Finance Corp., 6,875 %, 15/01/2029		630 000	647 004	0,27
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 3,875 %, 15/08/2029		645 000	574 050	0,24
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4,125 %, 15/08/2031		385 000	341 326	0,14
Venture Global Calcasieu Pass LLC , 6,25 %, 15/01/2030		166 000	169 117	0,07
			7 398 376	3,11
Réseaux et télécommunications				
DKT Finance ApS, 7 %, 17/06/2023	EUR	640 000	695 526	0,29
Iliad Holding S.A.S., 5,625 %, 15/10/2028		670 000	677 403	0,29
Iliad Holding S.A.S., 7 %, 15/10/2028	USD	738 000	693 115	0,29
Kaixo Bondco Telecom S.A., 5,125 %, 30/09/2029	EUR	1 065 000	997 689	0,42
Total Play Telecomunicaciones S.A. de C.V., 6,375 %, 20/09/2028	USD	978 000	827 770	0,35
			3 891 503	1,64
Services pétroliers				
MV24 Capital B.V., 6,748 %, 1/06/2034		599 550	571 971	0,24
Nabors Industries Ltd., 7,25 %, 15/01/2026		400 000	389 000	0,16
Solaris Midstream Holding LLC, 7,625 %, 1/04/2026		392 000	392 000	0,17
			1 352 971	0,57
Pétrole				
MC Brazil Downstream, 7,25 %, 30/06/2031		828 850	722 995	0,30
Parkland Corp., 4,625 %, 1/05/2030		925 000	795 132	0,34
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp., 6 %, 15/02/2028		310 000	292 280	0,12
			1 810 407	0,76
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
Banco GNB Sudameris S.A., 7,5 % jusqu'au 16/04/2026, FLR jusqu'au 16/04/2031		845 000	660 647	0,28
Dobank S.p.A., 3,375 %, 31/07/2026	EUR	1 145 000	1 143 275	0,48
Intesa Sanpaolo S.p.A., 4,125 % jusqu'au 27/02/2030, FLR jusqu'au 27/02/2070		755 000	633 041	0,27
			2 436 963	1,03
Ordinateurs personnels et périphériques				
NCR Corp., 5 %, 1/10/2028	USD	590 000	519 707	0,22
NCR Corp., 5,125 %, 15/04/2029		361 000	314 451	0,13
			834 158	0,35
Produits pharmaceutiques				
1375209 BC Ltd., 9 %, 30/01/2028		128 000	127 521	0,05
1375209 BC Ltd., 9 %, 30/01/2028		186 000	185 304	0,08
Bausch Health Co., Inc., 11 %, 30/09/2028		331 000	258 974	0,11
Bausch Health Co., Inc., 14 %, 15/10/2030		66 000	41 199	0,02
Jazz Securities DAC, 4,375 %, 15/01/2029		940 000	857 600	0,36
Organon + Co., 2,875 %, 30/04/2028	EUR	265 000	251 017	0,11
Organon Finance 1 LLC, 4,125 %, 30/04/2028	USD	711 000	643 064	0,27
Organon Finance 1 LLC, 5,125 %, 30/04/2031		474 000	427 923	0,18
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III B.V., 4,75 %, 9/05/2027		1 075 000	998 406	0,42
			3 791 008	1,60
Lutte contre la pollution				
GFL Environmental, Inc., 4,25 %, 1/06/2025		170 000	163 941	0,07
GFL Environmental, Inc., 4 %, 1/08/2028		575 000	510 456	0,21
GFL Environmental, Inc., 4,75 %, 15/06/2029		200 000	180 508	0,08
GFL Environmental, Inc., 4,375 %, 15/08/2029		155 000	137 457	0,06
Stericycle, Inc., 3,875 %, 15/01/2029		547 000	485 331	0,20
			1 477 693	0,62
Métaux et minéraux précieux				
IAMGOLD Corp., 5,75 %, 15/10/2028		560 000	442 568	0,19

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Métaux et minéraux précieux, suite				
Taseko Mines Ltd., 7 %, 15/02/2026	USD	430 000	407 425	0,17
			849 993	0,36
Imprimerie et édition				
Cimpress N.V., 7 %, 15/06/2026		685 000	475 591	0,20
Immobilier - Santé				
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp., REIT, 0,993 %, 15/10/2026	EUR	130 000	105 191	0,05
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp., REIT, 5 %, 15/10/2027	USD	569 000	480 996	0,20
			586 187	0,25
Immobilier - Autres				
XHR LP, REIT, 4,875 %, 1/06/2029		575 000	510 313	0,22
Restaurants				
Fertitta Entertainment LLC, 6,75 %, 15/01/2030		500 000	415 000	0,18
Midco GB S.A.S., 7,75 %, 1/11/2027	EUR	535 000	523 463	0,22
			938 463	0,40
Distribution				
Asbury Automotive Group, Inc., 4,625 %, 15/11/2029	USD	607 000	535 641	0,23
Bath & Body Works, Inc., 5,25 %, 1/02/2028		1 095 000	1 033 582	0,43
BK LC Lux Finco 1 S.à r.l., 5,25 %, 30/04/2029	EUR	725 000	691 789	0,29
Goldstory S.A.S., 5,375 %, 1/03/2026		550 000	556 078	0,23
Grupo Axo S.A.P.I. de C.V., 5,75 %, 8/06/2026	USD	1 113 000	983 427	0,41
Marks & Spencer PLC, 4,5 %, 10/07/2027	GBP	775 000	873 990	0,37
Mobilux Finance S.A.S., 4 %, 15/07/2028	EUR	800 000	680 556	0,29
Victoria's Secret & Co., 4,625 %, 15/07/2029	USD	558 000	463 553	0,20
			5 818 616	2,45
Produits chimiques spéciaux				
Braskem Idesa S.A.P.I., 6,99 %, 20/02/2032		555 000	411 033	0,17
CTEC II GmbH, 5,25 %, 15/02/2030	EUR	626 000	560 778	0,24
Univar Solutions USA, Inc., 5,125 %, 1/12/2027	USD	277 000	267 839	0,11
			1 239 650	0,52
Magasins spécialisés				
Dufry One B.V., 3,375 %, 15/04/2028	EUR	834 000	784 281	0,33
Group 1 Automotive, Inc., 4 %, 15/08/2028	USD	545 000	479 306	0,20
Michael Cos., Inc., 5,25 %, 1/05/2028		275 000	229 325	0,10
Michael Cos., Inc., 7,875 %, 1/05/2029		395 000	300 200	0,13
Penske Automotive Group Co., 3,75 %, 15/06/2029		623 000	526 828	0,22
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp., 7,75 %, 15/02/2029		440 000	432 406	0,18
			2 752 346	1,16
Hypermarchés				
Albertsons Cos. LLC/Safeway, Inc., 4,625 %, 15/01/2027		527 000	499 622	0,21
Albertsons Cos. LLC/Safeway, Inc., 3,5 %, 15/03/2029		440 000	379 500	0,16
			879 122	0,37
Télécommunications mobiles				
Altice France Holding S.A., 4 %, 15/02/2028	EUR	520 000	380 459	0,16
Altice France S.A., 6 %, 15/02/2028	USD	745 000	502 660	0,21
Cellnex Finance Co. S.A., 1,5 %, 8/06/2028	EUR	1 000 000	935 152	0,39
Cellnex Finance Co. S.A., 2 %, 15/02/2033		1 000 000	847 325	0,36
Cellnex Finance Co. S.A., 3,875 %, 7/07/2041	USD	240 000	177 158	0,07
Millicom International Cellular S.A., 5,125 %, 15/01/2028		1 022 400	910 355	0,38
PLT VII Finance S.à r.l., 4,625 %, 5/01/2026	EUR	745 000	771 342	0,33
PPF Telecom Group B.V., 2,125 %, 31/01/2025		330 000	339 476	0,14
PPF Telecom Group B.V., 3,25 %, 29/09/2027		1 165 000	1 158 814	0,49
SBA Communications Corp., 3,875 %, 15/02/2027	USD	491 000	453 456	0,19
SBA Communications Corp., 3,125 %, 1/02/2029		840 000	711 633	0,30
Sprint Capital Corp., 6,875 %, 15/11/2028		830 000	887 965	0,37
Sprint Corp., 7,625 %, 1/03/2026		540 000	571 140	0,24

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Télécommunications mobiles, suite				
Turkcell Iletisim Hizmetleri A.S., 5,8 %, 11/04/2028	USD	535 000	465 450	0,20
Vodafone Group PLC, 3 %, 27/08/2080	EUR	1 345 000	1 200 846	0,51
WP/AP Telecom Holdings III B.V., 5,5 %, 15/01/2030		870 000	790 299	0,33
			11 103 530	4,67
Tabac				
Vector Group Ltd., 5,75 %, 1/02/2029	USD	270 000	235 437	0,10
Transports				
Hidrovias International Finance S.à r.l., 4,95 %, 8/02/2031		560 000	429 929	0,18
Transports - Services				
Arena Luxembourg Finance S.à r.l., 1,875 %, 1/02/2028	EUR	1 420 000	1 274 986	0,53
Cliffton Ltd., 6,25 %, 25/10/2025	USD	825 000	783 750	0,33
Q-Park Holding I B.V., 1,5 %, 1/03/2025	EUR	1 335 000	1 347 574	0,57
			3 406 310	1,43
Services publics - Énergie électrique				
Adani Green Energy (UP) Ltd./Prayatna Developers Private Ltd., 6,25 %, 10/12/2024	USD	942 000	879 556	0,37
AES Gener S.A., 7,125 %, 26/03/2079		655 000	634 204	0,27
Azure Power Energy Ltd., 3,575 %, 19/08/2026		572 257	431 883	0,18
Azure Power Solar Energy Private Ltd., 5,65 %, 24/12/2024		470 000	398 504	0,17
Calpine Corp., 4,5 %, 15/02/2028		664 000	612 713	0,26
Calpine Corp., 5,125 %, 15/03/2028		630 000	570 409	0,24
Clearway Energy Operating LLC, 4,75 %, 15/03/2028		315 000	297 108	0,12
Clearway Energy Operating LLC, 3,75 %, 15/02/2031		1 123 000	948 744	0,40
ContourGlobal Power Holdings S.A., 2,75 %, 1/01/2026	EUR	805 000	799 761	0,34
Electricidad Firme de Mexico Holdings S.A. de C.V., 4,9 %, 20/11/2026	USD	1 061 000	953 793	0,40
Empresa Generadora de Electricidad Haina S.A., 5,625 %, 8/11/2028		655 000	591 511	0,25
Greenko Dutch B.V. (République de l'Inde), 3,85 %, 29/03/2026		826 075	737 735	0,31
Investment Energy Resources Ltd., 6,25 %, 26/04/2029		838 000	799 926	0,34
Mercury Chile Holdco LLC, 6,5 %, 24/01/2027		806 000	774 364	0,32
NextEra Energy, Inc., 4,25 %, 15/07/2024		94 000	91 806	0,04
NextEra Energy, Inc., 4,25 %, 15/09/2024		95 000	88 587	0,04
NextEra Energy, Inc., 4,5 %, 15/09/2027		395 000	371 782	0,16
Public Power Corp. S.A., 3,875 %, 30/03/2026	EUR	1 075 000	1 104 264	0,46
ReNew Power, 4,5 %, 14/07/2028	USD	891 000	766 564	0,32
SCC Power PLC, 8 % (8 % cash or 4 % PIK) jusqu'au 15/06/2024, 8 % liquidités au 31/12/2028 (p)		1 130 951	347 089	0,15
SCC Power PLC, 4 % (4 % cash or 4 % PIK) jusqu'au 15/06/2024, 4 % liquidités au 17/05/2032 (p)		612 598	25 116	0,01
TermoCandelaria Power Ltd., 7,875 %, 30/01/2029		716 879	675 658	0,28
TerraForm Global Operating LLC, 6,125 %, 1/03/2026		450 000	426 375	0,18
TerraForm Global Operating LLC, 6,125 %, 1/03/2026		1 029 000	974 977	0,41
TerraForm Power Operating LLC, 5 %, 31/01/2028		880 000	826 604	0,35
TerraForm Power Operating LLC, 4,75 %, 15/01/2030		250 000	224 996	0,09
			15 354 029	6,46
Services publics - Gaz				
EP Infrastructure A.S., 2,045 %, 9/10/2028	EUR	454 000	368 903	0,15
EP Infrastructure A.S., 1,816 %, 2/03/2031		830 000	610 834	0,26
			979 737	0,41
Services publics - Eau				
Aegea Finance S.à r.l., 6,75 %, 20/05/2029	USD	1 061 000	1 054 846	0,44
Total des obligations (coût identifié, 254 077 639 $)			**223 396 416**	**94,01**
ACTIONS ORDINAIRES				
Télévision par câble				
Intelsat Emergence S.A.		6 918	159 114	0,07
Construction				
ICA Tenedora, S.A. de C.V. (b)		570 080	514 663	0,22

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Prix d'exercice	Premier exercice	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite					
Services pétroliers					
LTRI Holdings LP			1 240	415 450	0,17
Total des actions ordinaires (coût identifié, 1 056 612 $)				1 089 227	0,46
CERTIFICATS DE VALEUR GARANTIE					
Télévision par câble					
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Series A, 5/12/2025			724	4 163	0,00
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Series B, 5/12/2025			724	2 715	0,00
Total des certificats de valeur garantie (coût identifié, 0 $)				6 878	0,00
WARRANTS					
Autres banques et établissements financiers diversifiés					
Avation Capital S.A. (1 action contre 1 warrant, Expiration 31/10/26) (coût identifié, 0 $)	GBP 1,14	24/06/22	8 313	3 587	0,00
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)					
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 8 784 000 $)		USD	8 784 000	8 784 000	3,70
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT					
Produits et services spécialisés					
iShares iBoxx $ High Yield Corporate Bond ETF (coût identifié, 2 819 929 $)			30 000	2 763 081	1,16
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 266 738 180 $) (k)				236 043 189	99,33
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF				1 603 782	0,67
ACTIF NET				237 646 971	100,00

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

MFS Meridian Funds - Global Intrinsic Value Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Compagnies aériennes			
Ryanair Holdings PLC, ADR	4 001	362 210	0,38
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	19 122	829 824	0,87
Pernod Ricard S.A.	3 510	726 242	0,76
		1 556 066	1,63
Industrie de la confection			
Adidas AG	1 562	250 270	0,26
Compagnie Financiere Richemont S.A.	5 359	826 282	0,86
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	750	655 188	0,69
		1 731 740	1,81
Industrie automobile			
Knorr-Bremse AG	5 060	330 939	0,35
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Charles Schwab Corp.	18 663	1 444 889	1,51
CME Group, Inc.	7 451	1 316 294	1,38
Deutsche Boerse AG	7 405	1 323 197	1,39
		4 084 380	4,28
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	3 487	973 047	1,02
Equifax, Inc.	4 028	895 022	0,94
Experian PLC	21 779	796 250	0,83
Ferguson PLC	4 712	670 706	0,70

MFS Meridian Funds - Global Intrinsic Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Services aux entreprises, suite			
Intertek Group PLC	6 337	340 615	0,36
SGS S.A.	275	670 388	0,70
Verisk Analytics, Inc., "A"	3 973	722 252	0,76
		5 068 280	5,31
Produits chimiques			
Givaudan S.A.	227	736 778	0,77
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	2 115	783 269	0,82
Altair Engineering, Inc., "A"	11 292	599 605	0,63
ANSYS, Inc.	4 716	1 256 154	1,32
Autodesk, Inc.	1 764	379 542	0,40
Cadence Design Systems, Inc.	10 629	1 943 300	2,03
Dassault Systemes SE	14 167	526 541	0,55
Kinaxis, Inc.	5 826	677 157	0,71
LiveRamp Holdings, Inc.	5 398	144 450	0,15
Microsoft Corp.	6 239	1 546 087	1,62
Salesforce, Inc.	4 263	716 056	0,75
Synopsys, Inc.	4 925	1 742 219	1,82
		10 314 380	10,80
Logiciels - Systèmes			
Cap Gemini S.A.	4 961	940 795	0,98
Samsung Electronics Co. Ltd.	18 217	910 557	0,95
Workday, Inc.	2 826	512 721	0,54
		2 364 073	2,47
Construction			
Geberit AG	562	321 273	0,34
Martin Marietta Materials, Inc.	2 675	962 037	1,01
Otis Worldwide Corp.	12 882	1 059 287	1,11
Sherwin-Williams Co.	2 481	586 980	0,61
Vulcan Materials Co.	7 478	1 370 942	1,43
Watsco, Inc.	2 717	780 784	0,82
		5 081 303	5,32
Biens de consommation			
Colgate-Palmolive Co.	28 892	2 153 321	2,25
Estee Lauder Cos., Inc., "A"	1 981	548 896	0,57
L'Oréal S.A.	2 239	924 891	0,97
Lion Corp.	27 500	304 260	0,32
Reckitt Benckiser Group PLC	11 700	833 177	0,87
ROHTO Pharmaceutical Co. Ltd.	43 300	797 373	0,84
Svenska Cellulosa Aktiebolaget	34 300	475 962	0,50
		6 037 880	6,32
Équipements électriques			
Johnson Controls International PLC	12 153	845 484	0,88
Legrand S.A.	14 672	1 311 419	1,37
Rockwell Automation, Inc.	3 750	1 057 613	1,11
Schneider Electric SE	9 649	1 564 656	1,64
		4 779 172	5,00
Électronique			
Analog Devices, Inc.	8 725	1 496 076	1,57
Applied Materials, Inc.	4 164	464 244	0,49
KLA Corp.	1 567	615 016	0,64
Lam Research Corp.	947	473 595	0,49
Micron Technology, Inc.	2 071	124 881	0,13
Power Integrations, Inc.	2 783	239 588	0,25
Sensirion Holding AG	4 973	592 068	0,62

MFS Meridian Funds - Global Intrinsic Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Électronique, suite			
Silicon Laboratories, Inc.	3 350	525 649	0,55
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	11 583	1 074 092	1,12
Texas Instruments, Inc.	3 330	590 109	0,62
		6 195 318	6,48
Énergie - Sociétés indépendantes			
Woodside Energy Group Ltd.	62 028	1 610 162	1,69
Énergie - Sociétés intégrées			
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	45 294	467 434	0,49
TotalEnergies SE	29 765	1 849 220	1,93
		2 316 654	2,42
Alimentation et boissons			
Chocoladefabriken Lindt & Sprungli AG	86	945 112	0,99
Ezaki Glico Co. Ltd.	11 100	310 048	0,32
Nestlé S.A.	15 746	1 921 507	2,01
Toyo Suisan Kaisha Ltd.	12 600	522 559	0,55
		3 699 226	3,87
Assurances			
Aon PLC	5 635	1 795 762	1,88
Marsh & McLennan Cos., Inc.	6 982	1 221 221	1,28
		3 016 983	3,16
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	11 438	1 130 532	1,18
Machines et outils			
BELIMO Holding AG	865	454 467	0,48
Epiroc AB	33 065	643 234	0,67
Graco, Inc.	7 210	492 587	0,52
IDEX Corp.	2 649	634 912	0,67
Ingersoll Rand, Inc.	9 356	523 936	0,55
King Slide Works Co. Ltd.	25 000	337 307	0,35
MSA Safety Inc.	2 261	308 378	0,32
Nordson Corp.	1 533	372 979	0,39
Pentair PLC	5 231	289 693	0,30
RBC Bearings, Inc.	2 640	644 081	0,67
Regal Rexnord Corp.	2 941	409 387	0,43
Schindler Holding AG	4 458	949 665	0,99
SFS Group AG	2 649	304 898	0,32
SMC Corp.	1 200	610 046	0,64
Spirax-Sarco Engineering PLC	4 622	659 918	0,69
VAT Group AG	768	239 581	0,25
Watts Water Technologies, "A"	9 455	1 546 082	1,62
		9 421 151	9,86
Grandes banques			
Bank of Ireland Group PLC	95 519	1 018 868	1,06
Resona Holdings, Inc.	197 900	1 096 054	1,15
		2 114 922	2,21
Équipements médicaux			
Agilent Technologies, Inc.	9 553	1 452 820	1,52
Bio-Techne Corp.	4 021	320 313	0,33
Bruker BioSciences Corp.	18 391	1 289 577	1,35
Danaher Corp.	3 305	873 776	0,91
Envista Holdings Corp.	15 989	623 411	0,65
EssilorLuxottica	3 061	560 115	0,59
Maravai Lifesciences Holdings, Inc., "A"	14 806	217 056	0,23
Nakanishi, Inc.	33 600	712 607	0,75
Shimadzu Corp.	23 900	732 255	0,77
		6 781 930	7,10

MFS Meridian Funds - Global Intrinsic Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Métaux et exploitation minière				
Glencore PLC		89 785	602 821	0,63
Gaz naturel - Distribution				
Gaztransport & Technigaz S.A.		3 039	335 341	0,35
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
AIB Group PLC		69 280	289 930	0,30
CaixaBank S.A.		159 058	704 457	0,74
Chiba Bank Ltd.		74 600	563 785	0,59
Moody's Corp.		3 980	1 284 545	1,35
S&P Global, Inc.		1 711	641 522	0,67
			3 484 239	3,65
Produits pharmaceutiques				
Bayer AG		8 727	541 311	0,57
Métaux et minéraux précieux				
Agnico Eagle Mines Ltd.		7 684	433 938	0,46
Franco-Nevada Corp.		11 460	1 680 995	1,76
Wheaton Precious Metals Corp.		17 368	794 412	0,83
			2 909 345	3,05
Imprimerie et édition				
Wolters Kluwer N.V.		5 765	628 309	0,66
Immobilier				
CBRE Group, Inc., "A"		4 633	396 168	0,41
LEG Immobilien SE		3 064	238 843	0,25
TAG Immobilien AG		17 691	151 471	0,16
Vonovia SE, REIT		7 392	207 897	0,22
			994 379	1,04
Produits chimiques spéciaux				
Corteva, Inc.		6 897	444 512	0,47
Novozymes A.S.		20 392	1 061 542	1,11
Sika AG		3 235	921 009	0,96
Symrise AG		5 206	551 708	0,58
			2 978 771	3,12
Magasins spécialisés				
Amazon.com, Inc.		4 160	429 021	0,45
Costco Wholesale Corp.		3 100	1 584 534	1,66
Zalando SE		6 094	282 596	0,29
			2 296 151	2,40
Total des actions ordinaires (coût identifié, 95 766 264 $)			**93 504 746**	**97,88**
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 2 158 000 $)	USD	2 158 000	2 158 000	2,26
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 97 924 264 $) (k)			**95 662 746**	**100,14**
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			**(129 995)**	**(0,14)**
ACTIF NET			**95 532 751**	**100,00**

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

MFS Meridian Funds - Global New Discovery Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Howmet Aerospace, Inc.	2 461	100 138	1,65
Singapore Technologies Engineering Ltd.	13 700	38 565	0,63
Teledyne Technologies, Inc.	70	29 698	0,49
		168 401	2,77
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	3 266	99 337	1,64
Skechers USA, Inc., "A"	1 470	70 781	1,16
		170 118	2,80
Industrie automobile			
Koito Manufacturing Co. Ltd.	2 500	42 227	0,70
LKQ Corp.	2 217	130 714	2,15
		172 941	2,85
Biotechnologies			
Abcam PLC, ADR	3 034	42 082	0,69
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
B3 Brasil Bolsa Balcao S.A.	23 140	59 077	0,97
Cboe Global Markets, Inc.	640	78 643	1,30
Euronext N.V.	1 179	95 551	1,57
		233 271	3,84
Services aux entreprises			
Gruppo Mutuionline S.p.A.	1 015	32 538	0,54
Keywords Studios PLC	1 868	65 404	1,08
NS Solutions Corp.	4 300	110 784	1,82
RS Group PLC	7 615	88 713	1,46
Thoughtworks Holding, Inc.	4 305	46 494	0,76
WNS (Holdings) Ltd., ADR	1 084	91 847	1,51
		435 780	7,17
Télévision par câble			
Cable One, Inc.	59	46 603	0,77
Produits chimiques			
Borregaard ASA	3 018	46 546	0,77
Element Solutions, Inc.	4 434	90 808	1,49
IMCD Group N.V.	395	62 644	1,03
UPL Ltd.	6 757	62 701	1,03
		262 699	4,32
Logiciels			
Black Knight, Inc.	1 098	66 528	1,09
Dun & Bradstreet Holdings, Inc.	2 211	32 391	0,53
Kinaxis, Inc.	327	38 007	0,63
OBIC Co. Ltd.	200	32 001	0,53
Oracle Corp. Japan	600	41 047	0,68
Paycor HCM, Inc.	1 606	40 327	0,66
Sabre Corp.	6 443	43 877	0,72
SimCorp A/S	520	36 303	0,60
		330 481	5,44
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	619	38 940	0,64
Cancom SE	825	28 343	0,47
Kardex AG	201	39 174	0,64
Nagarro SE	281	38 308	0,63
Nuvei Corp.	1 173	41 442	0,68
Rapid7, Inc.	776	30 939	0,51
		217 146	3,57
Construction			
AZEK Co., Inc.	2 558	61 724	1,01

MFS Meridian Funds - Global New Discovery Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Construction, suite			
Breedon Group PLC	75 610	63 853	1,05
Masco Corp.	1 459	77 619	1,28
		203 196	3,34
Services de consommation			
Boyd Group Services, Inc.	345	52 760	0,87
Bright Horizons Family Solutions, Inc.	646	49 600	0,82
		102 360	1,69
Conteneurs			
Mayr-Melnhof Karton AG	248	41 467	0,68
Verallia	1 685	62 063	1,02
		103 530	1,70
Équipements électriques			
Sensata Technologies Holding PLC	1 870	95 089	1,57
Électronique			
ASM International N.V.	223	75 588	1,24
Énergie - Sociétés indépendantes			
Diamondback Energy, Inc.	541	79 051	1,30
Ingénierie - Construction			
Jacobs Solutions, Inc.	446	55 103	0,91
Divertissement			
CTS Eventim AG	1 021	71 372	1,18
Lottery Corp. Ltd.	15 144	50 470	0,83
Vivid Seats, Inc., "A"	5 170	43 997	0,72
		165 839	2,73
Alimentation et boissons			
Bakkafrost P/f	785	48 656	0,80
Cranswick PLC	2 805	110 038	1,81
S Foods, Inc.	1 900	43 431	0,72
		202 125	3,33
Jeux et hôtellerie			
Penn Entertainment, Inc.	1 679	59 521	0,98
Assurances			
Arthur J. Gallagher & Co.	231	45 211	0,74
AUB Group Ltd.	6 263	104 919	1,73
		150 130	2,47
Internet			
Auto Trader Group PLC	5 062	39 287	0,65
Cian PLC, ADR (c)	3 560	0	0,00
Scout24 AG	791	45 903	0,75
		85 190	1,40
Machines et outils			
Azbil Corp.	1 000	28 227	0,47
Fujitec Co. Ltd.	1 900	47 051	0,78
IDEX Corp.	259	62 077	1,02
Ingersoll Rand, Inc.	1 479	82 824	1,36
Ritchie Bros. Auctioneers, Inc.	1 188	71 838	1,18
SIG Combibloc Group AG	1 671	41 436	0,68
VAT Group AG	87	27 140	0,45
Wabtec Corp.	427	44 327	0,73
Zurn Elkay Water Solutions Corp.	1 559	34 080	0,56
		439 000	7,23
Technologies et services médicaux et de santé			
AS ONE Corp.	700	31 403	0,52
ICON PLC	491	113 279	1,86

MFS Meridian Funds - Global New Discovery Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Technologies et services médicaux et de santé, suite			
Selcuk Ecza Deposu Ticaret ve Sanayi A.S.	23 924	49 223	0,81
		193 905	3,19
Équipements médicaux			
Bruker BioSciences Corp.	957	67 105	1,10
Envista Holdings Corp.	1 992	77 668	1,28
Gerresheimer AG	1 054	77 661	1,28
STERIS PLC	525	108 418	1,79
		330 852	5,45
Services pétroliers			
ChampionX Corp.	2 606	86 050	1,42
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Allfunds Group PLC	3 897	31 154	0,52
Shizuoka Financial Group, Inc.	9 800	82 742	1,36
		113 896	1,88
Lutte contre la pollution			
Daiseki Co. Ltd.	1 600	53 764	0,88
GFL Environmental, Inc.	4 285	132 235	2,18
		185 999	3,06
Imprimerie et édition			
Wolters Kluwer N.V.	538	58 635	0,97
Immobilier			
Big Yellow Group PLC, REIT	2 937	43 924	0,72
Catena AB	883	36 910	0,61
LEG Immobilien SE	419	32 662	0,54
Sun Communities, Inc., REIT	467	73 254	1,20
Tritax Big Box PLC, REIT	24 573	47 422	0,78
Unite Group PLC, REIT	5 354	66 019	1,09
		300 191	4,94
Restaurants			
Sodexo	386	38 243	0,63
Yum China Holdings, Inc.	991	61 055	1,00
		99 298	1,63
Produits chimiques spéciaux			
Axalta Coating Systems Ltd.	3 361	101 166	1,66
Croda International PLC	427	36 386	0,60
Essentra PLC	25 678	68 581	1,13
Symrise AG	841	89 125	1,47
		295 258	4,86
Magasins spécialisés			
Burlington Stores, Inc.	337	77 453	1,27
Just Eat Takeaway	1 506	38 786	0,64
Leslie's, Inc.	2 346	36 339	0,60
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios S.A.	11 575	54 246	0,89
Musti Group OY	2 860	48 318	0,80
NISHIMATSUYA CHAIN Co., Ltd.	3 100	36 727	0,60
		291 869	4,80
Services téléphoniques			
Wireless Infrastructure Italian S.p.A.	5 727	62 787	1,03
Total des actions ordinaires (coût identifié, 6 423 896 $)		5 913 984	97,34

MFS Meridian Funds - Global New Discovery Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 185 000 $)	USD	185 000	185 000	3,05
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 6 608 896 $) (k)			6 098 984	100,39
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			(23 649)	(0,39)
ACTIF NET			6 075 335	100,00

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

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Aérospatiale et défense				
Raytheon Technologies Corp., 2,82 %, 1/09/2051	USD	870 000	614 842	0,18
Compagnies aériennes				
EasyJet Finco B.V., 1,875 %, 3/03/2028	EUR	500 000	464 154	0,13
Boissons alcoolisées				
Pernod Ricard S.A., 3,75 %, 2/11/2032		300 000	332 330	0,10
Industrie de la confection				
Tapestry, Inc., 3,05 %, 15/03/2032	USD	431 000	353 286	0,10
Créances adossées à des actifs et titrisées				
AA Bond Co. Ltd., 3,25 %, 31/07/2028	GBP	330 000	325 204	0,09
ACREC 2021-FL1 Ltd., "C", FLR, 6,62 %, 16/10/2036	USD	1 022 500	975 898	0,28
ACRES 2021-FL2 Issuer Ltd., "AS", FLR, 6,214 %, 15/01/2037		643 000	627 753	0,18
ACRES 2021-FL2 Issuer Ltd., "B", FLR, 6,714 %, 15/01/2037		1 049 000	1 013 722	0,29
Allegro CLO Ltd., 2016-1A, "BR2", FLR, 6,342 %, 15/01/2030		759 774	745 043	0,21
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2020-FL1, "C", FLR, 6,647 %, 15/02/2035		1 775 000	1 743 256	0,50
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "C", FLR, 6,423 %, 15/12/2035		204 000	193 190	0,06
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL2, "C", FLR, 6,404 %, 15/05/2036		851 000	795 369	0,23
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2022-FL1, "C", FLR, 6,578 %, 15/01/2037		1 290 500	1 217 275	0,35
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2022-FL1, "D", FLR, 7,278 %, 15/01/2037		825 000	776 019	0,22
AREIT 2022-CRE6 Trust, "C", FLR, 6,46 %, 16/01/2037		252 000	234 525	0,07
AREIT 2022-CRE6 Trust, "D", FLR, 7,16 %, 17/12/2024		269 000	248 977	0,07
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "B", FLR, 6,504 %, 15/12/2038		306 500	286 248	0,08
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "C", FLR, 6,754 %, 15/12/2038		277 500	257 281	0,07
Business Jet Securities LLC, 2020-1A, "A", 2,981 %, 15/11/2035		339 509	311 510	0,09
Business Jet Securities LLC, 2021-1A, "A", 2,162 %, 15/04/2036		439 709	395 166	0,11
Capital Automotive, 2020-1A, "A4", REIT, 3,19 %, 15/02/2050		346 501	327 329	0,09
Commercial Mortgage Pass-Through Certificates, 2020-BNK28, "AS", 2,14 %, 15/03/2063		524 000	416 016	0,12
Fortress CBO Investments Ltd., 2022-FL3, "AS", FLR, 6,56 %, 23/02/2039		449 000	431 264	0,12
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "AS", FLR, 6,204 %, 15/07/2036		2 000 000	1 896 338	0,54
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "B", FLR, 6,454 %, 15/07/2036		845 500	798 686	0,23
MF1 2020-FL4 Ltd., "AS", FLR, 6,697 %, 15/11/2035		634 000	633 216	0,18
MF1 2021-FL5 Ltd., "C", FLR, 6,297 %, 15/07/2036		662 500	618 322	0,18
MF1 2021-FL6 Ltd., "AS", FLR, 5,92 %, 16/07/2036		1 500 000	1 430 748	0,41
MF1 2021-FL6 Ltd., "B", FLR, 6,12 %, 16/07/2036		2 600 000	2 468 719	0,71
MF1 2022-FL8 Ltd., "C", FLR, 6,509 %, 19/02/2037		446 286	418 231	0,12
PFP III 2021-7 Ltd., "AS", FLR, 5,609 %, 14/04/2038		871 956	822 708	0,24
PFP III 2021-7 Ltd., "B", FLR, 5,854 %, 14/04/2038		545 473	510 562	0,15
PFP III 2021-7 Ltd., "C", FLR, 6,104 %, 14/04/2038		510 475	475 040	0,14
PFP III 2021-8 Ltd., "B", FLR, 5,954 %, 9/08/2037		461 000	433 361	0,13
RAC Bond Co. PLC, 4,87 %, 6/05/2026	GBP	210 000	243 428	0,07
Shelter Growth CRE 2021-FL3 Ltd., "C", FLR, 6,604 %, 15/09/2036	USD	687 500	648 109	0,19

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Créances adossées à des actifs et titrisées, suite				
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "B", FLR, 6,27 %, 18/04/2038	USD	1 147 000	1 086 238	0,31
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "C", FLR, 6,57 %, 18/04/2038		238 000	223 062	0,06
TPG Real Estate Finance, 2021-FL4, "B", FLR, 6,314 %, 15/03/2038		800 000	759 899	0,22
Westlake Automobile Receivable Trust, 2023-1A, "A2B", FLR, 5,25 %, 15/06/2026		166 000	165 999	0,05
			24 953 711	7,16
Industrie automobile				
Hyundai Capital America, 2 %, 15/06/2028		742 000	628 977	0,18
Mercedes-Benz Financial Services (Canada), 3 %, 23/02/2027	EUR	250 000	268 869	0,08
RAC Bond Co. PLC, 5,25 %, 4/11/2027	GBP	700 000	704 325	0,20
TI Automotive Finance PLC, 3,75 %, 15/04/2029	EUR	1 230 000	1 029 640	0,29
			2 631 811	0,75
Radio-télévision				
Discovery, Inc., 4,125 %, 15/05/2029	USD	672 000	617 764	0,18
Prosus N.V., 2,085 %, 19/01/2030	EUR	440 000	389 376	0,11
Prosus N.V., 4,027 %, 3/08/2050	USD	600 000	405 568	0,12
Summer (BC) Holdco S.à r.l., "A", 9,25 %, 31/10/2027	EUR	765 895	675 398	0,19
Ubisoft Entertainment S.A., 0,878 %, 24/11/2027		200 000	163 904	0,05
Warnermedia Holdings, Inc., 4,279 %, 15/03/2032	USD	413 000	367 551	0,10
Weibo Corp., 3,375 %, 8/07/2030		200 000	167 085	0,05
WMG Acquisition Corp., 2,25 %, 15/08/2031	EUR	1 036 000	878 790	0,25
			3 665 436	1,05
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Ameriprise Financial, Inc., 4,5 %, 13/05/2032	USD	75 000	75 128	0,02
Low Income Investment Fund, 3,386 %, 1/07/2026		85 000	81 843	0,03
Low Income Investment Fund, 3,711 %, 1/07/2029		230 000	212 258	0,06
			369 229	0,11
Construction				
Holcim Sterling Finance (Netherlands) B.V., 2,25 %, 4/04/2034	GBP	520 000	474 144	0,14
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 5,25 %, 15/07/2028	USD	770 000	708 823	0,20
Standard Industries, Inc., 4,75 %, 15/01/2028		635 000	595 090	0,17
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030		574 000	524 493	0,15
			2 302 550	0,66
Services aux entreprises				
Entegris Escrow Corp., 5,95 %, 15/06/2030		795 000	763 462	0,22
Euronet Worldwide, Inc., 1,375 %, 22/05/2026	EUR	330 000	319 231	0,09
Fiserv, Inc., 4,4 %, 1/07/2049	USD	296 000	254 069	0,08
Mastercard, Inc., 3,3 %, 26/03/2027		223 000	216 574	0,06
Mastercard, Inc., 3,85 %, 26/03/2050		193 000	175 269	0,05
Visa, Inc., 3,65 %, 15/09/2047		366 000	322 756	0,09
			2 051 361	0,59
Télévision par câble				
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,5 %, 15/08/2030		1 105 000	944 178	0,27
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 4,908 %, 23/07/2025		395 000	392 970	0,11
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 4,8 %, 1/03/2050		238 000	187 414	0,05
Comcast Corp., 3,75 %, 1/04/2040		573 000	506 359	0,15
SES S.A., 3,5 %, 14/01/2029	EUR	400 000	407 267	0,12
Virgin Media Finance PLC, 3,75 %, 15/07/2030		985 000	859 677	0,25
VTR Comunicaciones S.p.A., 5,125 %, 15/01/2028	USD	696 000	487 733	0,14
Ziggo Bond Finance B.V., 3,375 %, 28/02/2030	EUR	1 010 000	847 923	0,24
			4 633 521	1,33
Produits chimiques				
Arkema S.A., 3,5 %, 23/01/2031		400 000	425 174	0,12
Axalta Coating Systems Ltd., 3,375 %, 15/02/2029	USD	930 000	799 800	0,23
LYB International Finance III, LLC, 4,2 %, 1/05/2050		450 000	365 182	0,10
Sasol Financing (USA) LLC, 4,375 %, 18/09/2026		290 000	266 829	0,08

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Produits chimiques, suite				
Sherwin-Williams Co., 3,8 %, 15/08/2049	USD	102 000	81 177	0,02
Synthos S.A., 2,5 %, 7/06/2028	EUR	476 000	408 346	0,12
			2 346 508	0,67
Logiciels				
Microsoft Corp., 3,3 %, 6/02/2027	USD	527 000	513 121	0,15
Microsoft Corp., 2,525 %, 1/06/2050		301 000	214 497	0,06
Microsoft Corp., 2,675 %, 1/06/2060		58 000	40 242	0,01
			767 860	0,22
Logiciels - Systèmes				
Apple, Inc., 2,05 %, 11/09/2026		751 000	696 576	0,20
Apple, Inc., 3,2 %, 11/05/2027		412 000	397 515	0,11
Apple, Inc., 4,5 %, 23/02/2036		405 000	415 034	0,12
			1 509 125	0,43
Conglomérats				
ABB Finance B.V., 3,25 %, 16/01/2027	EUR	250 000	272 363	0,08
ABB Finance B.V., 3,375 %, 16/01/2031		250 000	269 274	0,08
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028	USD	453 000	459 893	0,13
TriMas Corp., 4,125 %, 15/04/2029		1 177 000	1 047 824	0,30
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,95 %, 15/09/2028		870 000	864 202	0,25
			2 913 556	0,84
Biens de consommation				
JAB Holdings B.V., 2,25 %, 19/12/2039	EUR	700 000	542 426	0,16
Services de consommation				
Booking Holdings, Inc., 4,75 %, 15/11/2034		386 000	446 064	0,13
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPFG, 0 %, 15/02/2043	USD	2 854 077	792 226	0,23
TriNet Group, Inc., 3,5 %, 1/03/2029		1 173 000	985 003	0,28
			2 223 293	0,64
Conteneurs				
ARD Finance S.A., 5 %, 30/06/2027 (p)	EUR	614 079	504 129	0,15
Ardagh Metal Packaging, 3 %, 1/09/2029		785 000	662 650	0,19
Can-Pack S.A./Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,125 %, 1/11/2025	USD	461 000	419 740	0,12
			1 586 519	0,46
Équipements électriques				
Arrow Electronics, Inc., 2,95 %, 15/02/2032		656 000	544 147	0,15
Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1,125 %, 8/02/2027	EUR	430 000	407 871	0,12
Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1 %, 26/05/2029		600 000	510 545	0,15
			1 462 563	0,42
Électronique				
Broadcom, Inc., 3,419 %, 15/04/2033	USD	932 000	781 899	0,22
SK hynix, Inc., 6,375 %, 17/01/2028		200 000	203 039	0,06
			984 938	0,28
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Banco de Reservas de la Republica Dominicana, 7 %, 1/02/2023		461 000	461 000	0,13
CEZ A.S. (République tchèque), 2,375 %, 6/04/2027	EUR	357 000	362 808	0,10
Comision Federal de Electricidad (États-Unis du Mexique), 3,348 %, 9/02/2031	USD	658 000	539 483	0,16
DAE Funding LLC (Émirats arabes unis), 3,375 %, 20/03/2028		424 000	383 618	0,11
Dua Capital Ltd. (Fédération de Malaisie), 2,78 %, 11/05/2031		1 278 000	1 042 350	0,30
Emirates NBD Bank PJSC, 6,125 % jusqu'au 9/07/2026, FLR jusqu'au 9/01/2170		500 000	500 000	0,14
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 7,125 %, 11/02/2025		542 000	519 019	0,15
Export-Import Bank of India, 2,25 %, 13/01/2031		543 000	439 016	0,13
Export-Import Bank of Korea, 5,125 %, 11/01/2033		200 000	209 512	0,06
Indian Railway Finance Corp., 2,8 %, 10/02/2031		406 000	337 410	0,10
Industrial and Commercial Bank of China, 4,875 %, 21/09/2025		500 000	498 731	0,14
Ipoteka Bank (République d'Ouzbékistan), 5,5 %, 19/11/2025		642 000	598 665	0,17
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 3,5 %, 14/04/2033		417 000	315 898	0,09

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations quasi souveraines des marchés émergents, suite				
NAK Naftogaz Ukraine via Standard Bank London Holdings PLC, 7,625 %, 8/11/2026	USD	878 000	179 990	0,05
Oryx Funding Ltd. (Sultanat d'Oman), 5,8 %, 3/02/2031		865 000	850 326	0,24
Petroleos Mexicanos, 5,95 %, 28/01/2031		950 000	760 516	0,22
Petroleos Mexicanos, 10 %, 7/02/2033		676 000	660 452	0,19
Petroleos Mexicanos, 7,69 %, 23/01/2050		300 000	223 980	0,06
PT Freeport Indonesia, 5,315 %, 14/04/2032		300 000	285 036	0,08
PT Pertamina (Persero) (République d'Indonésie), 5,625 %, 20/05/2043		563 000	540 592	0,16
Southern Gas Corridor CJSC (République d'Azerbaïdjan), 6,875 %, 24/03/2026		500 000	515 240	0,15
SPP-Distribucia A.S. (République de Slovaquie), 1 %, 9/06/2031	EUR	470 000	337 234	0,10
State Oil Company of the Azerbaijan Republic, 6,95 %, 18/03/2030	USD	643 000	672 788	0,19
			11 233 664	3,22
Obligations souveraines des marchés émergents				
République arabe d'Égypte, 7,5 %, 16/02/2061		786 000	509 077	0,15
République dominicaine, 7,05 %, 3/02/2031		289 000	289 000	0,08
République dominicaine, 5,3 %, 21/01/2041		537 000	429 783	0,12
République dominicaine, 5,875 %, 30/01/2060		625 000	480 076	0,14
République hellénique (République de Grèce), 1,75 %, 18/06/2032	EUR	5 117 000	4 525 903	1,30
République hellénique (République de Grèce), 4,25 %, 15/06/2033		3 439 000	3 726 073	1,07
République hellénique (République de Grèce), 1,875 %, 24/01/2052		910 000	585 731	0,17
Royaume du Maroc, 2 %, 30/09/2030		462 000	408 059	0,12
République orientale d'Uruguay, 8,25 %, 21/05/2031	UYU	159 788 000	3 709 519	1,06
République populaire de Chine, 3,03 %, 11/03/2026	CNY	38 170 000	5 730 122	1,64
République populaire de Chine, 3,13 %, 21/11/2029		22 230 000	3 355 593	0,96
République d'Angola, 9,125 %, 26/11/2049	USD	300 000	262 305	0,08
République du Bénin, 6,875 %, 19/01/2052	EUR	597 000	470 092	0,13
République de Côte d'Ivoire, 6,875 %, 17/10/2040		874 000	725 272	0,21
République du Guatemala, 6,125 %, 1/06/2050	USD	500 000	485 140	0,14
République de Hongrie, 6,125 %, 22/05/2028		369 000	381 515	0,11
République de Hongrie, 5,5 %, 16/06/2034		348 000	341 633	0,10
République d'Indonésie, 4,85 %, 11/01/2033		427 000	430 908	0,12
République de Corée, 2,125 %, 10/06/2027	KRW	4 312 000 000	3 330 754	0,95
République de Corée, 1,875 %, 10/06/2029		16 048 270 000	11 938 401	3,42
République de Corée, 1,375 %, 10/06/2030		11 873 470 000	8 388 056	2,41
République du Panama, 3,298 %, 19/01/2033	USD	577 000	481 331	0,14
République du Paraguay, 5,6 %, 13/03/2048		1 300 000	1 175 695	0,34
République des Philippines, 3,556 %, 29/09/2032		311 000	287 143	0,08
République de Pologne, 5,75 %, 16/11/2032		215 000	232 265	0,07
République de Roumanie, 2 %, 14/04/2033	EUR	600 000	444 453	0,13
République de Serbie, 1,65 %, 3/03/2033		345 000	246 929	0,07
République de Serbie, 2,05 %, 23/09/2036		223 000	147 468	0,04
Gouvernement international des Émirats arabes unis, 4,951 %, 7/07/2052	USD	416 000	418 608	0,12
États-Unis du Mexique, 7,5 %, 3/06/2027	MXN	140 300 000	7 082 838	2,03
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 29/05/2031		37 000 000	1 857 535	0,53
États-Unis du Mexique, 4,875 %, 19/05/2033	USD	351 000	336 969	0,10
États-Unis du Mexique, 6,35 %, 9/02/2035		200 000	212 309	0,06
États-Unis du Mexique, 3,771 %, 24/05/2061		200 000	136 046	0,04
			63 562 601	18,23
Énergie - Sociétés indépendantes				
Energean Israel Finance Ltd., 4,875 %, 30/03/2026		703 000	656 426	0,19
Medco Bell Pte. Ltd., 6,375 %, 30/01/2027		334 000	320 609	0,09
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 4 %, 15/08/2026		400 000	356 864	0,10
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 3,25 %, 15/08/2030		336 000	255 804	0,08
			1 589 703	0,46

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Énergie - Sociétés intégrées				
BP Capital Markets PLC, 3,625 % jusqu'au 22/06/2029, FLR jusqu'au 22/06/2170	EUR	460 000	442 549	0,13
Eni S.p.A., 4,25 %, 9/05/2029	USD	200 000	190 030	0,05
Galp Energia SGPS S.A., 2 %, 15/01/2026	EUR	400 000	407 655	0,12
MOL PLC, 1,5 %, 8/10/2027		330 000	301 977	0,08
			1 342 211	0,38
Ingénierie - Construction				
Bouygues S.A., 4,625 %, 7/06/2032		400 000	467 638	0,13
Établissements financiers				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,85 %, 29/10/2041	USD	264 000	205 956	0,06
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,25 %, 15/04/2026		181 000	171 885	0,05
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,375 %, 1/05/2026		486 000	461 883	0,13
CTP N.V., 1,5 %, 27/09/2031	EUR	640 000	471 750	0,13
EXOR N.V., 2,25 %, 29/04/2030		260 000	246 651	0,07
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)	USD	789 176	720 189	0,21
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		523 306	477 561	0,14
Grand City Properties S.A., 1,5 % jusqu'au 9/06/2026, FLR jusqu'au 9/12/2069	EUR	500 000	237 814	0,07
Logicor Financing S.à r.l., 1,625 %, 17/01/2030		550 000	455 198	0,13
Logicor Financing S.à r.l., 0,875 %, 14/01/2031		250 000	185 446	0,05
Nationstar Mortgage Holdings, Inc., 6 %, 15/01/2027	USD	732 000	678 930	0,19
P3 Group S.à r.l., 0,875 %, 26/01/2026	EUR	540 000	513 259	0,15
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 1,75 %, 14/01/2025		280 000	272 749	0,08
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,875 % jusqu'au 30/01/2027, FLR jusqu'au 30/01/2171		815 000	338 019	0,10
SBB Treasury Oyj, 0,75 %, 14/12/2028		247 000	178 570	0,05
SBB Treasury Oyj, 1,125 %, 26/11/2029		350 000	251 132	0,07
VGP N.V., 1,5 %, 8/04/2029		600 000	444 790	0,13
Vonovia SE, REIT, 1,625 %, 1/09/2051		300 000	172 522	0,05
			6 484 304	1,86
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4,375 %, 15/04/2038	USD	581 000	551 008	0,16
Central American Bottling Corp., 5,25 %, 27/04/2029		539 000	517 596	0,15
Constellation Brands, Inc., 4,75 %, 1/12/2025		307 000	306 942	0,09
Constellation Brands, Inc., 3,15 %, 1/08/2029		293 000	267 372	0,08
Constellation Brands, Inc., 2,25 %, 1/08/2031		533 000	439 769	0,12
JBS USA LLC/JBS USA Finance, Inc., 3,625 %, 15/01/2032		552 000	461 141	0,13
Kraft Heinz Foods Co., 3,875 %, 15/05/2027		589 000	573 806	0,16
			3 117 634	0,89
Jeux et hôtellerie				
Las Vegas Sands Corp., 3,9 %, 8/08/2029		521 000	466 886	0,13
Marriott International, Inc., 2,85 %, 15/04/2031		434 000	369 387	0,11
VICI Properties LP, REIT, 4,95 %, 15/02/2030		320 000	309 456	0,09
			1 145 729	0,33
Industrie				
Albion Financing 1 S.à r.l., 5,25 %, 15/10/2026	EUR	800 000	778 417	0,22
Dar Al-Arkan Sukuk Co. Ltd., 6,875 %, 26/02/2027	USD	600 000	585 617	0,17
Investor AB, 2,75 %, 10/06/2032	EUR	125 000	128 802	0,04
Trustees of the University of Pennsylvania, 2,396 %, 1/10/2050	USD	264 000	179 857	0,05
			1 672 693	0,48
Assurances				
AIA Group Ltd., 0,88 % jusqu'au 9/09/2028, FLR jusqu'au 9/09/2033	EUR	590 000	517 317	0,15
Argentum Netherlands B.V., 5,125 %, 1/06/2048	USD	330 000	312 186	0,09
ASR Nederland N.V., 7 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2043	EUR	390 000	450 785	0,13
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042	USD	484 000	419 997	0,12
Equitable Holdings, Inc., 5,594 %, 11/01/2033		394 000	403 396	0,11
			2 103 681	0,60

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Assurances - Santé				
UnitedHealth Group, Inc., 4,625 %, 15/07/2035	USD	524 000	529 218	0,15
UnitedHealth Group, Inc., 3,25 %, 15/05/2051		229 000	179 171	0,05
			708 389	0,20
Assurances IARD				
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 2,6 %, 2/12/2031		479 000	406 126	0,12
QBE Insurance Group Ltd., 2,5 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2038	GBP	394 000	378 618	0,11
			784 744	0,23
Obligations quasi souveraines du marché international				
Caixa Geral de Depositos S.A. (République portugaise), 5,75 %, 31/10/2028	EUR	400 000	452 916	0,13
Electricite de France S.A., 2,625 % jusqu'au 1/06/2028, FLR jusqu'au 29/12/2049		200 000	178 140	0,05
Electricite de France S.A., 2,875 % jusqu'au 15/03/2027, FLR jusqu'au 15/03/2070		400 000	371 805	0,11
Electricite de France S.A., 5,875 % jusqu'au 22/01/2029, FLR jusqu'au 31/12/2165	GBP	200 000	210 817	0,06
EnBW International Finance B.V., 3,5 %, 24/07/2028	EUR	130 000	140 116	0,04
EnBW International Finance B.V., 4,049 %, 22/11/2029		320 000	353 617	0,10
ESB Finance DAC, 1 %, 19/07/2034		550 000	449 000	0,13
KFW German Government Development Bank, 1,125 %, 31/03/2037		2 404 000	2 052 378	0,59
La Banque Postale S.A., 4,375 %, 17/01/2030		400 000	436 206	0,12
Landsbankinn Bank (Republic of Iceland), 0,375 %, 23/05/2025		310 000	301 687	0,08
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties, 2,5 %, 15/10/2031	USD	480 000	376 864	0,11
RTE Reseau de Transport d'Electricite, 0,75 %, 12/01/2034	EUR	200 000	162 596	0,05
			5 486 142	1,57
Obligations souveraines du marché international				
Commonwealth d'Australie, 3,25 %, 21/06/2039	AUD	9 711 000	6 323 318	1,81
Commonwealth d'Australie, 3 %, 21/03/2047		1 249 000	748 943	0,21
République fédérale d'Allemagne, 1,7 %, 15/08/2032	EUR	4 173 000	4 325 178	1,24
République fédérale d'Allemagne, 0 %, 15/08/2052		2 562 253	1 484 004	0,43
Gouvernement des Bermudes, 2,375 %, 20/08/2030	USD	346 000	295 830	0,09
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		658 000	660 654	0,19
Gouvernement finlandais , 0,5 %, 15/09/2027	EUR	3 477 000	3 436 682	0,99
Gouvernement du Japon, 1,7 %, 20/06/2033	JPY	210 450 000	1 778 344	0,51
Gouvernement du Japon, 1,7 %, 20/06/2044		787 550 000	6 339 365	1,82
Gouvernement du Japon, 0,3 %, 20/06/2046		491 300 000	2 884 503	0,83
Gouvernement du Japon, 1,6 %, 20/12/2052		53 000 000	406 170	0,12
Royaume de Belgique, 0,4 %, 22/06/2040	EUR	4 094 000	2 829 369	0,81
Royaume d'Espagne, 2,55 %, 31/10/2032		1 996 000	2 039 429	0,58
Royaume d'Espagne, 3,15 %, 30/04/2033		3 640 000	3 886 832	1,11
Royaume d'Espagne, 1 %, 31/10/2050		4 212 000	2 509 188	0,72
République de Chypre, 0,625 %, 21/01/2030		584 000	519 834	0,15
République française, 0,75 %, 25/05/2053		1 949 000	1 175 117	0,34
République portugaise, 3,5 %, 18/06/2038		1 304 000	1 411 435	0,40
Titres du Trésor britannique, 1,25 %, 22/07/2027	GBP	7 145 000	8 093 883	2,32
Titres du Trésor britannique, 1,25 %, 22/10/2041		1 640 000	1 342 359	0,39
Titres du Trésor britannique, 1,25 %, 31/07/2051		1 860 000	1 306 847	0,37
			53 797 284	15,43
Autorités locales				
Oslo kommune, 2,17 %, 18/05/2029	NOK	13 000 000	1 201 344	0,34
Province de l'Alberta, 4,5 %, 1/12/2040	CAD	40 000	31 875	0,01
Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18/06/2050		500 000	313 246	0,09
Province d'Ontario, 1,9 %, 2/12/2051		1 867 000	911 337	0,26
			2 457 802	0,70
Machines et outils				
Sarens Finance Co. N.V., 5,75 %, 21/02/2027	EUR	510 000	453 307	0,13
Grandes banques				
Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 2,57 % jusqu'au 25/11/2030, FLR jusqu'au 25/11/2035	USD	643 000	495 888	0,14
Bank of America Corp., 3,5 %, 19/04/2026		902 000	877 641	0,25

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Grandes banques, suite				
Bank of America Corp., 0,694 % jusqu'au 22/03/2030, FLR jusqu'au 22/03/2031	EUR	710 000	613 018	0,18
Bank of America Corp., 2,687 % jusqu'au 22/04/2031, FLR jusqu'au 22/04/2032	USD	1 221 000	1 030 833	0,30
Bank of Ireland Group PLC, 4,875 % jusqu'au 16/07/2027, FLR jusqu'au 16/07/2028	EUR	330 000	364 231	0,10
Barclays Bank PLC, 8,407 % jusqu'au 14/11/2027, FLR jusqu'au 14/11/2032	GBP	135 000	179 076	0,05
BNP Paribas S.A., 3,875 %, 10/01/2031	EUR	400 000	440 383	0,13
Commonwealth Bank of Australia, 2,688 %, 11/03/2031	USD	502 000	403 592	0,12
Crédit Agricole Group, 3,875 %, 28/11/2034	EUR	400 000	434 621	0,12
Credit Suisse AG (London), 2,125 %, 31/05/2024		290 000	304 026	0,09
Credit Suisse Group AG, 7,75 % jusqu'au 1/03/2028, FLR jusqu'au 1/03/2029		325 000	367 368	0,10
Danske Bank A.S., 4,125 % jusqu'au 10/01/2030, FLR jusqu'au 10/01/2031		350 000	381 233	0,11
Goldman Sachs Group, Inc., 2,383 % jusqu'au 21/07/2031, FLR jusqu'au 21/07/2032	USD	270 000	221 075	0,06
Goldman Sachs Group, Inc., 3,436 % jusqu'au 24/02/2042, FLR jusqu'au 24/02/2043		274 000	220 401	0,06
HSBC Holdings PLC, 4,375 %, 23/11/2026		1 449 000	1 426 410	0,41
JPMorgan Chase & Co., 1,47 % jusqu'au 22/09/2026, FLR jusqu'au 22/09/2027		438 000	388 024	0,11
JPMorgan Chase & Co., 1,963 % jusqu'au 23/03/2029, FLR jusqu'au 23/03/2030	EUR	420 000	407 551	0,12
JPMorgan Chase & Co., 3,328 % jusqu'au 22/04/2051, FLR jusqu'au 22/04/2052	USD	677 000	513 642	0,15
Morgan Stanley, 3,125 %, 27/07/2026		684 000	648 266	0,19
Morgan Stanley, 1,593 % jusqu'au 4/05/2026, FLR jusqu'au 4/05/2027		1 354 000	1 215 906	0,35
Morgan Stanley, 3,622 % jusqu'au 1/04/2030, FLR jusqu'au 1/04/2031		540 000	496 703	0,14
Nationwide Building Society, 6,178 % jusqu'au 7/12/2026, FLR jusqu'au 7/12/2027	GBP	100 000	127 554	0,04
Nationwide Building Society, 0,25 %, 14/09/2028	EUR	460 000	409 831	0,12
NatWest Markets PLC, 6,375 %, 8/11/2027	GBP	127 000	165 221	0,05
Société Générale S.A., 4 %, 16/11/2027	EUR	300 000	331 218	0,09
Société Générale S.A., 4,25 %, 6/12/2030		300 000	323 039	0,09
Standard Chartered PLC, 0,8 % jusqu'au 17/11/2028, FLR jusqu'au 17/11/2029		420 000	377 837	0,11
TD Bank, 5,288 %, 11/01/2028	GBP	100 000	126 424	0,04
Toronto-Dominion Bank, 4,108 %, 8/06/2027	USD	336 000	330 518	0,09
UBS Group AG, 4,375 % jusqu'au 11/01/2030, FLR jusqu'au 11/01/2031	EUR	500 000	551 693	0,16
Unicaja Banco S.A., 1 % jusqu'au 1/12/2025, FLR jusqu'au 1/12/2026		400 000	391 587	0,11
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026	USD	430 000	390 099	0,11
Wells Fargo & Co., 3,526 % jusqu'au 24/03/2027, FLR jusqu'au 24/03/2028		920 000	874 923	0,25
Wells Fargo & Co., 2,572 % jusqu'au 11/02/2030, FLR jusqu'au 11/02/2031		478 000	411 932	0,12
Wells Fargo & Co., 3,35 % jusqu'au 2/03/2032, FLR jusqu'au 2/03/2033		530 000	467 355	0,13
			16 709 119	4,79
Technologies et services médicaux et de santé				
Alcon Finance B.V., 2,375 %, 31/05/2028	EUR	240 000	243 897	0,07
Alcon Finance Corp., 2,6 %, 27/05/2030	USD	522 000	456 460	0,13
Becton, Dickinson and Co., 4,298 %, 22/08/2032		144 000	140 565	0,04
HCA, Inc., 5,125 %, 15/06/2039		502 000	473 171	0,14
New York Society for the Relief of the Ruptured & Crippled, 2,667 %, 1/10/2050		679 000	449 007	0,13
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 6,015 %, 15/11/2048		344 000	339 390	0,10
Thermo Fisher Scientific (Finance I) Co., 2 %, 18/10/2051	EUR	360 000	258 682	0,07
Thermo Fisher Scientific, Inc., 1,75 %, 15/10/2028	USD	606 000	528 118	0,15
			2 889 290	0,83
Équipements médicaux				
Boston Scientific Corp., 0,625 %, 1/12/2027	EUR	260 000	247 345	0,07
Boston Scientific Corp., 2,65 %, 1/06/2030	USD	897 000	796 182	0,23
DH Europe Finance II S.à r.l., 0,45 %, 18/03/2028	EUR	260 000	243 435	0,07
			1 286 962	0,37
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 5,625 %, 1/04/2030	USD	675 000	696 012	0,20
Anglo American Capital PLC, 4,75 %, 21/09/2032	EUR	370 000	413 018	0,12
Coeur Mining, Inc., 5,125 %, 15/02/2029	USD	933 000	751 255	0,22
Glencore Capital Finance DAC, 1,125 %, 10/03/2028	EUR	460 000	426 748	0,12

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Métaux et exploitation minière, suite				
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031	USD	347 000	297 191	0,08
Novelis Sheet Ingot GmbH, 3,375 %, 15/04/2029	EUR	780 000	736 756	0,21
			3 320 980	0,95
Secteur intermédiaire				
DT Midstream, Inc., 4,125 %, 15/06/2029	USD	1 160 000	1 017 900	0,29
Energy Transfer LP, 5 %, 15/05/2050		506 000	441 579	0,13
EQM Midstream Partners LP, 7,5 %, 1/06/2030		385 000	384 519	0,11
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp., 3,55 %, 15/12/2029		395 000	355 261	0,10
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,2 %, 15/03/2028		469 000	454 530	0,13
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,5 %, 15/05/2030		319 000	309 651	0,09
Targa Resources Corp., 4,2 %, 1/02/2033		311 000	281 844	0,08
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		296 000	253 448	0,07
Venture Global Calcasieu Pass LLC , 6,25 %, 15/01/2030		441 000	449 282	0,13
			3 948 014	1,13
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 3,5 %, 1/12/2047		130 298	125 493	0,04
Fannie Mae, UMBS, 3,5 %, 1/05/2049		152 334	147 087	0,04
Fannie Mae, UMBS, 2,5 %, 1/03/2050–1/07/2052		4 498 646	3 953 609	1,13
Fannie Mae, UMBS, 2 %, 1/01/2051–1/04/2052		3 082 265	2 602 093	0,74
Fannie Mae, UMBS, 3 %, 1/12/2051–1/05/2052		184 936	169 214	0,05
Fannie Mae, UMBS, 4 %, 1/06/2052		99 242	95 870	0,03
Fannie Mae, UMBS, 4,5 %, 1/07/2052–1/10/2052		645 728	637 838	0,18
Fannie Mae, UMBS, 5,5 %, 1/11/2052–1/12/2052		1 782 427	1 811 908	0,53
Fannie Mae, UMBS, 6 %, 1/12/2052		174 832	179 602	0,05
Freddie Mac, 0,005 %, 25/01/2025 (i)		51 348 000	67 728	0,02
Freddie Mac, 0,145 %, 25/02/2025 (i)		18 119 000	64 243	0,02
Freddie Mac, 3,444 %, 25/12/2027		400 000	390 337	0,11
Freddie Mac, 0,127 %, 25/02/2028 (i)		17 700 000	131 474	0,04
Freddie Mac, 0,108 %, 25/04/2028 (i)		8 063 000	57 366	0,02
Freddie Mac, UMBS, 2 %, 1/04/2037–1/06/2052		2 334 802	1 991 961	0,57
Freddie Mac, UMBS, 3 %, 1/06/2050–1/07/2052		3 072 928	2 795 217	0,79
Freddie Mac, UMBS, 2,5 %, 1/06/2051–1/06/2052		2 128 712	1 868 630	0,54
Freddie Mac, UMBS, 5 %, 1/08/2052		242 413	243 785	0,07
Freddie Mac, UMBS, 3,5 %, 1/09/2052		1 998 256	1 874 249	0,54
Freddie Mac, UMBS, 4 %, 1/11/2052		368 814	356 170	0,10
Freddie Mac, UMBS, 6 %, 1/11/2052		297 880	306 006	0,09
Ginnie Mae, 2,5 %, 20/08/2051–20/05/2052		1 563 328	1 394 369	0,39
Ginnie Mae, 2 %, 20/03/2052		224 978	194 425	0,06
Ginnie Mae, 3 %, 20/04/2052–20/11/2052		518 591	476 744	0,14
Ginnie Mae, 4,5 %, 20/09/2052–20/12/2052		967 496	960 732	0,28
Ginnie Mae, 5 %, 20/09/2052–20/11/2052		621 766	626 235	0,18
Ginnie Mae, 3,5 %, 20/10/2052–20/11/2052		596 223	563 639	0,16
Ginnie Mae, 4 %, 20/10/2052–20/11/2052		372 809	361 913	0,11
Ginnie Mae, 5,5 %, 20/01/2053		349 965	355 838	0,10
Ginnie Mae, TBA, 3 %, 15/02/2053		550 000	505 227	0,14
Ginnie Mae, TBA, 3,5 %, 21/02/2053		300 000	283 634	0,08
UMBS, TBA, 5,5 %, 13/02/2053		250 000	254 043	0,07
UMBS, TBA, 4 %, 13/04/2053		875 000	844 888	0,24
			26 691 567	7,65
Obligations municipales				
Iowa Student Loan Liquidity Corp. Rev., Taxable, "A", 5,08 %, 1/12/2039		745 000	706 384	0,20
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 4,949 %, 1/07/2038		1 065 000	1 046 504	0,30
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Subordinate Rev., Taxable, "A", 2,641 %, 1/07/2037		695 000	637 172	0,18
Massachusetts Housing Finance Agency, Single Family Housing Rev., Taxable, "226", 5,562 %, 1/12/2052		595 000	604 570	0,17

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations municipales, suite				
Michigan Finance Authority Hospital Rev., Taxable (Trinity Health Credit Group), 3,384 %, 1/12/2040	USD	470 000	398 774	0,12
Minnesota Housing Finance Agency, Residential Housing, Taxable, "G", 4,337 %, 1/01/2047		715 000	694 719	0,20
New Jersey Economic Development Authority State Pension Funding Rev., Taxable, "A", NPFG, 7,425 %, 15/02/2029		737 000	809 804	0,23
Oklahoma Development Finance Authority, Health System Rev., Taxable (OU Medicine Project), "C", 5,45 %, 15/08/2028		159 000	130 164	0,04
Oklahoma Development Finance Authority, Health System Rev., Taxable (OU Medicine Project), "C", AGM, 4,65 %, 15/08/2030		93 000	83 646	0,03
			5 111 737	1,47
Gaz naturel - Distribution				
Boston Gas Co., 3,15 %, 1/08/2027		278 000	256 443	0,07
ENGIE S.A. , 4,25 %, 11/01/2043	EUR	300 000	328 666	0,09
NiSource, Inc., 3,6 %, 1/05/2030	USD	402 000	371 788	0,11
			956 897	0,27
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 0,75 %, 15/03/2029	EUR	400 000	357 743	0,10
APA Infrastructure Ltd., 2,5 %, 15/03/2036	GBP	440 000	378 806	0,11
			736 549	0,21
Réseaux et télécommunications				
AT&T, Inc., 3,45 %, 19/09/2023	AUD	100 000	70 222	0,02
AT&T, Inc., 3,5 %, 15/09/2053	USD	487 000	359 380	0,10
Orange S.A., 3,625 %, 16/11/2031	EUR	400 000	440 589	0,13
Verizon Communications, Inc., 2,355 %, 15/03/2032	USD	803 000	661 515	0,19
Verizon Communications, Inc., 3,875 %, 1/03/2052		110 000	90 278	0,03
			1 621 984	0,47
Services pétroliers				
Guara Norte S.à r.l., 5,198 %, 15/06/2034		273 171	247 302	0,07
Pétrole				
Neste Oyj, 0,75 %, 25/03/2028	EUR	400 000	379 344	0,11
Parkland Corp., 4,625 %, 1/05/2030	USD	1 035 000	889 688	0,25
			1 269 032	0,36
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
AIB Group PLC, 5,75 % jusqu'au 16/02/2028, FLR jusqu'au 16/02/2029	EUR	320 000	367 098	0,11
Arion Banki HF, 4,875 %, 21/12/2024		560 000	600 584	0,17
Bangkok Bank Public Co. Ltd., 3,466 % jusqu'au 23/09/2031, FLR jusqu'au 23/09/2036	USD	400 000	342 132	0,10
Bank Hapoalim B.M., 3,255 % jusqu'au 27/01/2027, FLR jusqu'au 21/01/2032		487 000	428 842	0,12
Belfius Bank S.A., 5,25 %, 19/04/2033	EUR	400 000	435 355	0,13
BPCE S.A., 2,277 % jusqu'au 20/01/2031, FLR jusqu'au 20/01/2032	USD	410 000	323 549	0,09
CaixaBank S.A., 5,375 % jusqu'au 14/11/2029, FLR jusqu'au 14/11/2030	EUR	300 000	341 060	0,10
CaixaBank S.A., 6,875 % jusqu'au 25/10/2028, FLR jusqu'au 25/10/2033	GBP	200 000	247 905	0,07
Commercial Bank P.S.Q.C., 4,5 % jusqu'au 3/09/2026, FLR jusqu'au 3/09/2169	USD	807 000	744 667	0,21
Deutsche Bank AG, 1,875 % jusqu'au 23/02/2027, FLR jusqu'au 23/02/2028	EUR	300 000	293 389	0,08
Deutsche Bank AG, 3,25 % jusqu'au 24/05/2027, FLR jusqu'au 24/05/2028		300 000	309 088	0,09
Deutsche Bank AG, 1,375 % jusqu'au 17/02/2031, FLR jusqu'au 17/02/2032		300 000	250 326	0,07
Deutsche Bank AG, 4 % jusqu'au 24/06/2027, FLR jusqu'au 24/06/2032		300 000	301 067	0,09
Groupe BPCE S.A., 4,5 %, 15/03/2025	USD	258 000	251 208	0,07
Groupe des Assurances du Credit Mutuel, 1,85 % jusqu'au 21/04/2032, FLR jusqu'au 21/04/2042	EUR	700 000	571 058	0,16
Intesa Sanpaolo S.p.A., 2,625 %, 11/03/2036	GBP	350 000	300 180	0,09
Macquarie Group Ltd., 4,08 %, 31/05/2029		360 000	411 170	0,12
Shinhan Bank Co. Ltd., 4,375 %, 13/04/2032	USD	621 000	568 152	0,16
United Overseas Bank Ltd., 2 % jusqu'au 14/10/2026, FLR jusqu'au 14/10/2031		300 000	266 016	0,08
Uzbek Industrial and Construction Bank, 5,75 %, 2/12/2024		626 000	604 090	0,17
Virgin Money UK PLC, 5,125 % jusqu'au 11/12/2025, FLR jusqu'au 11/12/2030	GBP	385 000	451 417	0,13
			8 408 353	2,41
Lutte contre la pollution				
GFL Environmental, Inc., 4 %, 1/08/2028	USD	1 005 000	892 189	0,25
Waste Connections, Inc., 4,2 %, 15/01/2033		599 000	581 897	0,17
			1 474 086	0,42

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Imprimerie et édition				
Informa PLC, 3,125 %, 5/07/2026	GBP	212 000	244 038	0,07
Chemins de fer et transport maritime				
Canadian Pacific Railway Co., 2,45 %, 2/12/2031	USD	215 000	185 669	0,05
Immobilier - Bureaux				
Corporate Office Property LP, REIT, 2,25 %, 15/03/2026		556 000	503 183	0,15
Corporate Office Property LP, REIT, 2 %, 15/01/2029		234 000	185 547	0,05
			688 730	0,20
Immobilier - Autres				
EPR Properties, REIT, 3,6 %, 15/11/2031		378 000	292 223	0,08
Lexington Realty Trust Co., 2,7 %, 15/09/2030		427 000	352 660	0,10
W.P. Carey, Inc., REIT, 2,4 %, 1/02/2031		536 000	449 431	0,13
			1 094 314	0,31
Immobilier - Distribution				
Brixmor Operating Partnership LP, REIT, 4,05 %, 1/07/2030		186 000	170 107	0,05
Hammerson Ireland Finance DAC, 1,75 %, 3/06/2027	EUR	437 000	387 021	0,11
Regency Centers Corp., 3,7 %, 15/06/2030	USD	269 000	243 628	0,07
STORE Capital Corp., REIT, 2,75 %, 18/11/2030		529 000	413 373	0,12
WEA Finance LLC, 2,875 %, 15/01/2027		330 000	289 883	0,08
			1 504 012	0,43
Distribution				
AutoZone, Inc., 4,75 %, 1/08/2032		152 000	152 001	0,05
Bath & Body Works, Inc., 5,25 %, 1/02/2028		450 000	424 760	0,12
BK LC Lux Finco 1 S.à r.l., 5,25 %, 30/04/2029	EUR	595 000	567 744	0,16
Home Depot, Inc., 3,625 %, 15/04/2052	USD	642 000	535 423	0,15
Nordstrom, Inc., 4,25 %, 1/08/2031		278 000	208 753	0,06
			1 888 681	0,54
Produits chimiques spéciaux				
Covestro AG, 4,75 %, 15/11/2028	EUR	300 000	332 808	0,09
CTEC II GmbH, 5,25 %, 15/02/2030		578 000	517 779	0,15
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,832 %, 15/10/2027	USD	310 000	268 271	0,08
			1 118 858	0,32
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		498 000	407 474	0,12
Michael Cos., Inc., 7,875 %, 1/05/2029		965 000	733 400	0,21
			1 140 874	0,33
Hypermarchés				
ELO SACA, 4,875 %, 8/12/2028	EUR	200 000	209 276	0,06
Organismes supranationaux				
European Financial Stability Facility, 3,375 %, 3/04/2037		429 000	480 690	0,14
European Stability Mechanism, 0,01 %, 15/10/2031		1 840 000	1 566 075	0,45
International Bank for Reconstruction and Development, 4,25 %, 24/06/2025	AUD	40 000	28 547	0,01
West African Development Bank, 4,7 %, 22/10/2031	USD	566 000	499 495	0,14
			2 574 807	0,74
Télécommunications mobiles				
America Movil S.A.B. de C.V., 4,7 %, 21/07/2032		226 000	222 859	0,07
American Tower Corp., REIT, 2,75 %, 15/01/2027		225 000	207 366	0,06
Cellnex Finance Co. S.A., 2 %, 15/02/2033	EUR	1 300 000	1 101 522	0,32
Crown Castle, Inc., REIT, 3,7 %, 15/06/2026	USD	259 000	249 879	0,07
Millicom International Cellular S.A., 5,125 %, 15/01/2028		365 400	325 356	0,09
Rogers Communications, Inc., 3,8 %, 15/03/2032		345 000	310 543	0,09
Rogers Communications, Inc., 3,7 %, 15/11/2049		388 000	288 312	0,08
T-Mobile USA, Inc., 3,875 %, 15/04/2030		334 000	312 818	0,09
			3 018 655	0,87

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services téléphoniques				
Deutsche Telekom AG, 1,375 %, 5/07/2034	EUR	520 000	450 624	0,13
TELUS Corp., 2,85 %, 13/11/2031	CAD	1 010 000	657 534	0,19
			1 108 158	0,32
Tabac				
B.A.T. Capital Corp., 2,125 %, 15/08/2025	GBP	370 000	424 770	0,12
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 17/11/2027	USD	341 000	348 513	0,10
			773 283	0,22
Transports - Services				
Autostrade per L'Italia S.p.A., 4,75 %, 24/01/2031	EUR	330 000	356 995	0,10
ERAC USA Finance LLC, 4,5 %, 15/02/2045	USD	150 000	132 532	0,04
Holding d'Infrastructures de Transport, 1,475 %, 18/01/2031	EUR	500 000	445 188	0,13
Q-Park Holding I B.V., 2 %, 1/03/2027		1 110 000	1 022 709	0,29
Triton International Ltd., 3,15 %, 15/06/2031	USD	332 000	266 918	0,08
			2 224 342	0,64
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 1,125 %, 15/08/2040 (g)		12 055 000	7 998 681	2,30
Obligations du Trésor américain, 2,25 %, 15/08/2049		413 300	313 139	0,09
Obligations du Trésor américain, 2,375 %, 15/11/2049		10 460 000	8 135 510	2,33
			16 447 330	4,72
Services publics - Énergie électrique				
Adani Transmission Ltd., 4,25 %, 21/05/2036		591 500	437 710	0,13
Adani Transmission Ltd., 4,25 %, 21/05/2036		253 500	187 590	0,05
American Transmission Systems, Inc., 2,65 %, 15/01/2032		374 000	318 370	0,09
Bruce Power LP, 2,68 %, 21/12/2028	CAD	825 000	563 788	0,16
Clearway Energy Operating LLC, 3,75 %, 15/02/2031	USD	1 195 000	1 009 572	0,29
ContourGlobal Power Holdings S.A., 2,75 %, 1/01/2026	EUR	935 000	928 915	0,27
Duke Energy Corp., 2,55 %, 15/06/2031	USD	628 000	532 751	0,15
E.ON SE, 3,875 %, 12/01/2035	EUR	210 000	226 612	0,06
Enel Finance International N.V., 3,5 %, 6/04/2028	USD	200 000	183 120	0,05
Enel Finance International N.V., 2,25 %, 12/07/2031		300 000	234 092	0,07
Enel S.p.A., 2,25 % jusqu'au 10/03/2027, FLR jusqu'au 10/03/2070	EUR	390 000	367 641	0,11
Enel S.p.A., 1,875 % jusqu'au 8/09/2030, FLR jusqu'au 8/03/2170		615 000	489 748	0,14
ENGIE Energía Chile S.A., 3,4 %, 28/01/2030	USD	630 000	527 625	0,15
Evergy, Inc., 2,9 %, 15/09/2029		452 000	401 963	0,12
Florida Power & Light Co., 2,875 %, 4/12/2051		257 000	186 875	0,05
Investment Energy Resources Ltd., 6,25 %, 26/04/2029		400 000	381 826	0,11
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		434 000	367 289	0,11
Listrindo Capital B.V., 4,95 %, 14/09/2026		476 000	449 998	0,13
Mong Duong Finance Holdings B.V., 5,125 %, 7/05/2029		644 000	573 160	0,16
MVM Energetika Zartkoruen Mukodo Reszvenytarsasag, 0,875 %, 18/11/2027	EUR	301 000	246 949	0,07
National Grid Electricity Transmission PLC, 2 %, 17/04/2040	GBP	330 000	264 686	0,08
National Grid PLC, 3,875 %, 16/01/2029	EUR	330 000	359 676	0,10
National Grid PLC, 4,275 %, 16/01/2035		330 000	357 694	0,10
Southern California Edison Co., 3,65 %, 1/02/2050	USD	395 000	310 503	0,09
Star Energy Geothermal (Wayang Windu) Ltd., 6,75 %, 24/04/2033		405 400	393 742	0,11
Virginia Electric & Power Co., 3,5 %, 15/03/2027		535 000	516 148	0,15
WEC Energy Group, Inc., 1,8 %, 15/10/2030		168 000	136 124	0,04
Xcel Energy, Inc., 4,6 %, 1/06/2032		161 000	159 410	0,05
			11 113 577	3,19
Total des obligations (coût identifié, 359 515 718 $)			**333 123 021**	**95,53**

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 14 948 000 $)	USD	14 948 000	14 948 000	4,28
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 374 463 718 $)			348 071 021	99,81

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES				
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5,25 %	EUR	9 140 000	60 230	0,02
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		4 730 000	39 763	0,01
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		6 750 000	56 744	0,02
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		3 630 000	30 515	0,01
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		2 250 000	18 914	0,00
Total des options de vente achetées (primes versées, 312 209 $)			206 166	0,06
Total des Options d'Achat Achetées				
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 5 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mars 2023 @ 4,75 %	EUR	4 850 000	122 422	0,03
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 5 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mars 2023 @ 4,75 %		4 850 000	122 422	0,04
iTraxx Europe Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 1 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Février 2023 @ 0,9 %		27 980 000	143 671	0,04
Total des Options d'Achat Achetées (primes versées, 160 127 $)			388 515	0,11
Total des investissements (coût identifié, 374 936 054 $)			348 665 702	99,98
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			56 422	0,02
ACTIF NET			348 722 124	100,00

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

MFS Meridian Funds - Global Research Focused Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Honeywell International, Inc.	21 166	4 412 688	3,21
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	32 991	1 431 688	1,04
Industrie de la confection			
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	5 120	4 472 752	3,25
NIKE, Inc., "B"	9 519	1 212 055	0,88
		5 684 807	4,13
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Charles Schwab Corp.	39 976	3 094 942	2,25
Euronext N.V.	27 337	2 215 491	1,61
		5 310 433	3,86
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	9 552	2 665 486	1,94
Fidelity National Information Services, Inc.	31 229	2 343 424	1,70
Fiserv, Inc.	8 010	854 507	0,62
		5 863 417	4,26

MFS Meridian Funds - Global Research Focused Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	4 651	1 722 451	1,25
Microsoft Corp.	31 493	7 804 280	5,68
Salesforce, Inc.	15 420	2 590 098	1,88
		12 116 829	8,81
Logiciels - Systèmes			
Hitachi Ltd.	46 800	2 457 401	1,79
Construction			
Masco Corp.	48 375	2 573 550	1,87
Équipements électriques			
Johnson Controls International PLC	28 672	1 994 711	1,45
Schneider Electric SE	21 180	3 434 492	2,50
		5 429 203	3,95
Électronique			
NXP Semiconductors N.V.	17 772	3 275 557	2,38
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	33 993	3 152 171	2,29
		6 427 728	4,67
Énergie - Sociétés indépendantes			
ConocoPhillips	29 761	3 626 973	2,63
Woodside Energy Group Ltd.	64 068	1 663 117	1,21
		5 290 090	3,84
Énergie - Sociétés intégrées			
Galp Energia SGPS S.A., "B"	108 190	1 479 056	1,07
Alimentation et boissons			
Mondelez International, Inc.	59 842	3 916 060	2,85
Nestlé S.A.	23 737	2 896 661	2,10
		6 812 721	4,95
Marchandises générales			
Dollar General Corp.	8 964	2 093 990	1,52
Assurances			
AIA Group Ltd.	185 000	2 089 202	1,52
Aon PLC	10 713	3 414 019	2,48
Chubb Ltd.	11 298	2 570 182	1,87
		8 073 403	5,87
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	43 457	4 295 290	3,12
Tencent Holdings Ltd.	40 700	1 983 834	1,44
		6 279 124	4,56
Loisirs et jouets			
Electronic Arts, Inc.	11 405	1 467 595	1,07
Machines et outils			
Ingersoll Rand, Inc.	37 247	2 085 832	1,52
Grandes banques			
Goldman Sachs Group, Inc.	8 293	3 033 662	2,20
Wells Fargo & Co.	70 630	3 310 428	2,41
		6 344 090	4,61
Équipements médicaux			
Becton, Dickinson and Co.	12 542	3 163 344	2,30
Danaher Corp.	13 219	3 494 839	2,54
Medtronic PLC	39 067	3 269 517	2,38
		9 927 700	7,22
Gaz naturel - Distribution			
China Resources Gas Group Ltd.	194 300	816 486	0,59
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Visa, Inc., "A"	15 878	3 655 274	2,66

MFS Meridian Funds - Global Research Focused Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Produits pharmaceutiques				
Roche Holding AG		14 611	4 566 425	3,32
Vertex Pharmaceuticals, Inc.		7 095	2 292 394	1,67
			6 858 819	4,99
Chemins de fer et transport maritime				
Canadian Pacific Railway Ltd.		33 312	2 628 317	1,91
Immobilier				
LEG Immobilien SE		13 020	1 014 926	0,74
Produits chimiques spéciaux				
Croda International PLC		15 681	1 336 215	0,97
DuPont de Nemours, Inc.		24 134	1 784 710	1,30
Linde PLC		11 549	3 796 798	2,76
			6 917 723	5,03
Magasins spécialisés				
Amazon.com, Inc.		35 731	3 684 938	2,68
Home Depot, Inc.		7 068	2 291 234	1,66
Meituan, "B"		4 070	90 627	0,07
			6 066 799	4,41
Télécommunications mobiles				
KDDI Corp.		70 600	2 205 850	1,61
Liberty Broadband Corp.		12 915	1 159 509	0,84
			3 365 359	2,45
Services publics - Énergie électrique				
Southern Co.		58 505	3 959 618	2,88
Total des actions ordinaires (coût identifié, 114 513 071 $)			**136 844 666**	**99,48**
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 825 000 $)	USD	825 000	825 000	0,60
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 115 338 071 $) (k)			**137 669 666**	**100,08**
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			**(104 625)**	**(0,08)**
ACTIF NET			**137 565 041**	**100,00**

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

MFS Meridian Funds - Global Strategic Equity Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	1 507	65 398	2,70
Industrie de la confection			
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	120	104 830	4,33
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Charles Schwab Corp.	804	62 246	2,57
CME Group, Inc.	204	36 038	1,49
		98 284	4,06
Services aux entreprises			
CoStar Group, Inc.	947	73 771	3,05
MSCI, Inc.	171	90 897	3,75
Nomura Research Institute Ltd.	2 100	50 380	2,08
		215 048	8,88
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	96	35 553	1,47

MFS Meridian Funds - Global Strategic Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels, suite			
Intuit, Inc.	135	57 060	2,36
Microsoft Corp.	578	143 234	5,91
		235 847	9,74
Logiciels - Systèmes			
Cap Gemini S.A.	136	25 791	1,06
Construction			
Vulcan Materials Co.	321	58 849	2,43
Biens de consommation			
Estee Lauder Cos., Inc., "A"	258	71 487	2,95
Équipements électriques			
Schneider Electric SE	386	62 593	2,58
Électronique			
ASML Holding N.V.	90	59 604	2,46
NVIDIA Corp.	329	64 277	2,65
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	358	33 197	1,37
		157 078	6,48
Alimentation et boissons			
Nestlé S.A.	534	65 165	2,69
Organisations de soins de santé intégrés			
UnitedHealth Group, Inc.	83	41 433	1,71
Assurances			
Aon PLC	235	74 890	3,09
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	1 339	132 347	5,46
Tencent Holdings Ltd.	800	38 994	1,61
		171 341	7,07
Machines et outils			
Daikin Industries Ltd.	300	52 235	2,16
Eaton Corp. PLC	362	58 720	2,42
		110 955	4,58
Technologies et services médicaux et de santé			
Veeva Systems, Inc.	62	10 574	0,44
Équipements médicaux			
Boston Scientific Corp.	1 419	65 629	2,71
Danaher Corp.	207	54 726	2,26
Thermo Fisher Scientific, Inc.	115	65 588	2,71
		185 943	7,68
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Mastercard, Inc., "A"	271	100 433	4,15
Produits pharmaceutiques			
Novo Nordisk A.S., "B"	582	80 598	3,33
Roche Holding AG	218	68 132	2,81
		148 730	6,14
Imprimerie et édition			
Wolters Kluwer N.V.	637	69 424	2,87
Chemins de fer et transport maritime			
Canadian Pacific Railway Ltd.	978	77 193	3,19
Produits chimiques spéciaux			
Linde PLC	230	76 116	3,14
Magasins spécialisés			
Amazon.com, Inc.	897	92 508	3,82
Hermes International	41	76 838	3,17

MFS Meridian Funds - Global Strategic Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Magasins spécialisés, suite			
Meituan, "B"	80	1 781	0,08
		171 127	7,07
Total des actions ordinaires (coût identifié, 2 248 229 $)		2 398 529	99,03
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 2 248 229 $) (k)		2 398 529	99,03
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		23 534	0,97
ACTIF NET		2 422 063	100,00

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

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
General Dynamics Corp.	41 275	9 619 551	0,57
Honeywell International, Inc.	23 552	4 910 121	0,29
L3Harris Technologies, Inc.	22 318	4 794 353	0,28
Northrop Grumman Corp.	7 371	3 302 503	0,19
Thales S.A.	7 488	989 308	0,06
		23 615 836	1,39
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	160 810	6 978 559	0,41
Heineken N.V.	46 297	4 607 373	0,27
Kirin Holdings Co. Ltd.	180 300	2 776 961	0,17
Pernod Ricard S.A.	21 140	4 374 004	0,26
		18 736 897	1,11
Industrie de la confection			
Compagnie Financiere Richemont S.A.	62 652	9 660 044	0,57
Industrie automobile			
Aptiv PLC	58 254	6 587 945	0,39
Lear Corp.	37 198	5 422 724	0,32
LKQ Corp.	138 433	8 162 010	0,48
Magna International, Inc.	60 111	3 902 437	0,23
Mercedes-Benz Group AG	19 765	1 464 375	0,09
Stellantis N.V.	118 212	1 852 398	0,11
		27 391 889	1,62
Biotechnologies			
Biogen, Inc.	3 232	940 189	0,05
Gilead Sciences, Inc.	39 775	3 338 713	0,20
		4 278 902	0,25
Radio-télévision			
Omnicom Group, Inc.	80 973	6 962 868	0,41
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Cboe Global Markets, Inc.	43 366	5 328 814	0,31
Charles Schwab Corp.	160 673	12 439 304	0,73
NASDAQ, Inc.	80 175	4 825 733	0,29
		22 593 851	1,33
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	19 580	5 463 799	0,32
Amdocs Ltd.	54 148	4 977 826	0,29
CGI, Inc.	58 251	4 992 630	0,30

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Services aux entreprises, suite			
Equifax, Inc.	16 716	3 714 295	0,22
Experian PLC	127 221	4 651 256	0,27
Fidelity National Information Services, Inc.	49 204	3 692 268	0,22
Fiserv, Inc.	50 322	5 368 351	0,32
Nomura Research Institute Ltd.	87 500	2 099 177	0,12
Secom Co. Ltd.	92 600	5 515 436	0,33
		40 475 038	2,39
Télévision par câble			
Comcast Corp., "A"	366 485	14 421 185	0,85
Produits chimiques			
Nutrien Ltd.	10 995	910 142	0,05
PPG Industries, Inc.	63 518	8 278 936	0,49
		9 189 078	0,54
Logiciels			
Microsoft Corp.	51 200	12 687 872	0,75
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	83 282	5 239 019	0,31
Cap Gemini S.A.	19 249	3 650 348	0,22
Fujitsu Ltd.	47 900	6 859 797	0,40
Hitachi Ltd.	176 400	9 262 511	0,55
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	1 020 000	3 402 493	0,20
Lenovo Group Ltd.	1 996 000	1 605 829	0,09
Samsung Electronics Co. Ltd.	194 336	9 713 671	0,57
Seagate Technology Holdings PLC	28 872	1 956 944	0,12
		41 690 612	2,46
Construction			
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	460 000	1 742 347	0,10
Masco Corp.	153 032	8 141 302	0,48
Stanley Black & Decker, Inc.	48 826	4 360 650	0,26
Techtronic Industries Co. Ltd.	112 500	1 450 435	0,09
Vulcan Materials Co.	24 467	4 485 535	0,26
		20 180 269	1,19
Biens de consommation			
Colgate-Palmolive Co.	77 801	5 798 509	0,34
Kimberly-Clark Corp.	64 275	8 356 393	0,50
Reckitt Benckiser Group PLC	86 086	6 130 334	0,36
		20 285 236	1,20
Équipements électriques			
Johnson Controls International PLC	141 400	9 837 198	0,58
Legrand S.A.	44 660	3 991 820	0,24
Schneider Electric SE	76 837	12 459 683	0,73
		26 288 701	1,55
Électronique			
Intel Corp.	128 212	3 623 271	0,22
Kyocera Corp.	124 900	6 494 009	0,38
NXP Semiconductors N.V.	41 605	7 668 217	0,45
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	95 986	8 900 782	0,53
Texas Instruments, Inc.	79 546	14 096 347	0,83
		40 782 626	2,41
Énergie - Sociétés indépendantes			
ConocoPhillips	106 128	12 933 819	0,76
Coterra Energy, Inc.	80 307	2 010 084	0,12
Hess Corp.	62 765	9 424 793	0,56
Pioneer Natural Resources Co.	7 191	1 656 447	0,10

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Énergie - Sociétés indépendantes, suite			
Valero Energy Corp.	14 434	2 021 193	0,12
		28 046 336	1,66
Énergie - Sociétés intégrées			
China Petroleum & Chemical Corp.	10 876 000	5 882 038	0,35
Eni S.p.A.	749 685	11 562 315	0,68
Exxon Mobil Corp.	28 753	3 335 635	0,20
LUKOIL PJSC (c)	8 747	0	0,00
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	187 128	1 931 161	0,11
Suncor Energy, Inc.	174 281	6 048 849	0,36
TotalEnergies SE	79 313	4 927 505	0,29
		33 687 503	1,99
Alimentation et boissons			
Archer Daniels Midland Co.	39 045	3 234 878	0,19
Coca-Cola FEMSA S.A.B. de C.V.	18 943	1 443 078	0,09
Danone S.A.	112 362	6 145 587	0,36
General Mills, Inc.	124 917	9 788 496	0,58
J.M. Smucker Co.	31 804	4 859 651	0,29
Nestlé S.A.	51 938	6 338 070	0,37
		31 809 760	1,88
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Albertsons Cos., Inc., "A"	87 308	1 850 930	0,11
BIM Birlesik Magazalar A.S.	353 637	2 346 537	0,14
Tesco PLC	3 443 823	10 461 137	0,62
		14 658 604	0,87
Organisations de soins de santé intégrés			
Cigna Corp.	38 037	12 045 177	0,71
Assurances			
Aon PLC	50 994	16 250 768	0,96
Chubb Ltd.	35 431	8 060 198	0,48
Equitable Holdings, Inc.	166 877	5 351 745	0,32
Everest Re Group Ltd.	1 958	684 693	0,04
Hartford Financial Services Group, Inc.	28 540	2 214 989	0,13
Manulife Financial Corp.	417 898	8 269 704	0,49
MetLife, Inc.	58 535	4 274 226	0,25
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	18 490	3 054 273	0,18
Travelers Cos., Inc.	16 152	3 086 970	0,18
Willis Towers Watson PLC	35 303	8 973 670	0,53
Zurich Insurance Group AG	6 704	3 315 630	0,19
		63 536 866	3,75
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	81 554	8 060 797	0,48
Loisirs et jouets			
Brunswick Corp.	16 835	1 419 695	0,08
Nintendo Co. Ltd.	31 000	1 339 646	0,08
Polaris, Inc.	11 281	1 295 510	0,08
		4 054 851	0,24
Machines et outils			
Eaton Corp. PLC	48 926	7 936 286	0,47
GEA Group AG	27 575	1 239 597	0,07
Ingersoll Rand, Inc.	159 918	8 955 408	0,53
Kubota Corp.	284 600	4 271 008	0,25
Regal Rexnord Corp.	50 468	7 025 146	0,42
Timken Co.	10 528	866 981	0,05
Volvo Group	162 672	3 224 189	0,19
		33 518 615	1,98

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Grandes banques			
ABN AMRO Group N.V., GDR	210 300	3 482 480	0,20
Bank of America Corp.	304 908	10 818 136	0,64
BNP Paribas	276 456	18 949 709	1,12
DBS Group Holdings Ltd.	400 500	10 963 815	0,65
Erste Group Bank AG	33 797	1 280 210	0,07
Goldman Sachs Group, Inc.	41 188	15 066 982	0,89
JPMorgan Chase & Co.	105 220	14 726 591	0,87
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	1 142 600	8 386 611	0,49
NatWest Group PLC	2 841 060	10 809 344	0,64
Regions Financial Corp.	91 562	2 155 370	0,13
UBS Group AG	745 802	15 879 864	0,94
		112 519 112	6,64
Technologies et services médicaux et de santé			
ICON PLC	16 973	3 915 841	0,23
McKesson Corp.	14 952	5 662 023	0,34
		9 577 864	0,57
Équipements médicaux			
Becton, Dickinson and Co.	24 812	6 258 083	0,37
Boston Scientific Corp.	149 572	6 917 705	0,41
Danaher Corp.	10 257	2 711 746	0,16
Medtronic PLC	96 870	8 107 050	0,48
		23 994 584	1,42
Métaux et exploitation minière			
Fortescue Metals Group Ltd.	33 514	531 630	0,03
Glencore PLC	884 940	5 941 531	0,35
Rio Tinto PLC	188 240	14 715 915	0,87
Vale S.A.	247 200	4 602 343	0,27
		25 791 419	1,52
Gaz naturel - Gazoducs			
Plains GP Holdings LP	63 634	832 969	0,05
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
China Construction Bank Corp.	2 727 000	1 771 346	0,10
Julius Baer Group Ltd.	63 450	4 065 739	0,24
KB Financial Group, Inc.	22 379	1 019 667	0,06
Northern Trust Corp.	50 852	4 931 119	0,29
Sberbank of Russia PJSC (c)	849 440	0	0,00
SLM Corp.	142 385	2 501 705	0,15
Tisco Financial Group PCL	433 900	1 347 311	0,08
Truist Financial Corp.	169 875	8 390 126	0,50
		24 027 013	1,42
Produits pharmaceutiques			
Bayer AG	215 934	13 393 777	0,79
Johnson & Johnson	141 605	23 141 089	1,37
Merck & Co., Inc.	207 295	22 265 556	1,31
Organon & Co.	186 324	5 613 942	0,33
Pfizer, Inc.	160 907	7 105 653	0,42
Roche Holding AG	73 411	22 943 387	1,35
Sanofi	23 906	2 349 164	0,14
		96 812 568	5,71
Imprimerie et édition			
RELX PLC	115 881	3 443 918	0,21
Wolters Kluwer N.V.	61 090	6 658 002	0,39
		10 101 920	0,60
Chemins de fer et transport maritime			
A.P. Moller-Maersk A/S	306	665 517	0,04

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Chemins de fer et transport maritime, suite				
Canadian Pacific Railway Ltd.		60 915	4 808 007	0,28
Orient Overseas International Ltd.		31 000	515 631	0,03
Union Pacific Corp.		27 059	5 525 177	0,33
			11 514 332	0,68
Immobilier				
Extra Space Storage, Inc., REIT		14 472	2 284 116	0,13
National Retail Properties, Inc., REIT		35 287	1 670 840	0,10
Simon Property Group, Inc., REIT		16 646	2 138 345	0,13
W.P. Carey, Inc., REIT		21 842	1 868 146	0,11
			7 961 447	0,47
Restaurants				
Cracker Barrel Old Country Store, Inc.		8 710	971 862	0,06
Darden Restaurants, Inc.		7 928	1 173 106	0,07
Sodexo		14 665	1 452 922	0,08
Texas Roadhouse, Inc.		13 417	1 347 469	0,08
Yum China Holdings, Inc.		71 631	4 413 186	0,26
			9 358 545	0,55
Produits chimiques spéciaux				
Akzo Nobel N.V.		52 140	3 878 227	0,23
Axalta Coating Systems Ltd.		118 739	3 574 044	0,21
Chemours Co.		30 207	1 099 233	0,06
			8 551 504	0,50
Télécommunications mobiles				
KDDI Corp.		418 700	13 082 004	0,77
PT Telekom Indonesia		4 825 800	1 239 448	0,07
T-Mobile US, Inc.		58 672	8 760 316	0,52
Vodafone Group PLC		1 475 757	1 700 153	0,10
			24 781 921	1,46
Services téléphoniques				
AT&T, Inc.		89 240	1 817 819	0,11
Hellenic Telecommunications Organization S.A.		158 139	2 487 695	0,15
Orange S.A.		183 477	1 941 501	0,11
Quebecor, Inc., "B"		123 779	2 935 978	0,17
			9 182 993	0,54
Tabac				
British American Tobacco PLC		144 017	5 507 812	0,32
Japan Tobacco, Inc.		143 700	2 925 741	0,17
Philip Morris International, Inc.		90 275	9 410 266	0,56
			17 843 819	1,05
Services publics - Énergie électrique				
American Electric Power Co., Inc.		21 761	2 044 664	0,12
Duke Energy Corp.		34 896	3 575 095	0,21
E.ON SE		814 480	8 849 768	0,52
Edison International		59 832	4 122 425	0,24
Iberdrola S.A.		527 957	6 173 892	0,37
National Grid PLC		159 736	2 031 817	0,12
PG&E Corp.		97 945	1 557 325	0,09
Transmissora Alianca de Energia Eletrica S.A., IEU		107 433	784 325	0,05
Vistra Corp.		35 173	811 089	0,05
			29 950 400	1,77
Total des actions ordinaires (coût identifié, 833 927 037 $)			**991 461 823**	**58,53**
OBLIGATIONS				
Aérospatiale et défense				
Raytheon Technologies Corp., 2,82 %, 1/09/2051	USD	1 462 000	1 033 217	0,06

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Compagnies aériennes				
EasyJet Finco B.V., 1,875 %, 3/03/2028	EUR	1 130 000	1 048 987	0,06
Boissons alcoolisées				
Pernod Ricard S.A., 3,75 %, 2/11/2032		800 000	886 212	0,05
Industrie de la confection				
Tapestry, Inc., 3,05 %, 15/03/2032	USD	1 318 000	1 080 349	0,06
Créances adossées à des actifs et titrisées				
AA Bond Co. Ltd., 3,25 %, 31/07/2028	GBP	1 070 000	1 054 449	0,06
ACREC 2021-FL1 Ltd., "C", FLR, 6,62 %, 16/10/2036	USD	1 202 000	1 147 217	0,07
ACRES 2021-FL2 Issuer Ltd., "AS", FLR, 6,214 %, 15/01/2037		867 500	846 929	0,05
ACRES 2021-FL2 Issuer Ltd., "B", FLR, 6,714 %, 15/01/2037		1 414 500	1 366 931	0,08
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2019-FL2, "AS", FLR, 6,043 %, 15/09/2034		1 050 000	1 040 933	0,06
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "B", FLR, 5,923 %, 15/12/2035		453 500	421 221	0,02
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL2, "B", FLR, 6,054 %, 15/05/2036		309 000	292 771	0,02
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL2, "C", FLR, 6,404 %, 15/05/2036		918 000	857 989	0,05
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2022-FL1, "B", FLR, 6,379 %, 15/01/2037		1 866 000	1 806 441	0,11
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2022-FL1, "C", FLR, 6,578 %, 15/01/2037		1 797 000	1 695 035	0,10
AREIT 2022-CRE6 Trust, "B", FLR, 6,16 %, 16/01/2037		673 500	619 760	0,04
AREIT 2022-CRE6 Trust, "C", FLR, 6,46 %, 16/01/2037		338 500	315 027	0,02
Brazos Securitization LLC, 5,413 %, 1/09/2052		590 000	618 686	0,04
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "B", FLR, 6,504 %, 15/12/2038		417 000	389 447	0,02
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "C", FLR, 6,754 %, 15/12/2038		377 500	349 995	0,02
Business Jet Securities LLC, 2020-1A, "A", 2,981 %, 15/11/2035		252 114	231 322	0,01
Business Jet Securities LLC, 2021-1A, "A", 2,162 %, 15/04/2036		348 400	313 107	0,02
BXMT 2021-FL4 Ltd., "AS", FLR, 5,759 %, 15/05/2038		1 500 000	1 438 099	0,08
BXMT 2021-FL4 Ltd., "B", FLR, 6,009 %, 15/05/2038		2 196 000	2 039 920	0,12
Capital Automotive, 2020-1A, "A4", REIT, 3,19 %, 15/02/2050		664 295	627 540	0,04
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-3A, "A", 1 %, 15/05/2030		1 683 000	1 617 426	0,10
Fortress CBO Investments Ltd., 2022-FL3, "AS", FLR, 6,56 %, 23/02/2039		644 000	618 561	0,04
FS Rialto 2021-FL2 Issuer Ltd., "AS", FLR, 6,009 %, 16/05/2038		1 549 000	1 473 015	0,09
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "AS", FLR, 6,204 %, 15/07/2036		2 000 000	1 896 338	0,11
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "B", FLR, 6,454 %, 15/07/2036		845 500	798 686	0,05
MF1 2021-FL5 Ltd., "AS", FLR, 5,797 %, 15/07/2036		1 446 000	1 396 885	0,08
MF1 2021-FL5 Ltd., "B", FLR, 6,047 %, 15/07/2036		1 883 000	1 818 879	0,11
MF1 2021-FL5 Ltd., "C", FLR, 6,297 %, 15/07/2036		275 000	256 662	0,01
MF1 2021-FL6 Ltd., "AS", FLR, 5,92 %, 16/07/2036		2 500 000	2 384 580	0,14
MF1 2021-FL6 Ltd., "B", FLR, 6,12 %, 16/07/2036		2 350 000	2 231 342	0,13
MF1 2022-FL8 Ltd., "B", FLR, 6,26 %, 19/02/2037		657 355	629 410	0,04
PFP III 2021-7 Ltd., "AS", FLR, 5,609 %, 14/04/2038		1 314 935	1 240 667	0,07
PFP III 2021-7 Ltd., "B", FLR, 5,854 %, 14/04/2038		515 974	482 951	0,03
PFP III 2021-8 Ltd., "B", FLR, 5,954 %, 9/08/2037		542 000	509 505	0,03
RAC Bond Co. PLC, 4,87 %, 6/05/2026	GBP	610 000	707 099	0,04
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "A", FLR, 5,67 %, 18/04/2038	USD	1 509 000	1 475 245	0,09
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "AS", FLR, 5,92 %, 18/04/2038		1 509 000	1 430 772	0,08
TPG Real Estate Finance, 2021-FL4, "A", FLR, 5,664 %, 15/03/2038		697 000	676 781	0,04
TPG Real Estate Finance, 2021-FL4, "AS", FLR, 5,864 %, 15/03/2038		720 000	684 187	0,04
Westlake Automobile Receivable Trust, 2023-1A, "A2B", FLR, 5,25 %, 15/06/2026		315 000	314 999	0,02
			40 116 809	2,37
Industrie automobile				
Hyundai Capital America, 2 %, 15/06/2028		1 946 000	1 649 580	0,10
Hyundai Capital America, 6,375 %, 8/04/2030		1 161 000	1 220 256	0,07
Mercedes-Benz Financial Services (Canada), 3 %, 23/02/2027	EUR	540 000	580 756	0,03
			3 450 592	0,20
Radio-télévision				
Discovery, Inc., 4,125 %, 15/05/2029	USD	921 000	846 668	0,05
Prosus N.V., 2,085 %, 19/01/2030	EUR	750 000	663 708	0,04

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Radio-télévision, suite				
Prosus N.V., 3,68 %, 21/01/2030	USD	657 000	568 305	0,03
Ubisoft Entertainment S.A., 0,878 %, 24/11/2027	EUR	800 000	655 614	0,04
Walt Disney Co., 3,5 %, 13/05/2040	USD	719 000	615 037	0,04
Warnermedia Holdings, Inc., 4,279 %, 15/03/2032		1 463 000	1 302 004	0,08
			4 651 336	0,28
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Ameriprise Financial, Inc., 4,5 %, 13/05/2032		506 000	506 862	0,03
Low Income Investment Fund, 3,386 %, 1/07/2026		360 000	346 629	0,02
Low Income Investment Fund, 3,711 %, 1/07/2029		980 000	904 405	0,05
			1 757 896	0,10
Construction				
Holcim Sterling Finance (Netherlands) B.V., 2,25 %, 4/04/2034	GBP	800 000	729 452	0,04
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030	USD	1 020 000	932 025	0,06
			1 661 477	0,10
Services aux entreprises				
Euronet Worldwide, Inc., 1,375 %, 22/05/2026	EUR	955 000	923 835	0,05
Fiserv, Inc., 4,4 %, 1/07/2049	USD	373 000	320 161	0,02
Mastercard, Inc., 3,85 %, 26/03/2050		558 000	506 735	0,03
Verisk Analytics, Inc., 4 %, 15/06/2025		796 000	779 558	0,05
			2 530 289	0,15
Télévision par câble				
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 6,384 %, 23/10/2035		991 000	1 013 522	0,06
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 4,8 %, 1/03/2050		787 000	619 726	0,04
Comcast Corp., 3,75 %, 1/04/2040		1 181 000	1 043 648	0,06
SES S.A., 3,5 %, 14/01/2029	EUR	650 000	661 809	0,04
			3 338 705	0,20
Produits chimiques				
Alpek SAB de C.V., 3,25 %, 25/02/2031	USD	535 000	448 401	0,03
Arkema S.A., 3,5 %, 23/01/2031	EUR	400 000	425 174	0,02
LYB International Finance III, LLC, 4,2 %, 1/05/2050	USD	334 000	271 046	0,02
Sherwin-Williams Co., 3,8 %, 15/08/2049		332 000	264 222	0,01
			1 408 843	0,08
Logiciels				
Microsoft Corp., 3,125 %, 3/11/2025		572 000	556 640	0,03
Microsoft Corp., 2,921 %, 17/03/2052		1 463 000	1 118 613	0,07
			1 675 253	0,10
Logiciels - Systèmes				
Apple, Inc., 4,5 %, 23/02/2036		223 000	228 525	0,01
Conglomérats				
ABB Finance B.V., 3,25 %, 16/01/2027	EUR	200 000	217 891	0,01
ABB Finance B.V., 3,375 %, 16/01/2031		370 000	398 525	0,02
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028	USD	1 184 000	1 202 015	0,07
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,95 %, 15/09/2028		2 281 000	2 265 799	0,14
			4 084 230	0,24
Biens de consommation				
JAB Holdings B.V., 2,25 %, 19/12/2039	EUR	1 300 000	1 007 363	0,06
Services de consommation				
Booking Holdings, Inc., 4,75 %, 15/11/2034		503 000	581 270	0,03
Équipements électriques				
Arrow Electronics, Inc., 3,25 %, 8/09/2024	USD	689 000	666 654	0,04
Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1,125 %, 8/02/2027	EUR	1 000 000	948 539	0,06
Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1 %, 26/05/2029		1 240 000	1 055 126	0,06
			2 670 319	0,16
Électronique				
Analog Devices, Inc., 3,5 %, 5/12/2026	USD	1 660 000	1 612 034	0,10

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Électronique, suite				
Broadcom, Inc., 3,469 %, 15/04/2034	USD	696 000	577 073	0,03
Broadcom, Inc., 3,137 %, 15/11/2035		625 000	485 222	0,03
			2 674 329	0,16
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Airport Authority Hong Kong, 3,25 %, 12/01/2052		890 000	688 431	0,04
Ceske Drahy A.S. (République tchèque), 5,625 %, 12/10/2027	EUR	1 200 000	1 340 996	0,08
CEZ A.S. (République tchèque), 2,375 %, 6/04/2027		926 000	941 064	0,06
Export-Import Bank of India, 3,375 %, 5/08/2026	USD	1 200 000	1 124 448	0,07
Export-Import Bank of India, 3,875 %, 1/02/2028		1 600 000	1 506 553	0,09
Huarong Finance 2017 Co. Ltd. (République populaire de Chine), 4,95 %, 7/11/2047		920 000	655 341	0,04
Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd., 4,25 %, 27/07/2027		708 000	691 150	0,04
MDGH - GMTN RSC Ltd. (Émirats arabes unis), 2,5 %, 3/06/2031		1 570 000	1 349 179	0,08
Ooredoo International Finance Ltd. (État du Qatar), 2,625 %, 8/04/2031		870 000	762 677	0,04
PT Pertamina (Persero) (République d'Indonésie), 3,65 %, 30/07/2029		1 150 000	1 061 034	0,06
Qatar Petroleum, 2,25 %, 12/07/2031		1 254 000	1 065 135	0,06
Qatar Petroleum, 3,125 %, 12/07/2041		830 000	656 854	0,04
SPP-Distribucia A.S. (République de Slovaquie), 1 %, 9/06/2031	EUR	1 240 000	889 724	0,05
			12 732 586	0,75
Obligations souveraines des marchés émergents				
République orientale d'Uruguay, 4,375 %, 23/01/2031	USD	2 925 000	2 916 362	0,17
République orientale d'Uruguay, 8,25 %, 21/05/2031	UYU	148 260 000	3 441 894	0,20
République populaire de Chine, 3,03 %, 11/03/2026	CNY	185 430 000	27 836 954	1,64
République populaire de Chine, 3,13 %, 21/11/2029		35 240 000	5 319 437	0,32
République de Hongrie, 5,5 %, 16/06/2034	USD	693 000	680 321	0,04
République d'Indonésie, 3,55 %, 31/03/2032		1 090 000	1 000 121	0,06
République de Corée, 2,125 %, 10/06/2027	KRW	6 550 000 000	5 059 471	0,30
République de Corée, 1,875 %, 10/06/2029		26 168 320 000	19 466 765	1,15
République de Corée, 1,375 %, 10/06/2030		16 730 630 000	11 819 414	0,70
État du Qatar, 4 %, 14/03/2029	USD	521 000	518 863	0,03
État du Qatar, 4,4 %, 16/04/2050		363 000	342 719	0,02
États-Unis du Mexique, 7,5 %, 3/06/2027	MXN	181 800 000	9 177 905	0,54
États-Unis du Mexique, 2,659 %, 24/05/2031	USD	783 000	656 323	0,04
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 29/05/2031	MXN	78 000 000	3 915 886	0,23
États-Unis du Mexique, 3,771 %, 24/05/2061	USD	1 113 000	757 096	0,05
			92 909 531	5,49
Énergie - Sociétés indépendantes				
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 4 %, 15/08/2026		5 325 000	4 750 752	0,28
Énergie - Sociétés intégrées				
BP Capital Markets PLC, 3,625 % jusqu'au 22/06/2029, FLR jusqu'au 22/06/2170	EUR	1 030 000	990 925	0,06
Eni S.p.A., 4,25 %, 9/05/2029	USD	798 000	758 221	0,04
Galp Energia SGPS S.A., 2 %, 15/01/2026	EUR	800 000	815 311	0,05
MOL PLC, 1,5 %, 8/10/2027		690 000	631 405	0,04
			3 195 862	0,19
Ingénierie - Construction				
Bouygues S.A., 4,625 %, 7/06/2032		800 000	935 276	0,06
Établissements financiers				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,3 %, 30/01/2032	USD	393 000	329 966	0,02
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,85 %, 29/10/2041		314 000	244 963	0,01
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,375 %, 1/05/2026		672 000	638 653	0,04
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,75 %, 21/02/2028		710 000	611 690	0,04
CTP N.V., 0,875 %, 20/01/2026	EUR	910 000	835 420	0,05
CTP N.V., 1,5 %, 27/09/2031		1 100 000	810 821	0,05
EXOR N.V., 2,25 %, 29/04/2030		600 000	569 195	0,03
EXOR N.V., 0,875 %, 19/01/2031		830 000	704 886	0,04
Grand City Properties S.A., 1,5 % jusqu'au 9/06/2026, FLR jusqu'au 9/12/2069		1 000 000	475 628	0,03

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Établissements financiers, suite				
Logicor Financing S.à r.l., 1,625 %, 17/01/2030	EUR	960 000	794 527	0,05
Logicor Financing S.à r.l., 0,875 %, 14/01/2031		325 000	241 080	0,01
P3 Group S.à r.l., 0,875 %, 26/01/2026		1 220 000	1 159 586	0,07
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 1,75 %, 14/01/2025		680 000	662 389	0,04
SBB Treasury Oyj, 0,75 %, 14/12/2028		633 000	457 630	0,03
SBB Treasury Oyj, 1,125 %, 26/11/2029		475 000	340 822	0,02
VGP N.V., 1,5 %, 8/04/2029		1 000 000	741 317	0,04
Vonovia SE, REIT, 1,625 %, 1/09/2051		900 000	517 565	0,03
			10 136 138	0,60
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4 %, 13/04/2028	USD	1 117 000	1 097 294	0,07
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4,375 %, 15/04/2038		497 000	471 344	0,03
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 5,55 %, 23/01/2049		669 000	717 520	0,04
Bacardi Ltd., 5,15 %, 15/05/2038		724 000	709 650	0,04
Constellation Brands, Inc., 4,4 %, 15/11/2025		1 309 000	1 297 377	0,08
Constellation Brands, Inc., 3,15 %, 1/08/2029		1 169 000	1 066 752	0,06
Constellation Brands, Inc., 2,25 %, 1/08/2031		435 000	358 911	0,02
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3 %, 2/02/2029		677 000	581 103	0,03
Kraft Heinz Foods Co., 3,875 %, 15/05/2027		1 226 000	1 194 374	0,07
PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, 3,398 %, 9/06/2031		1 790 000	1 541 636	0,09
			9 035 961	0,53
Jeux et hôtellerie				
Marriott International, Inc., 2,85 %, 15/04/2031		644 000	548 122	0,03
VICI Properties LP, REIT, 4,95 %, 15/02/2030		1 172 000	1 133 382	0,07
			1 681 504	0,10
Industrie				
Investor AB, 2,75 %, 10/06/2032	EUR	265 000	273 061	0,02
Assurances				
Aflac, Inc., 3,6 %, 1/04/2030	USD	235 000	223 355	0,01
AIA Group Ltd., 0,88 % jusqu'au 9/09/2028, FLR jusqu'au 9/09/2033	EUR	1 660 000	1 455 502	0,09
Argentum Netherlands B.V., 5,125 %, 1/06/2048	USD	690 000	652 754	0,04
ASR Nederland N.V., 7 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2043	EUR	1 030 000	1 190 534	0,07
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042	USD	266 000	230 825	0,01
Equitable Holdings, Inc., 5,594 %, 11/01/2033		1 035 000	1 059 683	0,06
			4 812 653	0,28
Assurances - Santé				
UnitedHealth Group, Inc., 4,625 %, 15/07/2035		208 000	210 071	0,01
Assurances IARD				
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 2,6 %, 2/12/2031		261 000	221 292	0,01
Marsh & McLennan Cos., Inc., 2,25 %, 15/11/2030		265 000	224 034	0,02
QBE Insurance Group Ltd., 2,5 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2038	GBP	688 000	661 140	0,04
			1 106 466	0,07
Obligations quasi souveraines du marché international				
Caixa Geral de Depositos S.A. (République portugaise), 5,75 %, 31/10/2028	EUR	900 000	1 019 060	0,06
Deutsche Bahn Finance GmbH (République fédérale d'Allemagne), 1,375 %, 16/04/2040		229 000	182 381	0,01
Electricite de France S.A., 2,625 % jusqu'au 1/06/2028, FLR jusqu'au 29/12/2049		800 000	712 562	0,04
Electricite de France S.A., 2,875 % jusqu'au 15/03/2027, FLR jusqu'au 15/03/2070		1 200 000	1 115 416	0,07
Electricite de France S.A., 5,875 % jusqu'au 22/01/2029, FLR jusqu'au 31/12/2165	GBP	700 000	737 860	0,04
EnBW International Finance B.V., 3,5 %, 24/07/2028	EUR	715 000	770 635	0,05
EnBW International Finance B.V., 4,049 %, 22/11/2029		230 000	254 162	0,01
ESB Finance DAC, 1 %, 19/07/2034		1 010 000	824 527	0,05
KFW German Government Development Bank, 1,125 %, 31/03/2037		3 860 000	3 295 416	0,19
La Banque Postale S.A., 4,375 %, 17/01/2030		1 000 000	1 090 514	0,06
Landsbankinn Bank (Republic of Iceland), 0,375 %, 23/05/2025		662 000	644 247	0,04
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties, 2,5 %, 15/10/2031	USD	993 000	779 638	0,05

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations quasi souveraines du marché international, suite				
RTE Reseau de Transport d'Electricite, 0,75 %, 12/01/2034	EUR	400 000	325 193	0,02
			11 751 611	0,69
Obligations souveraines du marché international				
Commonwealth d'Australie, 3,25 %, 21/06/2039	AUD	10 643 000	6 930 190	0,41
Commonwealth d'Australie, 3 %, 21/03/2047		3 484 000	2 089 125	0,12
République fédérale d'Allemagne, 1,7 %, 15/08/2032	EUR	8 500 000	8 809 973	0,52
Gouvernement des Bermudes, 2,375 %, 20/08/2030	USD	464 000	396 720	0,02
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		210 000	210 847	0,01
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		1 269 000	1 274 118	0,08
Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1/03/2027	CAD	11 567 000	8 087 033	0,48
Gouvernement du Canada, 2 %, 1/06/2032		5 685 000	3 954 184	0,23
Gouvernement finlandais , 0,5 %, 15/09/2027	EUR	6 795 000	6 716 208	0,40
Gouvernement du Japon, 1,7 %, 20/03/2032	JPY	891 450 000	7 524 368	0,44
Gouvernement du Japon, 1,7 %, 20/06/2033		788 000 000	6 658 756	0,39
Gouvernement du Japon, 2,3 %, 20/03/2040		242 000 000	2 152 074	0,13
Gouvernement du Japon, 1,7 %, 20/06/2044		1 756 950 000	14 142 526	0,83
Gouvernement du Japon, 0,3 %, 20/06/2046		479 850 000	2 817 278	0,17
Gouvernement du Japon, 1,6 %, 20/12/2052		103 000 000	789 349	0,05
Royaume de Belgique, 0,4 %, 22/06/2040	EUR	7 436 000	5 139 030	0,30
Royaume d'Espagne, 1,25 %, 31/10/2030		3 467 000	3 302 446	0,19
Royaume d'Espagne, 2,55 %, 31/10/2032		11 230 000	11 474 345	0,68
Royaume d'Espagne, 3,15 %, 30/04/2033		5 005 000	5 344 394	0,32
Royaume d'Espagne, 1 %, 31/10/2050		6 844 000	4 077 132	0,24
République de Chypre, 0 %, 9/02/2026		2 063 000	2 013 093	0,12
République de Chypre, 0,625 %, 21/01/2030		2 400 000	2 136 303	0,13
République de Chypre, 0,95 %, 20/01/2032		2 208 000	1 856 275	0,11
République française, 0,75 %, 25/05/2053		1 282 000	772 961	0,05
République portugaise, 3,5 %, 18/06/2038		1 548 000	1 675 538	0,10
Titres du Trésor britannique, 1,25 %, 22/07/2027	GBP	9 717 000	11 007 454	0,65
Titres du Trésor britannique, 1,25 %, 22/10/2041		3 003 000	2 457 991	0,14
Titres du Trésor britannique, 1,25 %, 31/07/2051		3 950 000	2 775 293	0,16
			126 585 004	7,47
Autorités locales				
Oslo kommune, 2,17 %, 18/05/2029	NOK	16 000 000	1 478 577	0,09
Province de l'Alberta, 4,5 %, 1/12/2040	CAD	585 000	466 175	0,03
Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18/06/2050		635 000	397 823	0,02
			2 342 575	0,14
Machines et outils				
CNH Industrial Capital LLC, 1,875 %, 15/01/2026	USD	1 264 000	1 170 129	0,07
Grandes banques				
Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 2,57 % jusqu'au 25/11/2030, FLR jusqu'au 25/11/2035		1 107 000	853 729	0,05
Bank of America Corp., 3,5 %, 19/04/2026		3 338 000	3 247 857	0,19
Bank of America Corp., 0,694 % jusqu'au 22/03/2030, FLR jusqu'au 22/03/2031	EUR	1 090 000	941 113	0,06
Bank of America Corp., 2,687 % jusqu'au 22/04/2031, FLR jusqu'au 22/04/2032	USD	3 078 000	2 598 610	0,15
Bank of Ireland Group PLC, 4,875 % jusqu'au 16/07/2027, FLR jusqu'au 16/07/2028	EUR	200 000	220 746	0,01
Barclays Bank PLC, 8,407 % jusqu'au 14/11/2027, FLR jusqu'au 14/11/2032	GBP	350 000	464 270	0,03
BNP Paribas S.A., 3,875 %, 10/01/2031	EUR	1 000 000	1 100 957	0,06
Commonwealth Bank of Australia, 2,688 %, 11/03/2031	USD	1 564 000	1 257 407	0,07
Crédit Agricole Group, 3,875 %, 28/11/2034	EUR	800 000	869 242	0,05
Credit Suisse AG (London), 2,125 %, 31/05/2024		840 000	880 627	0,05
Credit Suisse Group AG, 7,75 % jusqu'au 1/03/2028, FLR jusqu'au 1/03/2029		760 000	859 075	0,05
Danske Bank A.S., 4,125 % jusqu'au 10/01/2030, FLR jusqu'au 10/01/2031		920 000	1 002 099	0,06
Goldman Sachs Group, Inc., 2,383 % jusqu'au 21/07/2031, FLR jusqu'au 21/07/2032	USD	2 178 000	1 783 342	0,11
Goldman Sachs Group, Inc., 3,436 % jusqu'au 24/02/2042, FLR jusqu'au 24/02/2043		395 000	317 731	0,02
HSBC Holdings PLC, 2,099 % jusqu'au 4/06/2025, FLR jusqu'au 4/06/2026		1 201 000	1 113 106	0,07

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Grandes banques, suite				
HSBC Holdings PLC, 4,375 %, 23/11/2026	USD	1 124 000	1 106 477	0,07
JPMorgan Chase & Co., 1,47 % jusqu'au 22/09/2026, FLR jusqu'au 22/09/2027		3 421 000	3 030 666	0,18
JPMorgan Chase & Co., 1,953 % jusqu'au 4/02/2031, FLR jusqu'au 4/02/2032		807 000	648 516	0,04
JPMorgan Chase & Co., 3,109 % jusqu'au 22/04/2050, FLR jusqu'au 22/04/2051		744 000	544 188	0,03
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 1,412 %, 17/07/2025		1 745 000	1 597 631	0,09
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2,494 % jusqu'au 13/10/2031, FLR jusqu'au 13/10/2032		520 000	423 890	0,02
Morgan Stanley, 3,125 %, 27/07/2026		1 174 000	1 112 668	0,07
Morgan Stanley, 1,593 % jusqu'au 4/05/2026, FLR jusqu'au 4/05/2027		2 132 000	1 914 557	0,11
Nationwide Building Society, 6,178 % jusqu'au 7/12/2026, FLR jusqu'au 7/12/2027	GBP	220 000	280 618	0,02
NatWest Markets PLC, 6,375 %, 8/11/2027		351 000	456 633	0,03
Société Générale S.A., 4 %, 16/11/2027	EUR	1 000 000	1 104 060	0,06
Société Générale S.A., 4,25 %, 6/12/2030		700 000	753 757	0,04
Standard Chartered PLC, 0,8 % jusqu'au 17/11/2028, FLR jusqu'au 17/11/2029		1 080 000	971 582	0,06
TD Bank, 5,288 %, 11/01/2028	GBP	100 000	126 424	0,01
Toronto-Dominion Bank, 4,108 %, 8/06/2027	USD	1 102 000	1 084 022	0,06
UBS Group AG, 4,375 % jusqu'au 11/01/2030, FLR jusqu'au 11/01/2031	EUR	770 000	849 607	0,05
UBS Group AG, 2,746 % jusqu'au 11/02/2032, FLR jusqu'au 11/02/2033	USD	1 765 000	1 452 454	0,09
Unicaja Banco S.A., 1 % jusqu'au 1/12/2025, FLR jusqu'au 1/12/2026	EUR	1 000 000	978 968	0,06
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026	USD	1 160 000	1 052 361	0,06
Wells Fargo & Co., 3,35 % jusqu'au 2/03/2032, FLR jusqu'au 2/03/2033		1 256 000	1 107 543	0,07
			38 106 533	2,25
Technologies et services médicaux et de santé				
Alcon Finance B.V., 2,375 %, 31/05/2028	EUR	530 000	538 605	0,03
Alcon Finance Corp., 3,8 %, 23/09/2049	USD	294 000	240 850	0,01
Becton, Dickinson and Co., 4,298 %, 22/08/2032		366 000	357 269	0,02
HCA, Inc., 5,125 %, 15/06/2039		526 000	495 793	0,03
Laboratory Corp. of America Holdings, 3,6 %, 1/02/2025		1 152 000	1 121 682	0,07
Laboratory Corp. of America Holdings, 4,7 %, 1/02/2045		718 000	659 083	0,04
Memorial Sloan-Kettering Cancer Center, 2,955 %, 1/01/2050		779 000	561 645	0,03
New York Society for the Relief of the Ruptured & Crippled, 2,667 %, 1/10/2050		1 400 000	925 788	0,06
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 6,015 %, 15/11/2048		737 000	727 124	0,04
Thermo Fisher Scientific (Finance I) Co., 2 %, 18/10/2051	EUR	720 000	517 364	0,03
Thermo Fisher Scientific, Inc., 1,75 %, 15/10/2028	USD	1 193 000	1 039 678	0,06
			7 184 881	0,42
Équipements médicaux				
Boston Scientific Corp., 0,625 %, 1/12/2027	EUR	740 000	703 981	0,04
Boston Scientific Corp., 2,65 %, 1/06/2030	USD	1 855 000	1 646 509	0,10
DH Europe Finance II S.à r.l., 0,45 %, 18/03/2028	EUR	740 000	692 854	0,04
			3 043 344	0,18
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 5,625 %, 1/04/2030	USD	700 000	721 790	0,04
Anglo American Capital PLC, 4,75 %, 21/09/2032	EUR	840 000	937 662	0,05
Glencore Capital Finance DAC, 1,125 %, 10/03/2028		1 210 000	1 122 533	0,07
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031	USD	1 100 000	942 104	0,06
			3 724 089	0,22
Secteur intermédiaire				
Energy Transfer LP, 5,55 %, 15/02/2028		548 000	556 894	0,03
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 2,16 %, 31/03/2034		1 080 928	932 674	0,05
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,2 %, 15/03/2028		1 764 000	1 709 574	0,10
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,5 %, 15/05/2030		859 000	833 826	0,05
Targa Resources Corp., 4,2 %, 1/02/2033		117 000	106 031	0,01
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		710 000	607 933	0,04
			4 746 932	0,28
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 4,5 %, 1/03/2025–1/02/2046		4 765 467	4 813 776	0,27

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques, suite				
Fannie Mae, 3 %, 1/12/2032	USD	7 441	7 210	0,00
Fannie Mae, 5 %, 1/11/2033–1/08/2040		1 321 912	1 355 929	0,09
Fannie Mae, 6 %, 1/09/2037–1/06/2038		179 254	187 378	0,01
Fannie Mae, 4 %, 1/11/2040–1/12/2040		1 192 106	1 172 296	0,07
Fannie Mae, 3,5 %, 1/05/2043–1/12/2046		2 655 972	2 537 699	0,15
Fannie Mae, UMBS, 2 %, 1/07/2037–1/05/2052		5 799 450	4 923 279	0,29
Fannie Mae, UMBS, 3 %, 1/07/2037–1/06/2052		6 417 622	5 884 800	0,36
Fannie Mae, UMBS, 2,5 %, 1/08/2037–1/07/2052		7 863 360	6 979 820	0,39
Fannie Mae, UMBS, 1,5 %, 1/04/2052		1 221 119	976 663	0,06
Fannie Mae, UMBS, 4 %, 1/06/2052–1/08/2052		1 115 949	1 077 997	0,07
Fannie Mae, UMBS, 5,5 %, 1/11/2052–1/12/2052		2 800 644	2 846 490	0,17
Fannie Mae, UMBS, 6 %, 1/12/2052		874 159	898 010	0,05
Freddie Mac, 3,35 %, 25/01/2028		4 830 000	4 691 989	0,28
Freddie Mac, 3,6 %, 25/01/2028		4 870 000	4 784 398	0,28
Freddie Mac, 3,9 %, 25/04/2028		4 120 000	4 102 515	0,24
Freddie Mac, 5 %, 1/10/2035–1/07/2041		673 799	694 281	0,04
Freddie Mac, 5,5 %, 1/07/2037		34 633	36 413	0,00
Freddie Mac, 4,5 %, 1/07/2039–1/05/2042		1 812 463	1 843 828	0,10
Freddie Mac, 3,5 %, 1/12/2042–1/04/2043		276 772	267 411	0,01
Freddie Mac, UMBS, 2,5 %, 1/11/2036–1/08/2052		8 354 601	7 327 661	0,44
Freddie Mac, UMBS, 2 %, 1/04/2037–1/05/2052		6 933 992	5 880 320	0,37
Freddie Mac, UMBS, 3,5 %, 1/01/2047		1 132 283	1 085 234	0,06
Freddie Mac, UMBS, 3 %, 1/06/2050–1/06/2052		1 542 801	1 404 586	0,08
Freddie Mac, UMBS, 4 %, 1/05/2052		168 190	163 797	0,01
Freddie Mac, UMBS, 6 %, 1/11/2052		595 759	612 010	0,04
Ginnie Mae, 5 %, 15/05/2040–20/11/2052		1 349 782	1 364 760	0,08
Ginnie Mae, 3,5 %, 20/06/2043–20/10/2052		1 550 191	1 490 574	0,09
Ginnie Mae, 2,5 %, 20/08/2051–20/05/2052		2 065 995	1 842 816	0,10
Ginnie Mae, 3 %, 20/10/2051–20/10/2052		2 462 537	2 265 556	0,14
Ginnie Mae, 2 %, 20/01/2052–20/03/2052		1 479 393	1 278 914	0,07
Ginnie Mae, 4 %, 20/09/2052–20/10/2052		1 165 673	1 131 604	0,07
Ginnie Mae, 4,5 %, 20/09/2052–20/11/2052		1 643 490	1 631 954	0,10
Ginnie Mae, 5,5 %, 20/12/2052		949 906	965 846	0,06
Ginnie Mae, TBA, 3,5 %, 21/02/2053		575 000	543 633	0,03
UMBS, TBA, 5,5 %, 13/02/2053		750 000	762 129	0,05
UMBS, TBA, 5 %, 13/04/2053		25 000	25 061	0,00
			79 858 637	4,72
Obligations municipales				
Colorado Housing & Finance Authority Rev., Single Family Mortgage Class I, Taxable, "D-1", GNMA, 5 %, 1/11/2047		825 000	824 829	0,05
Connecticut Higher Education Supplemental Loan Authority Rev. Taxable (Chesla Loan Program), "C", 4,668 %, 15/11/2034		1 350 000	1 287 264	0,08
Iowa Student Loan Liquidity Corp. Rev., Taxable, "A", 5,08 %, 1/12/2039		1 160 000	1 099 874	0,06
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 4,949 %, 1/07/2038		2 005 000	1 970 179	0,12
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Subordinate Rev., Taxable, "A", 2,641 %, 1/07/2037		1 315 000	1 205 584	0,07
Massachusetts Housing Finance Agency, Single Family Housing Rev., Taxable, "226", 5,562 %, 1/12/2052		1 225 000	1 244 703	0,07
Michigan Finance Authority Hospital Rev., Taxable (Trinity Health Credit Group), 3,384 %, 1/12/2040		1 190 000	1 009 661	0,06
Minnesota Housing Finance Agency, Residential Housing, Taxable, "G", 4,337 %, 1/01/2047		1 115 000	1 083 373	0,06
New Jersey Economic Development Authority State Pension Funding Rev., Taxable, "A", NPFG, 7,425 %, 15/02/2029		1 016 000	1 116 365	0,07
Oklahoma Development Finance Authority, Health System Rev., Taxable (OU Medicine Project), "C", AGM, 4,65 %, 15/08/2030		1 378 000	1 239 393	0,07
			12 081 225	0,71
Gaz naturel - Distribution				
Boston Gas Co., 3,15 %, 1/08/2027		1 310 000	1 208 420	0,07
ENGIE S.A. , 4,25 %, 11/01/2043	EUR	100 000	109 555	0,01
Infraestructura Energética Nova S.A.B. de C.V., 4,875 %, 14/01/2048	USD	900 000	711 118	0,04
			2 029 093	0,12

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 0,75 %, 15/03/2029	EUR	1 040 000	930 131	0,06
APA Infrastructure Ltd., 2,5 %, 15/03/2036	GBP	790 000	680 130	0,04
			1 610 261	0,10
Réseaux et télécommunications				
AT&T, Inc., 3,45 %, 19/09/2023	AUD	1 350 000	948 004	0,06
AT&T, Inc., 3,5 %, 15/09/2053	USD	720 000	531 321	0,03
Orange S.A., 3,625 %, 16/11/2031	EUR	1 000 000	1 101 471	0,07
Verizon Communications, Inc., 2,1 %, 22/03/2028	USD	622 000	554 704	0,03
Verizon Communications, Inc., 2,55 %, 21/03/2031		1 133 000	967 068	0,06
Verizon Communications, Inc., 3,55 %, 22/03/2051		1 143 000	886 354	0,05
			4 988 922	0,30
Pétrole				
Neste Oyj, 0,75 %, 25/03/2028	EUR	900 000	853 524	0,05
Phillips 66, 4,875 %, 15/11/2044	USD	607 000	595 426	0,04
			1 448 950	0,09
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
AIB Group PLC, 5,75 % jusqu'au 16/02/2028, FLR jusqu'au 16/02/2029	EUR	835 000	957 896	0,06
Arion Banki HF, 4,875 %, 21/12/2024		1 230 000	1 319 140	0,08
Belfius Bank S.A., 5,25 %, 19/04/2033		800 000	870 710	0,05
BPCE S.A., 2,277 % jusqu'au 20/01/2031, FLR jusqu'au 20/01/2032	USD	1 100 000	868 059	0,05
CaixaBank S.A., 5,375 % jusqu'au 14/11/2029, FLR jusqu'au 14/11/2030	EUR	800 000	909 494	0,05
CaixaBank S.A., 6,875 % jusqu'au 25/10/2028, FLR jusqu'au 25/10/2033	GBP	500 000	619 762	0,04
Deutsche Bank AG, 1,875 % jusqu'au 23/02/2027, FLR jusqu'au 23/02/2028	EUR	400 000	391 185	0,02
Deutsche Bank AG, 3,25 % jusqu'au 24/05/2027, FLR jusqu'au 24/05/2028		200 000	206 059	0,01
Deutsche Bank AG, 1,375 % jusqu'au 17/02/2031, FLR jusqu'au 17/02/2032		500 000	417 210	0,02
Deutsche Bank AG, 4 % jusqu'au 24/06/2027, FLR jusqu'au 24/06/2032		800 000	802 846	0,05
Groupe BPCE S.A., 4,5 %, 15/03/2025	USD	1 033 000	1 005 806	0,06
Groupe des Assurances du Credit Mutuel, 1,85 % jusqu'au 21/04/2032, FLR jusqu'au 21/04/2042	EUR	1 100 000	897 377	0,05
Intesa Sanpaolo S.p.A., 2,625 %, 11/03/2036	GBP	1 160 000	994 881	0,06
Macquarie Group Ltd., 4,08 %, 31/05/2029		960 000	1 096 452	0,07
Virgin Money UK PLC, 5,125 % jusqu'au 11/12/2025, FLR jusqu'au 11/12/2030		890 000	1 043 535	0,06
			12 400 412	0,73
Lutte contre la pollution				
Waste Connections, Inc., 4,2 %, 15/01/2033	USD	1 750 000	1 700 033	0,10
Imprimerie et édition				
Informa PLC, 3,125 %, 5/07/2026	GBP	488 000	561 749	0,03
Chemins de fer et transport maritime				
Canadian Pacific Railway Co., 2,45 %, 2/12/2031	USD	420 000	362 703	0,02
Immobilier - Bureaux				
Corporate Office Property LP, REIT, 2,25 %, 15/03/2026		742 000	671 515	0,04
Corporate Office Property LP, REIT, 2 %, 15/01/2029		452 000	358 406	0,02
Corporate Office Property LP, REIT, 2,75 %, 15/04/2031		929 000	725 101	0,04
			1 755 022	0,10
Immobilier - Autres				
EPR Properties, REIT, 3,6 %, 15/11/2031		777 000	600 680	0,03
Lexington Realty Trust Co., 2,7 %, 15/09/2030		980 000	809 383	0,05
W.P. Carey, Inc., REIT, 2,4 %, 1/02/2031		1 414 000	1 185 627	0,07
			2 595 690	0,15
Immobilier - Distribution				
Brixmor Operating Partnership LP, REIT, 4,05 %, 1/07/2030		1 039 000	950 223	0,05
Hammerson Ireland Finance DAC, 1,75 %, 3/06/2027	EUR	696 000	616 400	0,04
Regency Centers Corp., 3,7 %, 15/06/2030	USD	305 000	276 232	0,02
Spirit Realty, LP, REIT, 3,2 %, 15/01/2027		566 000	515 421	0,03
STORE Capital Corp., REIT, 2,7 %, 1/12/2031		1 019 000	768 383	0,04

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Immobilier - Distribution, suite				
WEA Finance LLC, 2,875 %, 15/01/2027	USD	920 000	808 158	0,05
			3 934 817	0,23
Distribution				
AutoZone, Inc., 4,75 %, 1/08/2032		363 000	363 002	0,02
Home Depot, Inc., 4,875 %, 15/02/2044		531 000	540 429	0,03
Home Depot, Inc., 3,625 %, 15/04/2052		1 220 000	1 017 470	0,06
			1 920 901	0,11
Produits chimiques spéciaux				
Covestro AG, 4,75 %, 15/11/2028	EUR	800 000	887 489	0,05
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,832 %, 15/10/2027	USD	785 000	679 331	0,04
			1 566 820	0,09
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		1 082 000	885 314	0,05
Hypermarchés				
ELO SACA, 4,875 %, 8/12/2028	EUR	500 000	523 191	0,03
Organismes supranationaux				
European Financial Stability Facility, 3,375 %, 3/04/2037		883 000	989 392	0,06
European Stability Mechanism, 1 %, 23/06/2027		2 290 000	2 302 378	0,14
European Stability Mechanism, 0,5 %, 5/03/2029		2 460 000	2 331 392	0,14
European Stability Mechanism, 0,01 %, 15/10/2031		4 850 000	4 127 970	0,24
International Bank for Reconstruction and Development, 4,25 %, 24/06/2025	AUD	995 000	710 101	0,04
West African Development Bank, 4,7 %, 22/10/2031	USD	1 299 000	1 146 368	0,07
			11 607 601	0,69
Télécommunications mobiles				
Crown Castle, Inc., REIT, 1,35 %, 15/07/2025		576 000	529 172	0,03
Crown Castle, Inc., REIT, 3,7 %, 15/06/2026		777 000	749 638	0,04
Rogers Communications, Inc., 3,8 %, 15/03/2032		834 000	750 704	0,05
T-Mobile USA, Inc., 3,875 %, 15/04/2030		1 646 000	1 541 613	0,09
			3 571 127	0,21
Services téléphoniques				
Deutsche Telekom AG, 1,375 %, 5/07/2034	EUR	1 060 000	918 580	0,06
TELUS Corp., 2,85 %, 13/11/2031	CAD	1 910 000	1 243 456	0,07
			2 162 036	0,13
Tabac				
B.A.T. Capital Corp., 2,125 %, 15/08/2025	GBP	980 000	1 125 066	0,07
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 17/11/2027	USD	170 000	173 746	0,01
			1 298 812	0,08
Transports - Services				
Autostrade per L'Italia S.p.A., 4,75 %, 24/01/2031	EUR	860 000	930 349	0,05
ERAC USA Finance LLC, 7 %, 15/10/2037	USD	680 000	790 823	0,05
Holding d'Infrastructures de Transport, 1,475 %, 18/01/2031	EUR	1 100 000	979 414	0,06
Triton International Ltd., 3,15 %, 15/06/2031	USD	866 000	696 238	0,04
Vinci S.A., 3,75 %, 10/04/2029		1 552 000	1 466 629	0,09
			4 863 453	0,29
Sociétés publiques fédérales américaines et sociétés similaires				
Small Business Administration, 5,31 %, 1/05/2027		33 225	32 915	0,00
Small Business Administration, 2,22 %, 1/03/2033		361 950	332 919	0,02
			365 834	0,02
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 1,125 %, 15/08/2040		19 412 000	12 880 165	0,76
Obligations du Trésor américain, 2,375 %, 15/11/2049 (g)		19 386 000	15 077 916	0,89
Bons du Trésor américain, 2,75 %, 15/08/2032		7 415 000	6 977 052	0,41
			34 935 133	2,06
Services publics - Énergie électrique				
American Electric Power Co., Inc., 2,3 %, 1/03/2030		1 432 000	1 209 572	0,07

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services publics - Énergie électrique, suite				
Bruce Power LP, 2,68 %, 21/12/2028	CAD	1 700 000	1 161 744	0,07
Duke Energy Corp., 3,75 %, 1/09/2046	USD	1 272 000	1 009 613	0,06
E.ON SE, 3,875 %, 12/01/2035	EUR	540 000	582 717	0,03
Enel Americas S.A., 4 %, 25/10/2026	USD	4 326 000	4 239 177	0,25
Enel Finance International N.V., 2,25 %, 12/07/2031		210 000	163 865	0,01
Enel Finance International N.V., 4,75 %, 25/05/2047		564 000	480 767	0,03
Enel S.p.A., 2,25 % jusqu'au 10/03/2027, FLR jusqu'au 10/03/2070	EUR	665 000	626 874	0,04
Enel S.p.A., 1,875 % jusqu'au 8/09/2030, FLR jusqu'au 8/03/2170		1 075 000	856 063	0,05
Evergy, Inc., 2,9 %, 15/09/2029	USD	1 178 000	1 047 593	0,06
Florida Power & Light Co., 2,875 %, 4/12/2051		646 000	469 732	0,03
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		815 000	689 725	0,04
National Grid Electricity Transmission PLC, 2 %, 17/04/2040	GBP	940 000	753 955	0,05
National Grid PLC, 3,875 %, 16/01/2029	EUR	480 000	523 165	0,03
National Grid PLC, 4,275 %, 16/01/2035		450 000	487 765	0,03
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 3,55 %, 1/05/2027	USD	382 000	366 690	0,02
Southern California Edison Co., 3,65 %, 1/02/2050		524 000	411 908	0,02
Southern Co., 1,875 %, 15/09/2081	EUR	100 000	88 157	0,01
Virginia Electric & Power Co., 3,5 %, 15/03/2027	USD	2 480 000	2 392 610	0,14
Xcel Energy, Inc., 4,6 %, 1/06/2032		387 000	383 179	0,02
			17 944 871	1,06
Total des obligations (coût identifié, 666 105 973 $)			623 293 567	36,79
ACTIONS PRIVILÉGIÉES				
Logiciels - Systèmes				
Samsung Electronics Co. Ltd.		25 932	1 168 528	0,07
Biens de consommation				
Henkel AG & Co. KGaA		120 292	8 552 717	0,50
Métaux et exploitation minière				
Gerdau S.A.		569 600	3 673 680	0,22
Total des actions privilégiées (coût identifié, 15 957 890 $)			13 394 925	0,79
ACTIONS PRIVILÉGIÉES CONVERTIBLES				
Équipements médicaux				
Boston Scientific Corp., 5,5 % (coût identifié, 1 585 441 $)		14 584	1 664 472	0,10
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 61 635 000 $)	USD	61 635 000	61 635 000	3,64
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 1 579 211 341 $)			1 691 449 787	99,85

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES				
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5,25 %	EUR	5 950 000	39 209	0,01
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		3 070 000	25 808	0,00
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		4 320 000	36 316	0,00
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		2 280 000	19 166	0,00
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 5 %		1 430 000	12 021	0,00
Total des options de vente achetées (primes versées, 200 928 $)			132 520	0,01
Total des Options d'Achat Achetées				
iTraxx Europe Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 1 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Février 2023 @ 0,9 %	EUR	36 470 000	187 264	0,01

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
Total des Options d'Achat Achetées, suite				
iTraxx Europe Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 1 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mars 2023 @ 0,9 %	EUR	27 010 000	148 099	0,01
iTraxx Europe Series 38 Index Credit Default Swap-Le Compartiment reçoit 1 %, Le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mars 2023 @ 0,9 %		27 010 000	148 098	0,01
Total des Options d'Achat Achetées (primes versées, 202 206 $)			483 461	0,03
Total des investissements (coût identifié, 1 579 614 475 $) (k)			1 692 065 768	99,89
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			1 852 570	0,11
ACTIF NET			1 693 918 338	100,00

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

MFS Meridian Funds - Inflation-Adjusted Bond Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Créances adossées à des actifs et titrisées				
Arbor Multi-Family Mortgage Securities Trust, 2021-MF3, "XA", 0,741 %, 15/10/2054 (i)	USD	6 306 984	262 680	0,12
AREIT 2022-CRE6 Trust, "AS", FLR, 5,96 %, 16/01/2037		1 033 500	972 971	0,47
BSPDF 2021-FL1 Issuer Ltd., "AS", FLR, 5,934 %, 15/10/2036		445 000	432 325	0,21
BSPRT 2021-FL6 Issuer Ltd., "AS", FLR, 5,754 %, 15/03/2036		483 500	460 118	0,22
PFP III 2021-8 Ltd., "AS", FLR, 5,704 %, 9/08/2037		699 500	658 669	0,32
			2 786 763	1,34
Services de consommation				
Conservation Fund, 3,474 %, 15/12/2029		86 000	75 759	0,04
Industrie				
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,416 %, 1/10/2024		22 000	20 886	0,01
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,516 %, 1/10/2025		26 000	24 520	0,01
			45 406	0,02
Technologies et services médicaux et de santé				
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,325 %, 15/11/2028		162 000	163 858	0,08
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,75 %, 15/11/2038		79 000	79 526	0,04
			243 384	0,12
Obligations municipales				
California Earthquake Authority Rev., Taxable, "B", 1,477 %, 1/07/2023		225 000	221 640	0,11
Chicago, IL, Transit Authority Sales Tax Receipts Refunding Rev., Taxable, "B", 2,064 %, 1/12/2024		115 000	110 071	0,05
Chicago, IL, Transit Authority Sales Tax Receipts Refunding Rev., Taxable, "B", 2,214 %, 1/12/2025		87 000	81 816	0,04
Colorado Health Facilities Authority Rev., Taxable (Covenant Living Communities and Services), "B", 2,8 %, 1/12/2026		180 000	169 614	0,08
Golden State, CA, Tobacco Securitization Corp., Tobacco Settlement Rev., Taxable, "B", 3 %, 1/06/2046		390 000	362 676	0,17
Golden State, CA, Tobacco Securitization Corp., Tobacco Settlement Rev., Taxable, "B-1", 1,85 %, 1/06/2031		160 000	158 362	0,08
Luzerne, Carbon and Schuylkill Counties, PA, Hazleton Area School District, General Obligation, Taxable, "B", AGM, 0,833 %, 1/03/2024		610 000	585 840	0,28
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 2,682 %, 1/07/2027		230 000	210 600	0,10
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Subordinate Rev., Taxable, "A", 2,641 %, 1/07/2037		1 095 000	1 003 889	0,48
Michigan Finance Authority Student Loan Asset-Backed Rev., Taxable, "A-1A", 1,3 %, 25/07/2061		396 574	369 998	0,18
Michigan Finance Authority Tobacco Settlement Asset-Backed Rev., Taxable (2006 Recettes vendues de tabac), "A-1", 2,326 %, 1/06/2030		107 024	102 456	0,05
Nassau County, NY, Interim Finance Authority Sales Tax, Taxable, "B", 1,278 %, 15/11/2028		750 000	627 442	0,30
New Jersey Economic Development Authority State Pension Funding Rev., Appréciation du capital, Taxable, "B", AGM, 0 %, 15/02/2023		524 000	523 074	0,25
New Jersey Turnpike Authority, Turnpike Rev., Taxable, "B", 1,047 %, 1/01/2026		205 000	187 460	0,09

MFS Meridian Funds - Inflation-Adjusted Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations municipales, suite				
Philadelphia, PA, School District, Taxable, "A", AGM, 5,995 %, 1/09/2030	USD	215 000	231 838	0,11
Port of Oakland, CA, Senior Lien Refunding Rev., Taxable, "R", 1,517 %, 1/05/2026		225 000	204 914	0,10
Rhode Island Student Loan Authority, Education Loan Rev., Taxable, "2", 2,348 %, 1/12/2040		640 000	602 164	0,29
University of California, General Taxable Rev., Taxable, "BG", 1,614 %, 15/05/2030		330 000	273 879	0,13
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,497 %, 1/06/2024		190 000	181 251	0,09
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,647 %, 1/06/2025		155 000	143 475	0,07
			6 352 459	3,05
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation				
Obligations du Trésor américain, 2,375 %, 15/01/2025		5 913 274	5 939 991	2,85
Obligations du Trésor américain, 2 %, 15/01/2026		10 069 299	10 130 069	4,87
Obligations du Trésor américain, 1,75 %, 15/01/2028		2 597 734	2 640 785	1,27
Obligations du Trésor américain, 3,625 %, 15/04/2028		6 810 516	7 549 031	3,63
Obligations du Trésor américain, 0,75 %, 15/02/2042		13 188 475	11 513 513	5,53
Obligations du Trésor américain, 0,625 %, 15/02/2043		4 469 995	3 776 142	1,81
Obligations du Trésor américain, 0,75 %, 15/02/2045		7 049 514	6 005 787	2,89
Obligations du Trésor américain, 1 %, 15/02/2048		2 522 008	2 235 105	1,07
Obligations du Trésor américain, 0,25 %, 15/02/2050		1 598 360	1 153 067	0,55
Obligations du Trésor américain, 0,125 %, 15/02/2051		4 116 600	2 840 132	1,36
Obligations du Trésor américain, TIPS, 0,125 %, 15/02/2052		4 213 672	2 904 965	1,40
Bons du Trésor américain, 0,625 %, 15/01/2024		10 459 992	10 255 151	4,93
Bons du Trésor américain, 0,25 %, 15/01/2025		27 193 897	26 233 081	12,60
Bons du Trésor américain, 0,375 %, 15/07/2025		9 705 497	9 387 699	4,51
Bons du Trésor américain, 0,625 %, 15/01/2026		16 363 266	15 828 477	7,60
Bons du Trésor américain, 0,375 %, 15/01/2027		6 382 910	6 098 921	2,93
Bons du Trésor américain, 0,375 %, 15/07/2027		12 466 141	11 928 782	5,73
Bons du Trésor américain, 0,5 %, 15/01/2028		3 391 501	3 245 640	1,56
Bons du Trésor américain, 0,875 %, 15/01/2029		16 353 285	15 914 269	7,64
Bons du Trésor américain, 0,125 %, 15/07/2030		12 894 682	11 851 522	5,69
Bons du Trésor américain, 0,125 %, 15/01/2031		18 723 838	17 085 136	8,21
Bons du Trésor américain, TIPS, 0,125 %, 15/01/2032		14 428 921	13 027 315	6,26
			197 544 580	94,89
Services publics - Énergie électrique				
Pacific Gas & Electric Co., 3,25 %, 16/02/2024		649 000	637 021	0,31
Total des obligations (coût identifié, 234 057 641 $)			**207 685 372**	**99,77**
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 512 000 $)	USD	512 000	512 000	0,24
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 234 569 641 $)			**208 197 372**	**100,01**
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			**(26 873)**	**(0,01)**
ACTIF NET			**208 170 499**	**100,00**

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

MFS Meridian Funds - Japan Equity Fund

(en yen japonais)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (¥)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Boissons alcoolisées			
Kirin Holdings Co. Ltd.	3 200	6 415 319	1,71

MFS Meridian Funds - Japan Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (¥)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Industrie automobile			
Bridgestone Corp.	2 000	9 741 597	2,60
DENSO Corp.	1 300	9 142 444	2,44
Koito Manufacturing Co. Ltd.	3 500	7 695 023	2,06
		26 579 064	7,10
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Japan Exchange Group, Inc.	2 400	4 786 367	1,28
Services aux entreprises			
Nomura Research Institute Ltd.	2 700	8 431 386	2,25
SCSK Corp.	4 700	9 963 360	2,66
Sohgo Security Services Co. Ltd.	1 900	6 813 700	1,82
		25 208 446	6,73
Logiciels			
Oracle Corp. Japan	900	8 014 245	2,14
Logiciels - Systèmes			
Fujitsu Ltd.	600	11 184 619	2,99
Hitachi Ltd.	2 400	16 403 466	4,38
		27 588 085	7,37
Biens de consommation			
Kao Corp.	1 500	7 961 224	2,13
KOSE Corp.	700	10 029 045	2,68
		17 990 269	4,81
Services de consommation			
Persol Holdings Co. Ltd.	2 600	7 416 791	1,98
Équipements électriques			
Keyence Corp.	200	12 025 339	3,21
OMRON Corp.	500	3 772 813	1,01
		15 798 152	4,22
Électronique			
Amano Corp.	1 600	3 807 024	1,02
DISCO Corp.	100	3 908 417	1,04
Hoya Corp.	200	2 866 648	0,77
JSR Corp.	1 800	5 278 229	1,41
Kyocera Corp.	1 300	8 798 082	2,35
Murata Manufacturing Co. Ltd.	300	2 243 552	0,60
ROHM Co. Ltd.	600	6 257 197	1,67
Tokyo Electron Ltd.	100	4 567 758	1,22
		37 726 907	10,08
Énergie - Sociétés intégrées			
Idemitsu Kosan Co. Ltd.	300	973 713	0,26
Alimentation et boissons			
Ezaki Glico Co. Ltd.	1 400	5 090 131	1,36
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Seven & I Holdings Co. Ltd.	1 800	11 076 982	2,96
Sugi Holdings Co. Ltd.	900	5 122 351	1,37
TSURUHA Holdings, Inc.	200	1 915 130	0,51
		18 114 463	4,84
Assurances			
Tokio Marine Holding, Inc.	2 600	7 083 772	1,89
Internet			
Z Holdings Corp.	8 700	3 275 221	0,87
Loisirs et jouets			
Yamaha Corp.	1 100	5 569 710	1,49
Machines et outils			
Daikin Industries Ltd.	500	11 331 868	3,03
Kubota Corp.	1 700	3 320 769	0,89

MFS Meridian Funds - Japan Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (¥)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Machines et outils, suite			
OSG Corp.	3 400	6 946 762	1,85
SMC Corp.	200	13 234 434	3,53
Toyota Industries Corp.	1 300	10 297 655	2,75
		45 131 488	12,05
Grandes banques			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	9 400	8 980 786	2,40
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	1 700	9 628 856	2,57
		18 609 642	4,97
Équipements médicaux			
Nakanishi, Inc.	2 200	6 073 341	1,62
Shimadzu Corp.	1 300	5 184 441	1,39
Terumo Corp.	2 300	8 693 094	2,32
		19 950 876	5,33
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
AEON Financial Service Co. Ltd.	3 000	3 956 718	1,06
Produits pharmaceutiques			
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	900	3 038 774	0,81
Kyowa Kirin Co. Ltd.	2 300	6 684 708	1,79
Santen Pharmaceutical Co. Ltd.	5 300	5 353 000	1,43
		15 076 482	4,03
Lutte contre la pollution			
Daiseki Co. Ltd.	1 240	5 423 545	1,45
Chemins de fer et transport maritime			
Sankyu, Inc.	1 200	6 144 227	1,64
Produits chimiques spéciaux			
Kansai Paint Co. Ltd.	4 200	7 701 778	2,06
Nippon Sanso Holdings Corp.	1 500	3 187 683	0,85
Nitto Denko Corp.	1 000	8 423 511	2,25
		19 312 972	5,16
Magasins spécialisés			
ZOZO, Inc.	1 700	5 735 993	1,53
Télécommunications mobiles			
KDDI Corp.	800	3 253 535	0,87
SoftBank Group Corp.	1 000	6 204 125	1,66
		9 457 660	2,53
Transport par camion			
Yamato Holdings Co. Ltd.	2 000	4 547 307	1,21
Total des actions ordinaires (coût identifié, 381 106 259 ¥)		370 977 565	99,09
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 381 106 259 ¥) (k)		370 977 565	99,09
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		3 423 773	0,91
ACTIF NET		374 401 338	100,00

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

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Aérospatiale et défense				
Huntington Ingalls Industries, Inc., 3,844 %, 1/05/2025	USD	2 917 000	2 829 283	0,33

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Aérospatiale et défense, suite				
Raytheon Technologies Corp., 3,65 %, 16/08/2023	USD	153 000	151 884	0,02
			2 981 167	0,35
Créances adossées à des actifs et titrisées				
ACREC 2021-FL1 Ltd., "AS", FLR, 5,97 %, 16/10/2036		2 218 000	2 125 409	0,25
ACREC 2021-FL1 Ltd., "B", FLR, 6,27 %, 16/10/2036		1 722 000	1 650 075	0,19
ACREC 2021-FL1 Ltd., "C", FLR, 6,62 %, 16/10/2036		2 228 500	2 126 932	0,25
ACRES 2021-FL2 Issuer Ltd., "B", FLR, 6,714 %, 15/01/2037		3 356 500	3 243 622	0,38
Allegro CLO Ltd., 2014-1RA, "A2", FLR, 6,415 %, 21/10/2028		370 984	366 610	0,04
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "B", FLR, 5,923 %, 15/12/2035		815 000	756 991	0,09
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "C", FLR, 6,423 %, 15/12/2035		334 000	316 301	0,04
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL3, "B", FLR, 6,054 %, 15/08/2034		1 129 000	1 034 008	0,12
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL3, "C", FLR, 6,304 %, 15/08/2034		655 000	592 577	0,07
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL4, "AS", FLR, 6,154 %, 15/11/2036		1 500 000	1 472 918	0,17
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL4, "B", FLR, 6,454 %, 15/11/2036		1 500 000	1 455 546	0,17
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL4, "C", FLR, 6,754 %, 15/11/2036		1 618 000	1 546 126	0,18
AREIT 2019-CRE3 Trust, "A", FLR, 5,867 %, 14/09/2036		293 272	290 047	0,03
AREIT 2019-CRE3 Trust, "AS", FLR, 5,897 %, 14/09/2036		1 053 000	1 026 100	0,12
AREIT 2019-CRE3 Trust, "B", FLR, 6,147 %, 14/09/2036		520 000	500 420	0,06
AREIT 2019-CRE3 Trust, "C", FLR, 6,497 %, 14/09/2036		430 000	408 042	0,05
AREIT 2022-CRE6 Trust, "C", FLR, 6,46 %, 16/01/2037		894 000	832 006	0,10
AREIT 2022-CRE6 Trust, "D", FLR, 7,16 %, 17/12/2024		1 194 000	1 105 126	0,13
Ballyrock CLO 2018-1A Ltd., "A2", FLR, 6,407 %, 20/04/2031		2 039 051	1 994 349	0,23
Ballyrock CLO 2018-1A Ltd., "B", FLR, 6,707 %, 20/04/2031		864 096	829 142	0,10
Bayview Financial Revolving Mortgage Loan Trust, FLR, 6,147 %, 28/12/2040		74 271	92 456	0,01
BBCMS Mortgage Trust, 2018-C2, "XA", 0,757 %, 15/12/2051 (i)		27 340 930	934 756	0,11
BDS 2021-FL10 Ltd., "B", FLR, 6,42 %, 16/12/2036		550 000	530 794	0,06
BDS 2021-FL10 Ltd., "C", FLR, 6,639 %, 16/12/2036		400 000	384 034	0,05
BSPRT 2019-FL5 Issuer Ltd., "C", FLR, 6,454 %, 9/05/2029		3 374 000	3 291 435	0,38
BSPRT 2021-FL6 Issuer Ltd., "C", FLR, 6,504 %, 15/03/2036		1 069 000	979 728	0,11
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "B", FLR, 6,504 %, 15/12/2038		832 000	777 026	0,09
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "C", FLR, 6,754 %, 15/12/2038		719 000	666 614	0,08
BSPRT 2022-FL8 Issuer Ltd., "A", FLR, 5,778 %, 15/02/2037		4 867 000	4 756 917	0,55
Business Jet Securities LLC, 2020-1A, "A", 2,981 %, 15/11/2035		403 527	370 248	0,04
Business Jet Securities LLC, 2021-1A, "A", 2,162 %, 15/04/2036		699 390	628 541	0,07
Business Jet Securities LLC, 2021-1A, "B", 2,918 %, 15/04/2036		132 525	115 458	0,01
BXMT 2020-FL2 Ltd., "B", FLR, 5,997 %, 15/02/2038		2 765 000	2 614 628	0,30
BXMT 2020-FL2 Ltd., "A", FLR, 5,497 %, 15/02/2038		3 341 514	3 291 651	0,38
BXMT 2021-FL4 Ltd., "AS", FLR, 5,759 %, 15/05/2038		5 130 500	4 918 777	0,57
Capital Automotive, 2020-1A, "A4", REIT, 3,19 %, 15/02/2050		1 023 404	966 779	0,11
C-BASS Mortgage Loan Trust, 2007-CB3, "A3", 3,27 %, 25/03/2037 (d)		783 845	299 583	0,04
CD 2017-CD4 Mortgage Trust, "XA", 1,226 %, 10/05/2050 (i)		18 284 333	714 921	0,08
CIFC Funding 2012-2RA Ltd., "A2", FLR, 6,057 %, 20/01/2028		5 000 000	4 928 435	0,57
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-4, "B", 1,74 %, 16/12/2030		1 180 000	1 096 716	0,13
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-2A, "A", 0,96 %, 15/02/2030		984 000	950 209	0,11
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-2A, "B", 1,26 %, 15/04/2030		463 000	427 617	0,05
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-3A, "B", 1,38 %, 15/07/2030		612 000	567 564	0,07
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-3A, "C", 1,63 %, 16/09/2030		370 000	336 571	0,04
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-4, "A", 1,26 %, 15/10/2030		643 000	607 345	0,07
Cutwater 2015-1A Ltd., "AR", FLR, 6,012 %, 15/01/2029		905 125	901 068	0,11
Fortress CBO Investments Ltd., 2022-FL3, "A", FLR, 6,16 %, 23/02/2039		2 906 500	2 817 805	0,33
GMAC Mortgage Corp. Loan Trust, FGIC, 5,805 %, 25/10/2036		78 767	77 957	0,01
GS Mortgage Securities Trust, 2017-GS6, "XA", 1,012 %, 10/05/2050 (i)		19 702 361	691 984	0,08
GS Mortgage Securities Trust, 2017-GS7, "XA", 1,082 %, 10/08/2050 (i)		18 237 014	644 047	0,08
IMPAC CMB Trust, FLR, 5,246 %, 25/11/2034		19 078	18 599	0,00

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Créances adossées à des actifs et titrisées, suite				
IMPAC CMB Trust, FLR, 5,426 %, 25/11/2034	USD	24 528	24 073	0,00
IMPAC Secured Assets Corp., FLR, 5,205 %, 25/05/2036		20 022	17 008	0,00
Interstar Millennium Trust, FLR, 5,152 %, 14/03/2036		15 681	15 017	0,00
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp., 0,987 %, 15/09/2050 (i)		18 987 434	600 715	0,07
LoanCore 2018-CRE1 Ltd., "AS", FLR, 5,959 %, 15/05/2028		1 460 642	1 455 066	0,17
LoanCore 2018-CRE1 Ltd., "C", FLR, 7,009 %, 15/05/2028		822 000	799 019	0,09
LoanCore 2019-CRE3 Ltd., "AS", FLR, 5,829 %, 15/04/2034		2 730 152	2 742 424	0,32
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "AS", FLR, 6,204 %, 15/07/2036		3 422 000	3 244 635	0,38
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "B", FLR, 6,454 %, 15/07/2036		1 447 000	1 366 882	0,16
Madison Park Funding Ltd., 2014-13A, "BR2", FLR, 6,297 %, 19/04/2030		3 240 360	3 188 433	0,37
Merrill Lynch Mortgage Investors, Inc., 4,25 %, 25/02/2037 (i)		810 454	111 463	0,01
MF1 2020-FL4 Ltd., "B", FLR, 7,347 %, 15/11/2035		5 144 500	5 138 157	0,60
MF1 2021-FL5 Ltd., "B", FLR, 6,047 %, 15/07/2036		5 771 500	5 574 965	0,65
MF1 2021-FL5 Ltd., "C", FLR, 6,297 %, 15/07/2036		1 641 500	1 532 038	0,18
MF1 2021-FL6 Ltd., "B", FLR, 6,12 %, 16/07/2036		4 288 675	4 072 129	0,47
MF1 2022-FL8 Ltd., "C", FLR, 6,509 %, 19/02/2037		1 570 086	1 471 383	0,17
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, 2017-C33, "XA", 1,251 %, 15/05/2050 (i)		17 395 802	671 857	0,08
Morgan Stanley Capital I Trust, 2017-H1, "XA", 1,324 %, 15/06/2050 (i)		8 860 127	325 346	0,04
Morgan Stanley Capital I Trust, 2018-H4, "XA", 0,831 %, 15/12/2051 (i)		22 334 520	811 697	0,09
OneMain Financial Issuance Trust, 2020-1A, "A", 3,84 %, 14/05/2032		1 381 808	1 373 052	0,16
OneMain Financial Issuance Trust, 2020-2A, "A", 1,75 %, 14/09/2035		2 503 000	2 230 388	0,26
OneMain Financial Issuance Trust, 2022-S1, "A", 4,13 %, 14/05/2035		1 609 000	1 564 610	0,18
PFP III 2021-7 Ltd., "B", FLR, 5,854 %, 14/04/2038		1 326 934	1 242 009	0,14
PFP III 2021-7 Ltd., "C", FLR, 6,104 %, 14/04/2038		421 979	392 687	0,05
PFP III 2021-8 Ltd., "B", FLR, 5,954 %, 9/08/2037		1 217 500	1 144 506	0,13
Progress Residential 2021-SFR1 Trust, "B", 1,303 %, 17/04/2038		542 000	475 736	0,06
Progress Residential 2021-SFR1 Trust, "C", 1,555 %, 17/04/2038		406 000	355 009	0,04
Shackleton 2013-4RA CLO Ltd., "B", FLR, 6,715 %, 13/04/2031		1 081 641	1 007 284	0,12
Shackleton 2015-8A CLO Ltd., "CR", FLR, 6,458 %, 20/10/2027		5 097 121	4 980 876	0,58
Shelter Growth CRE 2021-FL3 Ltd., "C", FLR, 6,604 %, 15/09/2036		1 280 500	1 207 132	0,14
Southwick Park CLO, Ltd., 2019-4A, "B1R", FLR, 6,307 %, 20/07/2032		1 726 000	1 679 733	0,20
Southwick Park CLO, Ltd., 2019-4A, "B2R", 2,46 %, 20/07/2032		3 000 000	2 560 569	0,30
Southwick Park CLO, Ltd., 2019-4A, "CR", FLR, 6,757 %, 20/07/2032		3 467 000	3 314 379	0,39
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "B", FLR, 6,27 %, 18/04/2038		3 598 000	3 407 397	0,40
Thornburg Mortgage Securities Trust, FLR, 5,185 %, 25/04/2043		4 419	4 394	0,00
TICP CLO 2018-3R Ltd., "B", FLR, 6,157 %, 20/04/2028		1 015 313	1 008 193	0,12
TICP CLO 2018-3R Ltd., "C", FLR, 6,607 %, 20/04/2028		1 781 766	1 756 137	0,20
TPG Real Estate Finance, 2021-FL4, "AS", FLR, 5,864 %, 15/03/2038		2 633 000	2 502 032	0,29
TPG Real Estate Finance, 2021-FL4, "B", FLR, 6,314 %, 15/03/2038		5 510 000	5 233 806	0,61
UBS Commercial Mortgage Trust, 2017-C1, "XA", 1,014 %, 15/11/2050 (i)		11 640 575	411 786	0,05
UBS Commercial Mortgage Trust, 2018-C14, "XA", 0,91 %, 15/12/2051 (i)		9 325 320	371 096	0,04
Westlake Automobile Receivable Trust, 2023-1A, "A2B", FLR, 5,25 %, 15/06/2026		874 000	873 996	0,10
			136 331 724	15,87
Industrie automobile				
Daimler Trucks Finance North America LLC, 5,2 %, 17/01/2025		2 312 000	2 323 943	0,27
General Motors Financial Co., 1,7 %, 18/08/2023		3 689 000	3 618 637	0,42
Hyundai Capital America, 2,375 %, 10/02/2023		1 021 000	1 020 207	0,12
Hyundai Capital America, 5,75 %, 6/04/2023		6 736 000	6 739 301	0,78
Hyundai Capital America, 0,8 %, 8/01/2024		409 000	392 451	0,05
Hyundai Capital America, 5,875 %, 7/04/2025		3 112 000	3 143 746	0,37
Mercedes-Benz Finance North America LLC, 0,75 %, 1/03/2024		2 289 000	2 187 457	0,26
Stellantis Finance US, Inc., 1,711 %, 29/01/2027		2 750 000	2 424 732	0,28
Volkswagen Group of America Finance LLC, 3,125 %, 12/05/2023		491 000	488 543	0,06
Volkswagen Group of America Finance LLC, 2,85 %, 26/09/2024		1 909 000	1 840 739	0,21

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Industrie automobile, suite				
Volkswagen Group of America Finance LLC, 3,35 %, 13/05/2025	USD	3 159 000	3 042 369	0,35
Volkswagen Group of America Finance LLC, 1,25 %, 24/11/2025		2 454 000	2 218 281	0,26
			29 440 406	3,43
Radio-télévision				
Warnermedia Holdings, Inc., 3,788 %, 15/03/2025		5 181 000	5 005 109	0,58
Warnermedia Holdings, Inc., 3,755 %, 15/03/2027		930 000	871 612	0,10
			5 876 721	0,68
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Brookfield Finance, Inc., 3,9 %, 25/01/2028		4 565 000	4 360 864	0,51
National Securities Clearing Corp., 1,5 %, 23/04/2025		1 464 000	1 366 509	0,16
			5 727 373	0,67
Services aux entreprises				
Equinix, Inc., 1,25 %, 15/07/2025		2 537 000	2 322 635	0,27
Global Payments, Inc., 1,2 %, 1/03/2026		3 191 000	2 837 299	0,33
Tencent Holdings Ltd., 1,81 %, 26/01/2026		3 188 000	2 927 845	0,34
			8 087 779	0,94
Télévision par câble				
SES S.A., 3,6 %, 4/04/2023		4 781 000	4 751 343	0,55
Logiciels				
Dell International LLC/EMC Corp., 4 %, 15/07/2024		2 975 000	2 934 180	0,34
Dell International LLC/EMC Corp., 5,85 %, 15/07/2025		690 000	703 076	0,08
Infor, Inc., 1,45 %, 15/07/2023		1 156 000	1 131 368	0,13
			4 768 624	0,55
Logiciels - Systèmes				
VMware, Inc., 1 %, 15/08/2024		2 105 000	1 979 181	0,23
Conglomérats				
Carrier Global Corp., 2,242 %, 15/02/2025		470 000	446 186	0,05
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/02/2026		2 580 000	2 621 859	0,31
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		1 567 000	1 590 843	0,18
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,4 %, 15/03/2024		4 939 000	4 876 295	0,57
			9 535 183	1,11
Biens de consommation				
GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC, 3,125 %, 24/03/2025		1 345 000	1 293 722	0,15
GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC, 3,375 %, 24/03/2027		785 000	743 063	0,09
			2 036 785	0,24
Conteneurs				
Berry Global, Inc., 1,57 %, 15/01/2026		1 450 000	1 310 762	0,15
Berry Global, Inc., 1,65 %, 15/01/2027		3 944 000	3 450 251	0,40
			4 761 013	0,55
Électronique				
Microchip Technology, Inc., 0,983 %, 1/09/2024		5 508 000	5 158 240	0,60
Qorvo, Inc., 1,75 %, 15/12/2024		1 182 000	1 105 974	0,13
SK Hynix, Inc., 6,25 %, 17/01/2026		3 376 000	3 411 684	0,40
Skyworks Solutions, Inc., 0,9 %, 1/06/2023		1 510 000	1 486 680	0,17
			11 162 578	1,30
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
DAE Funding LLC (Émirats arabes unis), 1,55 %, 1/08/2024		1 569 000	1 481 697	0,17
DAE Funding LLC (Émirats arabes unis), 2,625 %, 20/03/2025		781 000	736 741	0,09
Indian Oil Corp. Ltd., 5,75 %, 1/08/2023		1 236 000	1 238 867	0,14
			3 457 305	0,40
Obligations souveraines des marchés émergents				
Emirate of Abu Dhabi, 0,75 %, 2/09/2023		3 952 000	3 853 200	0,45
Énergie - Sociétés indépendantes				
EQT Corp., 5,678 %, 1/10/2025		859 000	860 121	0,10
EQT Corp., 5,7 %, 1/04/2028		859 000	869 145	0,10

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Énergie - Sociétés indépendantes, suite				
Pioneer Natural Resources Co., 0,55 %, 15/05/2023	USD	520 000	513 609	0,06
			2 242 875	0,26
Énergie - Sociétés intégrées				
Eni S.p.A., 4 %, 12/09/2023		5 824 000	5 782 652	0,67
Établissements financiers				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 4,875 %, 16/01/2024		3 035 000	3 017 775	0,35
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,15 %, 15/02/2024		5 697 000	5 553 345	0,65
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 1,75 %, 29/10/2024		1 972 000	1 839 067	0,21
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 6,5 %, 15/07/2025		2 590 000	2 637 398	0,31
Air Lease Corp., 2,2 %, 15/01/2027		2 632 000	2 359 894	0,27
Avolon Holdings Funding Ltd., 3,95 %, 1/07/2024		2 980 000	2 887 660	0,33
Avolon Holdings Funding Ltd., 5,5 %, 15/01/2026		1 547 000	1 520 659	0,18
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,125 %, 21/02/2026		4 132 000	3 696 305	0,43
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,25 %, 15/04/2026		1 355 000	1 286 761	0,15
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,528 %, 18/11/2027		2 172 000	1 874 442	0,22
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,75 %, 21/02/2028		1 661 000	1 431 009	0,17
			28 104 315	3,27
Alimentation et boissons				
General Mills, Inc., 5,241 %, 18/11/2025		1 990 000	2 000 424	0,23
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3 %, 2/02/2029		3 951 000	3 391 341	0,39
JDE Peet's N.V., 0,8 %, 24/09/2024		4 231 000	3 908 354	0,46
JDE Peet's N.V., 1,375 %, 15/01/2027		1 335 000	1 158 237	0,14
			10 458 356	1,22
Magasins d'alimentation et pharmacies				
7-Eleven, Inc., 0,625 %, 10/02/2023		4 716 000	4 711 048	0,55
7-Eleven, Inc., 0,8 %, 10/02/2024		3 537 000	3 381 717	0,39
			8 092 765	0,94
Produits forestiers et papier				
Fibria Overseas Finance Ltd., 5,5 %, 17/01/2027		1 957 000	1 966 605	0,23
Jeux et hôtellerie				
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc., 5,375 %, 1/11/2023		2 800 000	2 801 400	0,33
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc., 5,25 %, 1/06/2025		2 621 000	2 601 552	0,30
Hyatt Hotels Corp., 1,3 %, 1/10/2023		3 056 000	2 974 408	0,35
Hyatt Hotels Corp., 1,8 %, 1/10/2024		2 830 000	2 685 139	0,31
Las Vegas Sands Corp., 3,2 %, 8/08/2024		2 715 000	2 612 866	0,30
Marriott International, Inc., 5,75 %, 1/05/2025		52 000	52 883	0,01
Marriott International, Inc., 3,75 %, 1/10/2025		746 000	724 519	0,08
Sands China Ltd., 4,3 %, 8/01/2026		3 120 000	2 959 469	0,35
			17 412 236	2,03
Industrie				
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,416 %, 1/10/2024		222 000	210 758	0,02
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,516 %, 1/10/2025		274 000	258 400	0,03
			469 158	0,05
Assurances				
Equitable Financial Life Insurance Co., 1,4 %, 7/07/2025		3 412 000	3 131 237	0,37
Metropolitan Life Global Funding I, 0,4 %, 7/01/2024		3 607 000	3 458 331	0,40
			6 589 568	0,77
Assurances IARD				
Ambac Assurance Corp., 5,1 %, 7/06/2060		9 098	13 238	0,00
Internet				
Baidu, Inc., 3,875 %, 29/09/2023		1 093 000	1 082 332	0,13
Machines et outils				
CNH Industrial Capital LLC, 4,2 %, 15/01/2024		3 096 000	3 068 476	0,36
CNH Industrial Capital LLC, 1,875 %, 15/01/2026		1 241 000	1 148 837	0,13

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Machines et outils, suite				
CNH Industrial N.V., 4,5 %, 15/08/2023	USD	1 884 000	1 876 779	0,22
			6 094 092	0,71
Grandes banques				
Bank of America Corp., 4,2 %, 26/08/2024		1 512 000	1 495 410	0,17
Bank of America Corp., 4,45 %, 3/03/2026		2 391 000	2 369 405	0,28
Bank of America Corp., 4,25 %, 22/10/2026		1 392 000	1 364 801	0,16
Bank of America Corp., 1,734 % jusqu'au 22/07/2026, FLR jusqu'au 22/07/2027		2 109 000	1 889 691	0,22
Bank of America Corp., 4,183 %, 25/11/2027		2 320 000	2 278 128	0,27
Barclays PLC, 1,007 % jusqu'au 10/12/2023, FLR jusqu'au 10/12/2024		1 175 000	1 130 615	0,13
Barclays PLC, 2,852 % jusqu'au 7/05/2025, FLR jusqu'au 7/05/2026		1 127 000	1 066 011	0,12
Barclays PLC, 2,279 % jusqu'au 24/11/2026, FLR jusqu'au 24/11/2027		3 564 000	3 194 810	0,37
BNP Paribas S.A., 2,591 % jusqu'au 20/01/2027, FLR jusqu'au 20/01/2028		4 202 000	3 810 778	0,44
Capital One Financial Corp., 2,636 % jusqu'au 3/03/2025, FLR jusqu'au 3/03/2026		3 610 000	3 418 606	0,40
Credit Agricole S.A., 1,907 % jusqu'au 16/06/2025, FLR jusqu'au 16/06/2026		1 920 000	1 773 098	0,21
Deutsche Bank AG, 0,898 %, 28/05/2024		1 072 000	1 013 145	0,12
Deutsche Bank AG, 1,447 % jusqu'au 1/04/2024, FLR jusqu'au 1/04/2025		5 198 000	4 909 574	0,57
Deutsche Bank AG, 2,311 % jusqu'au 16/11/2026, FLR jusqu'au 16/11/2027		1 134 000	1 002 253	0,12
Deutsche Bank AG, 6,72 % jusqu'au 18/01/2028, FLR jusqu'au 18/01/2029		192 000	202 029	0,02
Goldman Sachs Group, Inc., 1,757 % jusqu'au 24/01/2024, FLR jusqu'au 24/01/2025		3 369 000	3 243 505	0,38
Goldman Sachs Group, Inc., 3,5 %, 1/04/2025		2 450 000	2 378 272	0,28
Goldman Sachs Group, Inc., 1,093 % jusqu'au 9/12/2025, FLR jusqu'au 9/12/2026		2 230 000	1 993 388	0,23
Goldman Sachs Group, Inc., 5,95 %, 15/01/2027		3 480 000	3 618 998	0,42
HSBC Holdings PLC, 2,099 % jusqu'au 4/06/2025, FLR jusqu'au 4/06/2026		1 957 000	1 813 779	0,21
HSBC Holdings PLC, 1,589 % jusqu'au 24/05/2026, FLR jusqu'au 24/05/2027		1 669 000	1 478 691	0,17
HSBC Holdings PLC, 2,251 % jusqu'au 22/11/2026, FLR jusqu'au 22/11/2027		2 471 000	2 217 943	0,26
JPMorgan Chase & Co., 5,546 % jusqu'au 15/12/2024, FLR jusqu'au 15/12/2025		4 000 000	4 032 273	0,47
JPMorgan Chase & Co., 2,005 % jusqu'au 13/03/2025, FLR jusqu'au 13/03/2026		3 507 000	3 299 098	0,38
JPMorgan Chase & Co., 1,04 % jusqu'au 4/02/2026, FLR jusqu'au 4/02/2027		2 806 000	2 498 679	0,29
JPMorgan Chase & Co., 1,578 % jusqu'au 22/04/2026, FLR jusqu'au 22/04/2027		2 203 000	1 979 927	0,23
JPMorgan Chase & Co., 4,25 %, 1/10/2027		2 319 000	2 296 163	0,27
Lloyds Banking Group PLC, 3,511 % jusqu'au 18/03/2025, FLR jusqu'au 18/03/2026		900 000	866 002	0,10
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0,848 % jusqu'au 15/09/2023, FLR jusqu'au 15/09/2024		6 375 000	6 184 768	0,72
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0,953 % jusqu'au 19/07/2025, FLR jusqu'au 19/07/2025		1 632 000	1 529 608	0,18
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0,962 % jusqu'au 11/10/2024, FLR jusqu'au 11/10/2025		1 078 000	1 000 407	0,12
Mizuho Financial Group, 0,849 % jusqu'au 8/09/2023, FLR jusqu'au 8/09/2024		3 900 000	3 787 970	0,44
Morgan Stanley, 5,04 % jusqu'au 10/11/2022, FLR jusqu'au 10/11/2023		4 361 000	4 358 863	0,51
Morgan Stanley, 5 % jusqu'au 25/01/2023, FLR jusqu'au 25/01/2024		5 628 000	5 622 479	0,66
Morgan Stanley, 4,35 %, 8/09/2026		3 184 000	3 121 336	0,36
Morgan Stanley, 3,625 %, 20/01/2027		803 000	778 338	0,09
Morgan Stanley, 3,95 %, 23/04/2027		286 000	276 462	0,03
Morgan Stanley, 1,512 % jusqu'au 20/07/2036, FLR jusqu'au 20/07/2027		976 000	870 815	0,10
Nationwide Building Society, 2,972 % jusqu'au 16/02/2027, FLR jusqu'au 16/02/2028		2 250 000	2 046 167	0,24
NatWest Group PLC, 2,359 % jusqu'au 22/05/2023, FLR jusqu'au 22/05/2024		4 414 000	4 366 389	0,51
NatWest Group PLC, 4,269 % jusqu'au 22/03/2024, FLR jusqu'au 22/03/2025		6 040 000	5 962 074	0,69
PNC Financial Services Group, Inc., 5,354 % jusqu'au 2/12/2027, FLR jusqu'au 2/12/2028		4 162 000	4 284 521	0,50
Royal Bank of Canada, 0,5 %, 26/10/2023		8 200 000	7 938 956	0,92
Standard Chartered PLC, 0,991 % jusqu'au 14/01/2024, FLR jusqu'au 12/01/2025		2 397 000	2 293 349	0,27
Standard Chartered PLC, 1,214 % jusqu'au 23/03/2024, FLR jusqu'au 23/03/2025		1 137 000	1 080 485	0,13
Standard Chartered PLC, 1,822 % jusqu'au 23/11/2024, FLR jusqu'au 23/11/2025		1 196 000	1 111 518	0,13
Standard Chartered PLC, 6,17 %, 9/01/2027		841 000	861 600	0,10
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0,508 %, 12/01/2024		1 203 000	1 152 253	0,13
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 1,474 %, 8/07/2025		3 938 000	3 617 612	0,42
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 2,174 %, 14/01/2027		2 831 000	2 551 605	0,30
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0,8 %, 12/09/2023		2 900 000	2 825 265	0,33

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Grandes banques, suite				
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0,85 %, 25/03/2024	USD	2 057 000	1 958 999	0,23
UBS Group AG, 1,008 % jusqu'au 30/07/2023, FLR jusqu'au 30/07/2024		1 610 000	1 576 298	0,18
UBS Group AG, 5,711 %, 12/01/2027		2 404 000	2 434 889	0,28
UBS Group AG, 4,703 % jusqu'au 5/08/2026, FLR jusqu'au 5/08/2027		900 000	888 322	0,10
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026		956 000	867 291	0,10
Wells Fargo & Co., 1,654 % jusqu'au 2/06/2023, FLR jusqu'au 2/06/2024		6 225 000	6 151 796	0,72
Wells Fargo & Co., 2,164 % jusqu'au 11/02/2025, FLR jusqu'au 11/02/2026		4 618 000	4 357 553	0,51
Wells Fargo & Co., 3,526 % jusqu'au 24/03/2027, FLR jusqu'au 24/03/2028		1 702 000	1 618 607	0,19
			150 111 667	17,48
Technologies et services médicaux et de santé				
HCA, Inc., 5 %, 15/03/2024		3 466 000	3 457 856	0,40
HCA, Inc., 3,125 %, 15/03/2027		960 000	892 468	0,11
Thermo Fisher Scientific, Inc., 1,215 %, 18/10/2024		5 194 000	4 905 455	0,57
			9 255 779	1,08
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 4,75 %, 10/04/2027		1 742 000	1 734 002	0,20
Glencore Funding LLC, 4,125 %, 12/03/2024		1 956 000	1 932 962	0,23
Glencore Funding LLC, 1,625 %, 1/09/2025		3 000 000	2 750 277	0,32
Glencore Funding LLC, 1,625 %, 27/04/2026		2 475 000	2 228 271	0,26
			8 645 512	1,01
Secteur intermédiaire				
DCP Midstream Operating, LP, 5,625 %, 15/07/2027		1 033 000	1 048 409	0,12
Enbridge, Inc., 2,5 %, 14/02/2025		772 000	734 574	0,08
Energy Transfer LP, 2,9 %, 15/05/2025		1 228 000	1 171 541	0,14
Energy Transfer LP, 5,55 %, 15/02/2028		1 057 000	1 074 155	0,12
Gray Oak Pipeline LLC, 2 %, 15/09/2023		2 484 000	2 426 995	0,28
Plains All American Pipeline LP, 3,85 %, 15/10/2023		4 750 000	4 702 303	0,55
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp., 4,65 %, 15/10/2025		1 528 000	1 512 018	0,18
Western Midstream Operating LP, 3,35 %, 1/02/2025		1 579 000	1 507 945	0,18
			14 177 940	1,65
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 4,5 %, 1/03/2023–1/06/2024		11 325	11 444	0,00
Fannie Mae, 5 %, 1/07/2023		2 250	2 287	0,00
Fannie Mae, 3 %, 1/12/2031		721 480	702 609	0,08
Fannie Mae, 2 %, 25/05/2044		265 348	255 700	0,03
Freddie Mac, 0,903 %, 25/04/2024 (i)		104 561	906	0,00
Freddie Mac, 3 %, 15/04/2033–15/06/2045		3 775 854	3 569 105	0,42
Freddie Mac, 2 %, 15/07/2042		565 278	523 046	0,06
			5 065 097	0,59
Obligations municipales				
California Earthquake Authority Rev., Taxable, "B", 1,477 %, 1/07/2023		1 175 000	1 157 452	0,14
California Municipal Finance Authority Rev., Taxable (Century Housing Corp.), 1,605 %, 1/11/2023		620 000	602 708	0,07
Illinois Sales Tax Securitization Corp., Second Lien, Taxable, "B", BAM, 2,225 %, 1/01/2024		1 350 000	1 318 458	0,15
Long Island, NY, Power Authority, Electric System General Rev., Taxable, "C", 0,764 %, 1/03/2023		1 785 000	1 778 757	0,21
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 1,904 %, 1/07/2023		175 000	172 813	0,02
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 2,156 %, 1/07/2024		490 000	470 980	0,06
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 2,306 %, 1/07/2025		385 000	362 058	0,04
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 2,562 %, 1/07/2026		495 000	461 652	0,05
Michigan Finance Authority Tobacco Settlement Asset-Backed Rev., Taxable (2006 Recettes vendues de tabac), "A-1", 2,326 %, 1/06/2030		1 020 461	976 908	0,11
New Jersey Economic Development Authority State Pension Funding Rev., Appréciation du capital, Taxable, "B", AGM, 0 %, 15/02/2023		5 063 000	5 054 049	0,59
New Jersey Transportation Trust Fund Authority, Transportation System, Taxable, "B", 2,551 %, 15/06/2023		845 000	836 896	0,10
New Jersey Transportation Trust Fund Authority, Transportation System, Taxable, "B", 2,631 %, 15/06/2024		790 000	763 191	0,09

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations municipales, suite				
Port Authority of NY & NJ, Taxable, "AAA", 1,086 %, 1/07/2023	USD	2 380 000	2 343 916	0,27
			16 299 838	1,90
Gaz naturel - Distribution				
Atmos Energy Corp., 0,625 %, 9/03/2023		2 582 000	2 571 328	0,30
CenterPoint Energy Resources Corp., 0,7 %, 2/03/2023		3 438 000	3 427 283	0,40
			5 998 611	0,70
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 4,2 %, 23/03/2025		3 952 000	3 858 098	0,45
Réseaux et télécommunications				
AT&T, Inc., 0,9 %, 25/03/2024		6 841 000	6 544 386	0,76
Pétrole				
Valero Energy Corp., 1,2 %, 15/03/2024		4 200 000	4 026 244	0,47
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
American Express Co., 2,25 %, 4/03/2025		1 805 000	1 717 262	0,20
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 0,65 %, 27/02/2024		4 908 000	4 687 385	0,55
Groupe BPCE S.A., 4 %, 12/09/2023		1 755 000	1 737 801	0,20
Groupe BPCE S.A., FLR, 5,975 %, 12/09/2023		1 755 000	1 757 625	0,20
Macquarie Group Ltd., 1,201 % jusqu'au 14/10/2024, FLR jusqu'au 14/10/2025		1 616 000	1 496 855	0,17
Macquarie Group Ltd., 1,34 % jusqu'au 12/01/2026, FLR jusqu'au 12/01/2027		3 177 000	2 823 622	0,33
National Bank of Canada, 0,55 % jusqu'au 15/11/2023, FLR jusqu'au 15/11/2024		2 450 000	2 361 270	0,28
			16 581 820	1,93
Produits pharmaceutiques				
Royalty Pharma PLC, 0,75 %, 2/09/2023		3 713 000	3 619 174	0,42
Chemins de fer et transport maritime				
Canadian Pacific Railway Co., 1,35 %, 2/12/2024		3 840 000	3 608 575	0,42
Immobilier - Bureaux				
Corporate Office Property LP, REIT, 2,25 %, 15/03/2026		2 708 000	2 450 757	0,29
Distribution				
Alibaba Group Holding Ltd., 2,8 %, 6/06/2023		2 093 000	2 076 403	0,24
Kohl's Corp., 9,5 %, 15/05/2025		4 222 000	4 497 752	0,52
Nordstrom, Inc., 2,3 %, 8/04/2024		1 350 000	1 281 312	0,15
			7 855 467	0,91
Magasins spécialisés				
Genuine Parts Co., 1,75 %, 1/02/2025		1 883 000	1 770 284	0,21
Télécommunications mobiles				
Crown Castle, Inc., REIT, 3,15 %, 15/07/2023		3 138 000	3 114 150	0,36
Crown Castle, Inc., REIT, 1,35 %, 15/07/2025		842 000	773 547	0,09
Crown Castle, Inc., REIT, 2,9 %, 15/03/2027		480 000	446 330	0,05
Rogers Communications, Inc., 3,2 %, 15/03/2027		1 576 000	1 482 151	0,17
T-Mobile USA, Inc., 3,5 %, 15/04/2025		3 929 000	3 815 234	0,45
			9 631 412	1,12
Tabac				
B.A.T. Capital Corp., 3,222 %, 15/08/2024		2 267 000	2 205 138	0,26
Imperial Brands Finance PLC, 6,125 %, 27/07/2027		697 000	715 712	0,08
Philip Morris International, Inc., 1,125 %, 1/05/2023		1 636 000	1 620 360	0,19
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 15/11/2024		1 750 000	1 762 246	0,21
Philip Morris International, Inc., 5 %, 17/11/2025		795 000	805 610	0,09
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 17/11/2027		709 000	724 621	0,08
			7 833 687	0,91
Transports - Services				
Element Fleet Management Corp., 1,6 %, 6/04/2024		6 129 000	5 844 794	0,68
ERAC USA Finance LLC, 2,7 %, 1/11/2023		2 923 000	2 864 232	0,33
ERAC USA Finance LLC, 3,85 %, 15/11/2024		1 128 000	1 099 009	0,13
ERAC USA Finance LLC, 3,8 %, 1/11/2025		1 128 000	1 088 177	0,13
			10 896 212	1,27

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations du Trésor américain				
Bons du Trésor américain, 3 %, 31/07/2024	USD	25 626 000	25 075 441	2,92
Bons du Trésor américain, 2,75 %, 15/05/2025		60 750 000	59 005 811	6,87
Bons du Trésor américain, 2,25 %, 15/11/2025		55 039 000	52 650 393	6,13
Bons du Trésor américain, 0,375 %, 31/01/2026		38 772 000	34 982 643	4,07
			171 714 288	19,99
Services publics - Énergie électrique				
Edison International, 4,7 %, 15/08/2025		1 722 000	1 696 516	0,20
Emera US Finance LP, 0,833 %, 15/06/2024		1 500 000	1 410 016	0,16
Enel Finance International N.V., 6,8 %, 14/10/2025		1 500 000	1 554 345	0,18
ENGIE Energía Chile S.A., 4,5 %, 29/01/2025		4 893 000	4 770 675	0,55
Entergy Louisiana LLC, 0,95 %, 1/10/2024		8 551 000	8 037 926	0,94
FirstEnergy Corp., 2,05 %, 1/03/2025		2 796 000	2 620 209	0,30
FirstEnergy Corp., 1,6 %, 15/01/2026		1 210 000	1 086 107	0,13
Pacific Gas & Electric Co., 1,7 %, 15/11/2023		1 081 000	1 052 921	0,12
Pacific Gas & Electric Co., 3,25 %, 16/02/2024		2 677 000	2 627 591	0,31
Southern California Edison Co., 0,7 %, 1/08/2023		1 375 000	1 346 674	0,16
WEC Energy Group, Inc., 0,8 %, 15/03/2024		1 592 000	1 519 071	0,18
			27 722 051	3,23
Total des obligations (coût identifié, 853 499 790 $)			810 725 473	94,39
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 40 701 000 $)	USD	40 701 000	40 701 000	4,74
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 894 200 790 $)			851 426 473	99,13
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			7 498 153	0,87
ACTIF NET			858 924 626	100,00

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

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
General Dynamics Corp.	451	105 110	0,55
Honeywell International, Inc.	623	129 883	0,68
MTU Aero Engines Holding AG	173	43 078	0,22
Northrop Grumman Corp.	294	131 724	0,68
Raytheon Technologies Corp.	392	39 141	0,20
Rolls-Royce Holdings PLC	24 369	31 924	0,17
		480 860	2,50
Compagnies aériennes			
Ryanair Holdings PLC, ADR	749	67 807	0,35
Boissons alcoolisées			
Carlsberg A.S., "B"	382	54 017	0,28
Diageo PLC	4 118	178 706	0,93
Pernod Ricard S.A.	519	107 385	0,56
		340 108	1,77
Industrie de la confection			
Compagnie Financiere Richemont S.A.	871	134 296	0,70
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	286	249 845	1,29
		384 141	1,99

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Industrie automobile			
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	1 407	44 652	0,23
DENSO Corp.	1 300	70 237	0,37
Koito Manufacturing Co. Ltd.	1 700	28 714	0,15
		143 603	0,75
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
BlackRock, Inc.	97	73 643	0,38
Charles Schwab Corp.	897	69 446	0,36
Citigroup, Inc.	1 433	74 831	0,39
CME Group, Inc.	241	42 575	0,22
Deutsche Boerse AG	629	112 396	0,58
KKR & Co., Inc.	633	35 328	0,18
London Stock Exchange Group PLC	643	58 911	0,31
NASDAQ, Inc.	1 618	97 387	0,51
		564 517	2,93
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	446	124 456	0,65
Compass Group PLC	5 032	119 972	0,62
CoStar Group, Inc.	904	70 422	0,37
Equifax, Inc.	535	118 877	0,62
Experian PLC	2 805	102 552	0,53
MSCI, Inc.	244	129 701	0,67
Randstad Holding N.V.	715	45 789	0,24
Tata Consultancy Services Ltd.	1 186	48 884	0,25
TransUnion	371	26 619	0,14
Verisk Analytics, Inc., "A"	490	89 077	0,46
		876 349	4,55
Télévision par câble			
Charter Communications, Inc., "A"	174	66 870	0,35
Comcast Corp., "A"	3 591	141 306	0,73
		208 176	1,08
Produits chimiques			
PPG Industries, Inc.	541	70 514	0,37
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	356	131 841	0,68
Autodesk, Inc.	74	15 922	0,08
Black Knight, Inc.	234	14 178	0,07
Cadence Design Systems, Inc.	272	49 730	0,26
Check Point Software Technologies Ltd.	639	81 281	0,42
Dassault Systemes SE	867	32 224	0,17
Intuit, Inc.	324	136 945	0,71
Microsoft Corp.	2 687	665 865	3,46
NetEase, Inc.	2 600	45 998	0,24
SAP SE	1 046	123 111	0,64
Synopsys, Inc.	71	25 116	0,13
		1 322 211	6,86
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	994	62 529	0,33
Apple, Inc.	2 128	307 049	1,59
Block, Inc., "A"	243	19 858	0,10
Cap Gemini S.A.	662	125 541	0,65
Hitachi Ltd.	2 400	126 021	0,65
Samsung Electronics Co. Ltd.	639	31 940	0,17
ServiceNow, Inc.	139	63 263	0,33
Sony Group Corp.	1 100	98 197	0,51
		834 398	4,33

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Construction			
Compagnie de Saint-Gobain S.A.	1 167	66 830	0,35
Martin Marietta Materials, Inc.	58	20 859	0,11
Masco Corp.	631	33 569	0,17
Otis Worldwide Corp.	237	19 489	0,10
Sherwin-Williams Co.	573	135 566	0,70
Vulcan Materials Co.	563	103 215	0,54
		379 528	1,97
Biens de consommation			
Beiersdorf AG	936	113 561	0,59
Colgate-Palmolive Co.	618	46 060	0,24
Estee Lauder Cos., Inc., "A"	322	89 220	0,46
International Flavors & Fragrances, Inc.	217	24 404	0,13
Kimberly-Clark Corp.	363	47 194	0,24
KOSE Corp.	400	44 028	0,23
L'Oréal S.A.	127	52 461	0,27
Reckitt Benckiser Group PLC	1 164	82 890	0,43
		499 818	2,59
Équipements électriques			
AMETEK, Inc.	517	74 923	0,39
Amphenol Corp., "A"	331	26 404	0,14
Johnson Controls International PLC	2 312	160 846	0,84
Legrand S.A.	628	56 132	0,29
Rockwell Automation, Inc.	90	25 383	0,13
Schneider Electric SE	1 107	179 508	0,93
		523 196	2,72
Électronique			
Analog Devices, Inc.	254	43 554	0,23
Applied Materials, Inc.	175	19 511	0,10
ASML Holding N.V., ADR	123	81 283	0,42
Hoya Corp.	500	55 058	0,29
KLA Corp.	206	80 851	0,42
Kyocera Corp.	1 400	72 791	0,38
Lam Research Corp.	102	51 010	0,26
NVIDIA Corp.	763	149 067	0,77
NXP Semiconductors N.V.	367	67 642	0,35
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	832	77 151	0,40
Texas Instruments, Inc.	810	143 540	0,75
		841 458	4,37
Énergie - Sociétés indépendantes			
ConocoPhillips	1 045	127 354	0,66
EOG Resources, Inc.	694	91 782	0,48
Hess Corp.	328	49 253	0,25
Pioneer Natural Resources Co.	407	93 752	0,49
		362 141	1,88
Énergie - Sociétés intégrées			
Eni S.p.A.	4 797	73 984	0,39
Galp Energia SGPS S.A., "B"	3 500	47 848	0,25
Suncor Energy, Inc.	1 239	43 002	0,22
		164 834	0,86
Énergie - Renouvelables			
Enphase Energy, Inc.	44	9 741	0,05
Alimentation et boissons			
Archer Daniels Midland Co.	229	18 973	0,10
Nestlé S.A.	2 579	314 719	1,63

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Alimentation et boissons, suite			
PepsiCo, Inc.	302	51 648	0,27
		385 340	2,00
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Tesco PLC	17 731	53 861	0,28
Jeux et hôtellerie			
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	484	70 223	0,36
Marriott International, Inc., "A"	394	68 627	0,36
		138 850	0,72
Marchandises générales			
Dollar Tree, Inc.	198	29 736	0,15
Organisations de soins de santé intégrés			
Cigna Corp.	541	171 318	0,89
UnitedHealth Group, Inc.	242	120 804	0,63
		292 122	1,52
Assurances			
AIA Group Ltd.	12 400	140 033	0,73
Aon PLC	772	246 021	1,28
Arthur J. Gallagher & Co.	148	28 967	0,15
Chubb Ltd.	583	132 627	0,69
Intact Financial Corp.	312	45 263	0,23
Marsh & McLennan Cos., Inc.	809	141 502	0,73
Progressive Corp.	1 026	139 895	0,73
Prudential PLC	3 198	52 995	0,28
Travelers Cos., Inc.	507	96 898	0,50
Zurich Insurance Group AG	199	98 420	0,51
		1 122 621	5,83
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	3 152	311 544	1,62
Alphabet, Inc., "C"	907	90 582	0,47
Gartner, Inc.	133	44 972	0,23
Match Group, Inc.	435	23 542	0,12
Tencent Holdings Ltd.	1 300	63 366	0,33
		534 006	2,77
Loisirs et jouets			
Electronic Arts, Inc.	441	56 748	0,30
Take-Two Interactive Software, Inc.	193	21 853	0,11
		78 601	0,41
Machines et outils			
Caterpillar, Inc.	47	11 858	0,06
Daikin Industries Ltd.	500	87 058	0,45
Eaton Corp. PLC	674	109 329	0,57
Illinois Tool Works, Inc.	400	94 416	0,49
Kubota Corp.	2 100	31 515	0,16
PACCAR, Inc.	284	31 044	0,16
SMC Corp.	100	50 837	0,27
Trane Technologies PLC	293	52 482	0,27
		468 539	2,43
Grandes banques			
DBS Group Holdings Ltd.	3 200	87 601	0,46
Goldman Sachs Group, Inc.	92	33 655	0,18
ING Groep N.V.	6 316	91 161	0,47
JPMorgan Chase & Co.	1 602	224 216	1,16
Morgan Stanley	1 212	117 964	0,61
PNC Financial Services Group, Inc.	378	62 533	0,32
Toronto-Dominion Bank	1 053	72 856	0,38

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Grandes banques, suite			
UBS Group AG	5 984	127 413	0,66
		817 399	4,24
Technologies et services médicaux et de santé			
ICON PLC	231	53 294	0,28
McKesson Corp.	239	90 504	0,47
Veeva Systems, Inc.	52	8 869	0,04
		152 667	0,79
Équipements médicaux			
Abbott Laboratories	1 669	184 508	0,96
Agilent Technologies, Inc.	149	22 660	0,12
Becton, Dickinson and Co.	184	46 409	0,24
Boston Scientific Corp.	3 859	178 479	0,93
Danaher Corp.	605	159 950	0,83
EssilorLuxottica	554	101 373	0,53
Medtronic PLC	766	64 107	0,33
Olympus Corp.	3 800	71 391	0,37
QIAGEN N.V.	1 198	58 152	0,30
Sonova Holding AG	148	37 001	0,19
STERIS PLC	138	28 498	0,15
Terumo Corp.	2 000	58 074	0,30
Thermo Fisher Scientific, Inc.	424	241 820	1,25
		1 252 422	6,50
Métaux et exploitation minière			
Rio Tinto PLC	871	68 092	0,35
Gaz naturel - Distribution			
ENGIE S.A.	5 546	78 898	0,41
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
American Express Co.	706	123 501	0,64
HDFC Bank Ltd., ADR	447	30 110	0,15
Housing Development Finance Corp. Ltd.	1 658	53 231	0,28
Intesa Sanpaolo S.p.A.	30 859	81 040	0,42
Julius Baer Group Ltd.	802	51 390	0,27
KBC Group N.V.	625	46 216	0,24
Mastercard, Inc., "A"	634	234 960	1,22
Moody's Corp.	124	40 021	0,21
Truist Financial Corp.	704	34 771	0,18
Visa, Inc., "A"	882	203 045	1,05
		898 285	4,66
Produits pharmaceutiques			
Bayer AG	1 641	101 787	0,53
Johnson & Johnson	1 023	167 179	0,87
Merck & Co., Inc.	1 041	111 814	0,58
Merck KGaA	606	125 997	0,65
Novartis AG	1 047	94 691	0,49
Novo Nordisk A.S., "B"	1 030	142 638	0,74
Pfizer, Inc.	2 757	121 749	0,63
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	72	54 610	0,28
Roche Holding AG	620	193 771	1,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	310	100 161	0,52
Zoetis, Inc.	348	57 590	0,30
		1 271 987	6,60
Imprimerie et édition			
RELX PLC	3 360	99 864	0,52
Chemins de fer et transport maritime			
Canadian National Railway Co.	1 028	122 424	0,63

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Chemins de fer et transport maritime, suite				
Canadian Pacific Railway Ltd.		683	53 889	0,28
Union Pacific Corp.		489	99 849	0,52
			276 162	1,43
Immobilier				
Prologis, Inc., REIT		521	67 355	0,35
Public Storage, Inc., REIT		74	22 521	0,12
			89 876	0,47
Restaurants				
Chipotle Mexican Grill, Inc., "A"		19	31 281	0,16
Yum China Holdings, Inc.		825	50 828	0,27
			82 109	0,43
Produits chimiques spéciaux				
Air Products & Chemicals, Inc.		269	86 217	0,45
Akzo Nobel N.V.		147	10 934	0,06
DuPont de Nemours, Inc.		1 164	86 078	0,45
L'Air Liquide S.A.		1 102	175 619	0,91
Linde PLC		97	32 101	0,17
Linde PLC		252	82 847	0,43
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.		200	29 789	0,15
Sika AG		183	52 100	0,27
			555 685	2,89
Magasins spécialisés				
Amazon.com, Inc.		3 266	336 823	1,75
Lowe's Cos., Inc.		533	110 997	0,58
Lululemon Athletica, Inc.		88	27 005	0,14
Meituan, "B"		130	2 895	0,01
O'Reilly Automotive, Inc.		57	45 164	0,23
Target Corp.		476	81 939	0,43
			604 823	3,14
Télécommunications mobiles				
American Tower Corp., REIT		322	71 932	0,37
Services publics - Énergie électrique				
American Electric Power Co., Inc.		363	34 108	0,18
Dominion Energy, Inc.		1 285	81 777	0,42
Duke Energy Corp.		1 149	117 715	0,61
Exelon Corp.		491	20 715	0,11
Southern Co.		1 439	97 392	0,51
Xcel Energy, Inc.		517	35 554	0,18
			387 261	2,01
Total des actions ordinaires (coût identifié, 17 203 515 $)			17 884 538	92,84
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 596 000 $)	USD	596 000	596 000	3,10
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 17 799 515 $)			18 480 538	95,94

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES			
Russell 2000 Index – Mars 2023 @ 1 600 $	1	370	0,00
S&P 500 Index – Février 2023 @ 3 600 $	2	460	0,00
S&P 500 Index – Juin 2023 @ 3 000 $	2	2 806	0,02

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES, suite			
S&P 500 Index – Décembre 2023 @ 3 250 $	2	14 340	0,07
Total des options de vente achetées (primes versées, 52 823 $)	17 976	0,09	
Total des investissements (coût identifié, 17 852 338 $) (k)		18 498 514	96,03
OPTIONS DE VENTE VENDUES			
S&P 500 Index – Février 2023 @ 3 200 $ (primes reçues, $2 010 $)	(2)	(100)	(0,00)
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		765 280	3,97
ACTIF NET		19 263 694	100,00

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

MFS Meridian Funds - Prudent Capital Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Safran S.A.	319 381	45 862 767	1,20
Thales S.A.	340 273	44 956 581	1,17
		90 819 348	2,37
Boissons alcoolisées			
Heineken Holding N.V.	688 125	56 692 110	1,48
Industrie automobile			
Knorr-Bremse AG	931 293	60 909 322	1,59
Télévision par câble			
Charter Communications, Inc., "A"	125 241	48 131 369	1,26
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	142 110	52 629 017	1,37
Check Point Software Technologies Ltd.	564 863	71 850 574	1,88
Microsoft Corp.	224 262	55 574 366	1,45
Oracle Corp.	764 311	67 610 951	1,76
Oracle Corp. Japan	794 800	54 373 054	1,42
Sage Group PLC	6 968 342	66 845 093	1,75
		368 883 055	9,63
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	837 592	52 690 378	1,37
Samsung Electronics Co. Ltd.	1 417 057	70 830 034	1,85
		123 520 412	3,22
Construction			
Barratt Developments PLC	6 714 663	38 233 543	1,00
Biens de consommation			
Kao Corp.	920 400	37 529 343	0,98
KOSE Corp.	411 100	45 249 603	1,18
		82 778 946	2,16
Services de consommation			
Booking Holdings, Inc.	25 875	62 982 337	1,64
Équipements électriques			
Legrand S.A.	736 182	65 801 742	1,72
Électronique			
Kyocera Corp.	910 400	47 335 034	1,23
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	478 723	26 183 531	0,68

MFS Meridian Funds - Prudent Capital Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Alimentation et boissons, suite				
Nestlé S.A.		410 044	50 038 264	1,31
			76 221 795	1,99
Produits forestiers et papier				
Rayonier, Inc., REIT		1 283 221	46 696 412	1,22
Weyerhaeuser Co., REIT		1 231 053	42 385 155	1,10
			89 081 567	2,32
Assurances				
Swiss Re Ltd.		308 079	32 222 828	0,84
Internet				
Alphabet, Inc., "A"		1 451 787	143 494 627	3,74
Scout24 AG		1 033 879	59 998 153	1,57
			203 492 780	5,31
Loisirs et jouets				
Nintendo Co. Ltd.		1 176 800	50 854 684	1,33
Équipements médicaux				
Sonova Holding AG		152 767	38 192 503	1,00
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
S&P Global, Inc.		111 714	41 886 047	1,09
Imprimerie et édition				
Wolters Kluwer N.V.		503 166	54 838 435	1,43
Immobilier				
LEG Immobilien SE		1 839 720	143 408 546	3,74
Vonovia SE, REIT		2 698 609	75 897 241	1,98
			219 305 787	5,72
Produits chimiques spéciaux				
Nitto Denko Corp.		693 300	44 866 286	1,17
Télécommunications mobiles				
KDDI Corp.		2 167 800	67 731 473	1,77
Services téléphoniques				
Altice USA, Inc., "A"		1 630 329	7 988 612	0,21
Hellenic Telecommunications Organization S.A.		1 367 767	21 516 432	0,56
Wireless Infrastructure Italian S.p.A.		3 684 957	40 399 405	1,05
			69 904 449	1,82
Transport par camion				
Yamato Holdings Co. Ltd.		2 600 600	45 425 912	1,18
Services publics - Énergie électrique				
Iberdrola S.A.		5 627 596	65 808 709	1,72
Total des actions ordinaires (coût identifié, 2 290 675 032 $)			**2 145 920 473**	**55,99**
OBLIGATIONS				
Radio-télévision				
WMG Acquisition Corp., 3,875 %, 15/07/2030	USD	29 890 000	26 348 035	0,69
Construction				
Interface, Inc., 5,5 %, 1/12/2028		14 867 000	12 490 510	0,33
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 5,25 %, 15/07/2028		16 760 000	15 428 418	0,40
Standard Industries, Inc., 3,375 %, 15/01/2031		26 924 000	21 383 520	0,56
			49 302 448	1,29
Logiciels				
Clarivate Science Holdings Corp., 4,875 %, 1/07/2029		15 290 000	13 454 053	0,35
Logiciels - Systèmes				
Fair Isaac Corp., 4 %, 15/06/2028		24 202 000	22 471 678	0,59
Biens de consommation				
Coty, Inc., 6,5 %, 15/04/2026		18 335 000	18 074 643	0,47
Services de consommation				
Arches Buyer, Inc., 6,125 %, 1/12/2028		25 790 000	21 721 886	0,57
Match Group Holdings II LLC, 5 %, 15/12/2027		8 475 000	8 126 381	0,21

MFS Meridian Funds - Prudent Capital Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services de consommation, suite				
Match Group Holdings II LLC, 4,625 %, 1/06/2028	USD	26 500 000	24 373 905	0,64
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5,75 %, 15/01/2029		9 080 000	7 060 063	0,18
			61 282 235	1,60
Conteneurs				
Can-Pack S.A./Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,875 %, 15/11/2029		10 110 000	8 395 243	0,22
Électronique				
Sensata Technologies B.V., 5 %, 1/10/2025		10 730 000	10 611 917	0,28
Sensata Technologies, Inc., 3,75 %, 15/02/2031		10 138 000	8 605 614	0,22
			19 217 531	0,50
Établissements financiers				
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		16 566 405	15 118 233	0,39
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		10 129 343	9 243 874	0,24
			24 362 107	0,63
Assurances IARD				
Hub International Ltd., 7 %, 1/05/2026		27 015 000	26 745 660	0,70
Technologies et services médicaux et de santé				
Charles River Laboratories International, Inc., 4 %, 15/03/2031		22 365 000	19 731 294	0,51
Équipements médicaux				
Teleflex, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		23 725 000	22 650 554	0,59
Métaux et exploitation minière				
Coeur Mining, Inc., 5,125 %, 15/02/2029		4 531 000	3 648 378	0,09
Secteur intermédiaire				
Peru LNG, 5,375 %, 22/03/2030		18 400 000	15 258 016	0,40
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 4 %, 1/06/2052–1/08/2052		1 875 182	1 811 522	0,05
Freddie Mac, 4 %, 1/07/2052		99 159	96 005	0,00
Freddie Mac, 5 %, 1/10/2052		978 272	982 205	0,03
Freddie Mac, UMBS, 4 %, 1/06/2052–1/08/2052		398 532	384 906	0,01
Freddie Mac, UMBS, 5 %, 1/10/2052		844 299	847 512	0,02
			4 122 150	0,11
Produits chimiques spéciaux				
Univar Solutions USA, Inc., 5,125 %, 1/12/2027		3 037 000	2 936 562	0,08
Télécommunications mobiles				
SBA Communications Corp., 3,875 %, 15/02/2027		15 825 000	14 614 953	0,38
SBA Communications Corp., 3,125 %, 1/02/2029		20 210 000	17 121 558	0,45
			31 736 511	0,83
Transports - Services				
Q-Park Holding I B.V., 2 %, 1/03/2027	EUR	22 435 000	20 670 709	0,54
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, TIPS, 2,375 %, 15/01/2025	USD	37 126 956	37 294 704	0,97
Bons du Trésor américain, 0,5 %, 15/03/2023		88 061 000	87 643 023	2,29
Bons du Trésor américain, 1,375 %, 30/06/2023		135 570 000	133 732 390	3,49
Bons du Trésor américain, 1,375 %, 30/09/2023 (g)		137 335 000	134 293 244	3,50
Bons du Trésor américain, 2,625 %, 31/12/2023		135 380 000	132 794 031	3,47
Bons du Trésor américain, 2,25 %, 31/03/2024		131 600 000	127 975 860	3,34
Bons du Trésor américain, 3 %, 30/06/2024		58 733 000	57 489 512	1,50
Bons du Trésor américain, TIPS, 0,5 %, 15/04/2024		118 744 350	115 775 741	3,02
Bons du Trésor américain, TIPS, 0,125 %, 15/04/2027		85 002 068	80 272 168	2,09
			907 270 673	23,67
Services publics - Énergie électrique				
Clearway Energy Operating LLC, 4,75 %, 15/03/2028		14 250 000	13 440 600	0,35
Clearway Energy Operating LLC, 3,75 %, 15/02/2031		13 425 000	11 341 843	0,30
			24 782 443	0,65
Total des obligations (coût identifié, 1 383 397 030 $)			1 322 460 923	34,51

MFS Meridian Funds - Prudent Capital Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 78 034 000 $)	USD	78 034 000	78 034 000	2,04
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT				
Métaux et minéraux précieux				
iShares Physical Gold ETC		2 366 325	89 111 542	2,33
Produits et services spécialisés				
VanEck Junior Gold Miners UCITS ETF		673 466	23 054 949	0,60
Total des sociétés d'investissement (coût identifié, 114 991 716 $)			112 166 491	2,93
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 3 867 097 778 $)			3 658 581 887	95,47

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES			
Apple, Inc. – Septembre 2023 @ $145	9 865	11 936 650	0,31
Mettler-Toledo International, Inc. – Décembre 2023 @ $1 530	123	1 843 770	0,05
Russell 2000 Index – Mars 2023 @ 1 600 $	500	185 000	0,01
Russell 2000 Index – Mars 2023 @ 1 700 $	500	410 000	0,01
Russell 2000 Index – Juin 2023 @ 1 700 $	500	1 570 000	0,04
Russell 2000 Index – Décembre 2023 @ 1 650 $	500	3 165 000	0,08
Russell 2000 Index – Juin 2024 @ 1 400 $	500	2 350 000	0,06
Russell 2000 Index – Juin 2024 @ 1 500 $	400	2 420 000	0,06
S&P 500 Index – Mars 2023 @ 3 650 $	200	292 000	0,01
S&P 500 Index – Juin 2023 @ 3 750 $	250	1 822 500	0,05
S&P 500 Index – Juin 2023 @ 3 850 $	250	2 425 500	0,06
S&P 500 Index – Juin 2023 @ 3 600 $	250	1 270 750	0,03
S&P 500 Index – Décembre 2023 @ 3 300 $	250	1 938 000	0,05
S&P 500 Index – Décembre 2023 @ 3 200 $	250	1 593 750	0,04
S&P 500 Index – Juin 2024 @ 3 250 $	240	2 469 600	0,07
Total des options de vente achetées (primes versées, 67 673 644 $)		35 692 520	0,93
Total des Options d'Achat Achetées			
Tencent Holdings Ltd. – Septembre 2023 @ HKD 470,16 (primes versées, 12 085 746 $)	9 220	2 054 853	0,05
Total des investissements (coût identifié, 3 946 857 168 $) (k)		3 696 329 260	96,45
OPTIONS DE VENTE VENDUES			
Apple, Inc. – Septembre 2023 @ $100 (primes reçues, $3 323 913 $)	(9 865)	(1 538 940)	(0,04)
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		137 538 826	3,59
ACTIF NET		3 832 329 146	100,00

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

MFS Meridian Funds - Prudent Wealth Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Safran S.A.	188 271	27 035 512	0,76
Thales S.A.	261 014	34 484 950	0,96
		61 520 462	1,72
Boissons alcoolisées			
Heineken Holding N.V.	640 221	52 745 474	1,48
Industrie automobile			
Knorr-Bremse AG	671 415	43 912 531	1,23

MFS Meridian Funds - Prudent Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
IG Group Holdings PLC	2 559 709	25 178 639	0,70
Services aux entreprises			
Serco Group PLC	30 057 759	54 065 716	1,51
Télévision par câble			
Charter Communications, Inc., "A"	112 221	43 127 653	1,21
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	118 457	43 869 366	1,23
Check Point Software Technologies Ltd.	461 731	58 732 183	1,64
Microsoft Corp.	190 022	47 089 352	1,32
Oracle Corp.	596 143	52 734 810	1,48
Oracle Corp. Japan	750 400	51 335 606	1,44
Sage Group PLC	5 942 519	57 004 698	1,59
SimCorp A/S	434 867	30 359 696	0,85
		341 125 711	9,55
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	632 881	39 812 628	1,11
Samsung Electronics Co. Ltd.	1 157 886	57 875 657	1,62
		97 688 285	2,73
Construction			
Barratt Developments PLC	5 206 938	29 648 501	0,83
Biens de consommation			
Kao Corp.	855 000	34 862 655	0,98
KOSE Corp.	374 200	41 188 036	1,15
		76 050 691	2,13
Services de consommation			
Booking Holdings, Inc.	18 650	45 395 965	1,27
Conteneurs			
Mayr-Melnhof Karton AG	243 671	40 742 697	1,14
Équipements électriques			
Legrand S.A.	614 331	54 910 402	1,54
Électronique			
Kyocera Corp.	818 400	42 551 616	1,19
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	369 906	20 231 836	0,57
Emmi AG	16 200	15 090 355	0,42
Nestlé S.A.	288 041	35 150 061	0,98
		70 472 252	1,97
Produits forestiers et papier			
Rayonier, Inc., REIT	1 334 898	48 576 938	1,36
Weyerhaeuser Co., REIT	1 060 951	36 528 543	1,02
		85 105 481	2,38
Assurances			
Beazley PLC	2 688 067	22 095 830	0,62
Hiscox Ltd.	1 602 554	22 354 801	0,62
		44 450 631	1,24
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	1 167 987	115 443 835	3,23
Cars.com, Inc.	1 201 400	20 543 940	0,58
Scout24 AG	837 235	48 586 492	1,36
		184 574 267	5,17
Loisirs et jouets			
Games Workshop Group PLC	233 939	27 150 857	0,76
Nintendo Co. Ltd.	893 700	38 620 693	1,08
		65 771 550	1,84

MFS Meridian Funds - Prudent Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Machines et outils				
Azbil Corp.		672 700	18 988 648	0,53
Équipements médicaux				
Nakanishi, Inc.		1 410 100	29 906 161	0,84
Sonova Holding AG		95 502	23 875 971	0,67
			53 782 132	1,51
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
S&P Global, Inc.		87 460	32 792 252	0,92
Lutte contre la pollution				
Daiseki Co. Ltd.		949 060	31 890 477	0,89
Imprimerie et édition				
Wolters Kluwer N.V.		365 365	39 819 949	1,11
Immobilier				
Civitas Social Housing PLC, REIT		30 300 144	21 386 258	0,60
Deutsche Konsum AG, REIT		1 925 402	16 536 291	0,46
Empire State Realty Trust, REIT, "A"		3 758 622	31 346 907	0,88
Grand City Properties S.A.		2 159 773	22 969 097	0,64
LEG Immobilien SE		1 604 152	125 045 716	3,50
Midland Holdings Ltd.		48 529 100	6 003 358	0,17
TAG Immobilien AG		5 073 289	43 437 711	1,22
Triple Point Social Housing REIT PLC		18 867 924	11 595 764	0,32
			278 321 102	7,79
Immobilier - Autres				
CTP N.V.		2 261 757	32 457 082	0,91
Restaurants				
Wetherspoons (J.D.) PLC		7 443 036	41 901 648	1,17
Produits chimiques spéciaux				
Nihon Parkerizing Co. Ltd.		1 978 800	14 608 721	0,41
Nitto Denko Corp.		637 900	41 281 125	1,15
			55 889 846	1,56
Magasins spécialisés				
Esprit Holdings Ltd.		25 794 800	2 741 960	0,08
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios S.A.		4 053 567	18 996 978	0,53
			21 738 938	0,61
Télécommunications mobiles				
KDDI Corp.		1 961 200	61 276 394	1,72
Services téléphoniques				
Altice USA, Inc., "A"		1 572 668	7 706 073	0,22
Hellenic Telecommunications Organization S.A.		1 258 069	19 790 766	0,55
Wireless Infrastructure Italian S.p.A.		3 605 243	39 525 474	1,11
			67 022 313	1,88
Transport par camion				
Yamato Holdings Co. Ltd.		2 282 400	39 867 762	1,12
Services publics - Énergie électrique				
Iberdrola S.A.		5 122 381	59 900 760	1,68
Total des actions ordinaires (coût identifié, 2 356 141 477 $)			**2 294 687 827**	**64,23**
OBLIGATIONS				
Radio-télévision				
Netflix, Inc., 4,875 %, 15/04/2028	USD	12 500 000	12 453 125	0,35
Biens de consommation				
Coty, Inc., 6,5 %, 15/04/2026		15 000 000	14 787 000	0,41
Assurances IARD				
Hiscox Ltd., 6,125 % jusqu'au 24/11/2025, FLR jusqu'au 24/11/2045	GBP	11 000 000	13 181 085	0,37
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, TIPS, 2,375 %, 15/01/2025	USD	35 536 500	35 697 062	1,00
Bons du Trésor américain, 0,5 %, 15/03/2023		82 700 000	82 307 468	2,30

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2023

MFS Meridian Funds - Prudent Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Obligations du Trésor américain, suite				
Bons du Trésor américain, 1,375 %, 30/06/2023	USD	129 600 000	127 843 312	3,58
Bons du Trésor américain, 1,375 %, 30/09/2023 (g)		130 700 000	127 805 199	3,58
Bons du Trésor américain, 2,625 %, 31/12/2023		129 900 000	127 418 707	3,57
Bons du Trésor américain, 2,25 %, 31/03/2024		121 100 000	117 765 020	3,29
Bons du Trésor américain, 3 %, 30/06/2024		55 000 000	53 835 547	1,51
Bons du Trésor américain, TIPS, 0,5 %, 15/04/2024		111 667 732	108 876 039	3,05
Bons du Trésor américain, TIPS, 0,125 %, 15/04/2027		80 241 362	75 776 369	2,12
			857 324 723	24,00
Total des obligations (coût identifié, 915 074 043 $)			**897 745 933**	**25,13**
ACTIONS PRIVILÉGIÉES				
Alimentation et boissons				
ITO EN Ltd. (coût identifié, 19 600 818 $)		1 109 400	15 486 343	0,43
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 190 741 000 $)	USD	190 741 000	190 741 000	5,34
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT				
Métaux et minéraux précieux				
iShares Physical Gold ETC		2 287 751	86 152 587	2,41
Produits et services spécialisés				
VanEck Junior Gold Miners UCITS ETF		515 845	17 659 065	0,50
Total des sociétés d'investissement (coût identifié, 104 610 059 $)			**103 811 652**	**2,91**
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 3 586 167 397 $)			**3 502 472 755**	**98,04**

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES			
Apple, Inc. – Septembre 2023 @ $145	9 059	10 961 390	0,31
Mettler-Toledo International, Inc. – Décembre 2023 @ $1 530	115	1 723 850	0,05
Russell 2000 Index – Mars 2023 @ 1 600 $	600	222 000	0,01
Russell 2000 Index – Mars 2023 @ 1 700 $	600	492 000	0,01
Russell 2000 Index – Juin 2023 @ 1 700 $	500	1 570 000	0,04
Russell 2000 Index – Juin 2023 @ 1 750 $	500	2 032 500	0,06
Russell 2000 Index – Juin 2023 @ 1 850 $	500	3 566 000	0,10
Russell 2000 Index – Juin 2023 @ 1 950 $	500	5 185 000	0,15
Russell 2000 Index – Décembre 2023 @ 1 650 $	300	3 165 000	0,09
Russell 2000 Index – Décembre 2023 @ 1 700 $	500	3 243 000	0,09
Russell 2000 Index – Décembre 2023 @ 1 500 $	500	2 200 000	0,06
Russell 2000 Index – Juin 2024 @ 1 400 $	500	2 350 000	0,07
Russell 2000 Index – Juin 2024 @ 1 500 $	500	3 025 000	0,08
S&P 500 Index – Mars 2023 @ 3 700 $	250	462 500	0,01
S&P 500 Index – Mars 2023 @ 2 650 $	200	292 000	0,01
S&P 500 Index – Juin 2023 @ 3 750 $	250	1 822 500	0,05
S&P 500 Index – Juin 2023 @ 3 850 $	250	2 425 500	0,07
S&P 500 Index – Juin 2023 @ 3 600 $	250	1 270 750	0,04
S&P 500 Index – Décembre 2023 @ 3 300 $	250	1 938 000	0,05
S&P 500 Index – Décembre 2023 @ 3 200 $	300	1 912 500	0,05
S&P 500 Index – Juin 2024 @ 3 250 $	350	3 601 500	0,10
Total des options de vente achetées (primes versées, 103 314 519 $)		**53 460 990**	**1,50**
Total des Options d'Achat Achetées			
Tencent Holdings Ltd. – Septembre 2023 @ HKD 470,16 (primes versées, 12 085 745 $)	9 220	2 054 853	0,06
Total des investissements (coût identifié, 3 701 567 661 $) (k)		**3 557 988 598**	**99,60**

MFS Meridian Funds - Prudent Wealth Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OPTIONS DE VENTE VENDUES			
Apple, Inc. – Septembre 2023 @ $100 (primes reçues, $3 052 340)	(9 059)	(1 413 204)	(0,04)
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		15 895 137	0,44
ACTIF NET		3 572 470 531	100,00

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

MFS Meridian Funds - U.K. Equity Fund

(en livres sterling)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (£)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
QinetiQ Group PLC	62 292	225 995	1,03
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	28 198	992 570	4,54
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	17 892	441 412	2,02
Radio-télévision			
WPP Group PLC	34 115	322 797	1,48
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Barclays PLC	135 747	252 272	1,15
IG Group Holdings PLC	51 710	412 578	1,89
London Stock Exchange Group PLC	6 257	464 986	2,13
TP ICAP PLC	212 369	375 044	1,72
		1 504 880	6,89
Services aux entreprises			
Experian PLC	21 318	632 190	2,89
IP Group PLC	289 760	176 754	0,81
RS Group PLC	32 791	309 856	1,42
SIG PLC	569 511	199 044	0,91
		1 317 844	6,03
Logiciels			
Sage Group PLC	41 038	319 313	1,46
Construction			
Bellway PLC	16 848	359 252	1,64
Forterra PLC	99 694	212 847	0,98
		572 099	2,62
Biens de consommation			
Reckitt Benckiser Group PLC	12 411	716 883	3,28
Énergie - Sociétés intégrées			
Galp Energia SGPS S.A., "B"	40 287	446 738	2,04
Harbour Energy PLC	75 087	235 978	1,08
Shell PLC	54 118	1 289 344	5,90
		1 972 060	9,02
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Ocado Group PLC	11 022	71 437	0,33
Tesco PLC	290 456	715 663	3,27
		787 100	3,60
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	3 779	476 570	2,18
Whitbread PLC	14 592	445 622	2,04
		922 192	4,22

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2023

MFS Meridian Funds - U.K. Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (£)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Marchandises générales			
B&M European Value Retail S.A.	60 533	272 281	1,25
Assurances			
Beazley PLC	50 573	337 193	1,54
Hiscox Ltd.	25 634	290 045	1,33
St. James's Place PLC	39 810	489 782	2,24
		1 117 020	5,11
Internet			
Moneysupermarket.com Group PLC	105 990	253 104	1,16
Machines et outils			
Weir Group PLC	13 510	241 280	1,10
Grandes banques			
Lloyds TSB Group PLC	1 053 145	557 042	2,55
NatWest Group PLC	280 431	865 436	3,96
		1 422 478	6,51
Équipements médicaux			
ConvaTec Group PLC	126 637	296 894	1,36
Métaux et exploitation minière			
Glencore PLC	166 160	904 901	4,14
Rio Tinto PLC	12 910	818 637	3,75
		1 723 538	7,89
Produits pharmaceutiques			
AstraZeneca PLC	10 842	1 150 626	5,26
Roche Holding AG	1 750	443 634	2,03
		1 594 260	7,29
Imprimerie et édition			
Future PLC	15 758	238 710	1,09
RELX PLC	37 451	902 869	4,13
		1 141 579	5,22
Immobilier			
Unite Group PLC, REIT	32 938	329 443	1,51
Restaurants			
Greggs PLC	5 209	140 330	0,64
Produits chimiques spéciaux			
Akzo Nobel N.V.	3 654	220 455	1,01
Croda International PLC	4 402	304 259	1,39
Essentra PLC	109 066	236 277	1,08
		760 991	3,48
Télécommunications mobiles			
Vodafone Group PLC	349 789	326 866	1,50
Tabac			
British American Tobacco PLC	24 903	772 515	3,54
Imperial Brands PLC	32 466	660 190	3,02
		1 432 705	6,56
Services publics - Énergie électrique			
National Grid PLC	55 020	567 665	2,60
Total des actions ordinaires (coût identifié, 21 072 603 £)		21 715 579	99,37
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 21 072 603 £) (k)		21 715 579	99,37
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		138 224	0,63
ACTIF NET		21 853 803	100,00

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

MFS Meridian Funds - U.S. Concentrated Growth Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Industrie de la confection			
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	10 278	8 978 701	1,97
NIKE, Inc., "B"	128 276	16 333 383	3,58
		25 312 084	5,55
Industrie automobile			
Aptiv PLC	116 485	13 173 289	2,89
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Charles Schwab Corp.	133 283	10 318 770	2,26
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	87 466	24 407 387	5,35
Fidelity National Information Services, Inc.	234 284	17 580 672	3,85
		41 988 059	9,20
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	40 849	15 128 019	3,32
Microsoft Corp.	147 497	36 551 231	8,01
		51 679 250	11,33
Biens de consommation			
Church & Dwight Co., Inc.	256 660	20 753 527	4,55
Équipements électriques			
Amphenol Corp., "A"	258 733	20 639 132	4,52
Fortive Corp.	246 247	16 752 183	3,67
		37 391 315	8,19
Électronique			
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	110 218	10 220 515	2,24
Texas Instruments, Inc.	95 989	17 010 211	3,73
		27 230 726	5,97
Alimentation et boissons			
McCormick & Co., Inc.	132 164	9 928 160	2,18
Assurances			
Aon PLC	82 109	26 166 496	5,73
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	309 861	30 626 661	6,71
Loisirs et jouets			
Electronic Arts, Inc.	116 852	15 036 515	3,30
Technologies et services médicaux et de santé			
ICON PLC	63 812	14 722 066	3,23
Équipements médicaux			
Boston Scientific Corp.	446 273	20 640 126	4,52
Danaher Corp.	73 388	19 402 319	4,25
STERIS PLC	59 613	12 310 681	2,70
		52 353 126	11,47
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Moody's Corp.	32 893	10 616 216	2,32
Visa, Inc., "A"	134 552	30 975 216	6,79
		41 591 432	9,11
Magasins spécialisés			
TJX Cos., Inc.	257 572	21 084 844	4,62
Télécommunications mobiles			
American Tower Corp., REIT	61 072	13 642 874	2,99
Total des actions ordinaires (coût identifié, 384 677 902 $)		**452 999 194**	**99,28**

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 2 292 000 $)	USD	2 292 000	2 292 000	0,50
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 386 969 902 $) (k)			455 291 194	99,78
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			1 010 631	0,22
ACTIF NET			456 301 825	100,00

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

MFS Meridian Funds - U.S. Corporate Bond Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Aérospatiale et défense				
General Dynamics Corp., 3,625 %, 1/04/2030	USD	1 087 000	1 048 943	0,26
Raytheon Technologies Corp., 1,9 %, 1/09/2031		1 350 000	1 100 317	0,27
Raytheon Technologies Corp., 2,375 %, 15/03/2032		2 232 000	1 876 814	0,47
Raytheon Technologies Corp., 3,03 %, 15/03/2052		1 072 000	791 088	0,20
			4 817 162	1,20
Industrie de la confection				
Tapestry, Inc., 3,05 %, 15/03/2032		2 097 000	1 718 886	0,43
Créances adossées à des actifs et titrisées				
KREF 2018-FT1 Ltd., "A", FLR, 5,535 %, 15/02/2039		776 500	752 665	0,19
KREF 2018-FT1 Ltd., "AS", FLR, 5,764 %, 15/02/2039		853 500	813 156	0,20
PFP III 2021-8 Ltd., "A", FLR, 5,454 %, 9/08/2037		1 263 477	1 215 447	0,31
PFP III 2021-8 Ltd., "AS", FLR, 5,704 %, 9/08/2037		1 587 000	1 494 365	0,37
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL5, "A", FLR, 5,505 %, 25/04/2038		687 042	664 918	0,17
			4 940 551	1,24
Industrie automobile				
Hyundai Capital America, 2 %, 15/06/2028		1 174 000	995 173	0,25
Hyundai Capital America, 6,375 %, 8/04/2030		352 000	369 966	0,09
			1 365 139	0,34
Radio-télévision				
Activision Blizzard, Inc., 2,5 %, 15/09/2050		1 327 000	891 676	0,22
Discovery Communications LLC, 4 %, 15/09/2055		1 062 000	730 456	0,18
Discovery, Inc., 5,3 %, 15/05/2049		984 000	832 282	0,21
Prosus N.V., 3,832 %, 8/02/2051		1 503 000	979 956	0,25
Walt Disney Co., 3,5 %, 13/05/2040		3 038 000	2 598 723	0,65
Walt Disney Co., 3,6 %, 13/01/2051		1 912 000	1 578 722	0,40
Walt Disney Co., 3,8 %, 13/05/2060		1 166 000	964 174	0,24
Warnermedia Holdings, Inc., 4,279 %, 15/03/2032		950 000	845 457	0,21
Warnermedia Holdings, Inc., 5,391 %, 15/03/2062		1 022 000	850 455	0,21
			10 271 901	2,57
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Brookfield Finance, Inc., 2,34 %, 30/01/2032		1 043 000	843 683	0,21
Intercontinental Exchange, Inc., 1,85 %, 15/09/2032		3 358 000	2 643 404	0,66
Intercontinental Exchange, Inc., 5,2 %, 15/06/2062		1 398 000	1 378 944	0,34
LPL Holdings, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		394 000	374 946	0,09
LPL Holdings, Inc., 4 %, 15/03/2029		788 000	705 260	0,18
LPL Holdings, Inc., 4,375 %, 15/05/2031		394 000	344 990	0,09
			6 291 227	1,57
Construction				
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030		1 047 000	956 696	0,24

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Construction, suite				
Vulcan Materials Co., 4,5 %, 15/06/2047	USD	753 000	673 369	0,17
			1 630 065	0,41
Services aux entreprises				
Equifax, Inc., 3,1 %, 15/05/2030		1 555 000	1 364 380	0,34
Equifax, Inc., 2,35 %, 15/09/2031		1 181 000	972 814	0,24
Equinix, Inc., 2,625 %, 18/11/2024		1 832 000	1 759 271	0,44
Equinix, Inc., 2,5 %, 15/05/2031		2 350 000	1 963 805	0,49
Equinix, Inc., 3 %, 15/07/2050		1 439 000	989 950	0,25
Fiserv, Inc., 2,25 %, 1/06/2027		2 002 000	1 821 636	0,46
Fiserv, Inc., 4,4 %, 1/07/2049		1 667 000	1 430 851	0,36
Iron Mountain, Inc., 4,5 %, 15/02/2031		2 579 000	2 209 919	0,55
Visa, Inc., 2,05 %, 15/04/2030		3 187 000	2 779 962	0,69
			15 292 588	3,82
Télévision par câble				
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 5,375 %, 1/05/2047		1 044 000	891 226	0,22
Comcast Corp., 2,887 %, 1/11/2051		1 216 000	848 891	0,21
Sirius XM Radio, Inc., 4,125 %, 1/07/2030		2 178 000	1 867 918	0,47
Time Warner Cable, Inc., 4,5 %, 15/09/2042		435 000	345 979	0,09
			3 954 014	0,99
Produits chimiques				
RPM International, Inc., 4,55 %, 1/03/2029		344 000	327 571	0,08
RPM International, Inc., 4,25 %, 15/01/2048		175 000	139 185	0,04
			466 756	0,12
Logiciels				
Cisco Systems, Inc., 5,5 %, 15/01/2040		578 000	638 246	0,16
Microsoft Corp., 3,125 %, 3/11/2025		2 581 000	2 511 690	0,63
Microsoft Corp., 3,45 %, 8/08/2036		906 000	838 610	0,21
Microsoft Corp., 2,525 %, 1/06/2050		1 185 000	844 446	0,21
VeriSign, Inc., 4,75 %, 15/07/2027		513 000	508 551	0,13
			5 341 543	1,34
Logiciels - Systèmes				
Apple, Inc., 2,05 %, 11/09/2026		1 973 000	1 830 020	0,46
Apple, Inc., 1,7 %, 5/08/2031		1 100 000	905 447	0,22
Apple, Inc., 2,65 %, 11/05/2050		768 000	545 575	0,14
Apple, Inc., 2,7 %, 5/08/2051		715 000	508 362	0,13
			3 789 404	0,95
Conglomérats				
Otis Worldwide Corp., 2,565 %, 15/02/2030		1 190 000	1 038 675	0,26
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		977 000	991 866	0,25
Regal Rexnord Corp., 6,3 %, 15/02/2030		838 000	854 477	0,21
Regal Rexnord Corp., 6,4 %, 15/04/2033		1 222 000	1 252 948	0,31
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 3,2 %, 15/06/2025		1 435 000	1 357 671	0,34
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,95 %, 15/09/2028		2 807 000	2 788 294	0,70
			8 283 931	2,07
Biens de consommation				
Hasbro, Inc., 3,9 %, 19/11/2029		1 893 000	1 730 356	0,43
Mattel, Inc., 3,75 %, 1/04/2029		2 487 000	2 234 321	0,56
			3 964 677	0,99
Services de consommation				
Booking Holdings, Inc., 3,6 %, 1/06/2026		971 000	943 853	0,24
Booking Holdings, Inc., 3,55 %, 15/03/2028		328 000	314 042	0,08
Booking Holdings, Inc., 4,625 %, 13/04/2030		1 535 000	1 541 068	0,38
			2 798 963	0,70

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Équipements électriques				
Arrow Electronics, Inc., 3,875 %, 12/01/2028	USD	1 523 000	1 432 008	0,36
Ciena Corp., 4 %, 31/01/2030		1 919 000	1 679 125	0,42
Commscope, Inc., 4,75 %, 1/09/2029		2 307 000	1 920 255	0,48
			5 031 388	1,26
Électronique				
Broadcom, Inc., 4,3 %, 15/11/2032		965 000	888 641	0,22
Lam Research Corp., 1,9 %, 15/06/2030		349 000	293 447	0,07
Lam Research Corp., 4,875 %, 15/03/2049		651 000	653 320	0,16
NXP B.V./NXP Funding LLC/NXP USA, Inc., 2,5 %, 11/05/2031		3 123 000	2 565 221	0,64
NXP B.V./NXP Funding LLC/NXP USA, Inc., 3,125 %, 15/02/2042		1 225 000	880 623	0,22
Qualcomm, Inc., 3,25 %, 20/05/2027		1 535 000	1 479 387	0,37
Sensata Technologies, Inc., 4,375 %, 15/02/2030		2 055 000	1 860 309	0,47
Sensata Technologies, Inc., 3,75 %, 15/02/2031		302 000	256 352	0,07
TSMC Arizona Corp., 3,875 %, 22/04/2027		666 000	654 077	0,17
TSMC Arizona Corp., 3,125 %, 25/10/2041		1 324 000	1 089 783	0,27
			10 621 160	2,66
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd., 4,25 %, 27/07/2027		1 763 000	1 721 041	0,43
Qatar Petroleum, 3,125 %, 12/07/2041		1 049 000	830 168	0,21
			2 551 209	0,64
Obligations souveraines des marchés émergents				
États-Unis du Mexique, 4,28 %, 14/08/2041		1 409 000	1 155 194	0,29
Énergie - Sociétés indépendantes				
EQT Corp., 3,625 %, 15/05/2031		652 000	570 683	0,14
Hess Corp., 5,8 %, 1/04/2047		1 495 000	1 514 784	0,38
			2 085 467	0,52
Énergie - Sociétés intégrées				
BP Capital Markets America, Inc., 1,749 %, 10/08/2030		1 355 000	1 128 112	0,28
BP Capital Markets America, Inc., 3,001 %, 17/03/2052		949 000	684 759	0,17
Eni S.p.A., 4,75 %, 12/09/2028		1 498 000	1 482 175	0,37
Eni S.p.A., 4,25 %, 9/05/2029		465 000	441 820	0,11
			3 736 866	0,93
Divertissement				
Royal Caribbean Cruises Ltd., 4,25 %, 1/07/2026		2 292 000	1 988 310	0,50
Établissements financiers				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,65 %, 21/07/2027		1 434 000	1 332 391	0,33
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,3 %, 30/01/2032		654 000	549 104	0,14
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,85 %, 29/10/2041		1 178 000	919 002	0,23
Air Lease Corp., 2,875 %, 15/01/2032		2 846 000	2 337 648	0,58
Avolon Holdings Funding Ltd., 5,5 %, 15/01/2026		143 000	140 565	0,04
Avolon Holdings Funding Ltd., 3,25 %, 15/02/2027		1 012 000	913 363	0,23
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,75 %, 21/02/2028		3 059 000	2 635 435	0,66
			8 827 508	2,21
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4,375 %, 15/04/2038		1 883 000	1 785 796	0,45
Constellation Brands, Inc., 2,25 %, 1/08/2031		1 766 000	1 457 095	0,36
Constellation Brands, Inc., 4,75 %, 9/05/2032		1 188 000	1 187 670	0,30
Constellation Brands, Inc., 3,75 %, 1/05/2050		1 050 000	848 146	0,21
Diageo Capital PLC, 2 %, 29/04/2030		1 769 000	1 509 147	0,38
JBS USA Lux S.A./JBS USA Finance, Inc., 5,5 %, 15/01/2030		850 000	825 988	0,21
JBS USA Lux S.A./JBS USA Finance, Inc., 3,75 %, 1/12/2031		850 000	718 061	0,18
Kraft Heinz Foods Co., 4,875 %, 1/10/2049		913 000	853 933	0,21
Kraft Heinz Foods Co., 5,5 %, 1/06/2050		1 480 000	1 510 481	0,38
SYSCO Corp., 2,4 %, 15/02/2030		522 000	452 521	0,11
SYSCO Corp., 2,45 %, 14/12/2031		1 082 000	907 701	0,23

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Alimentation et boissons, suite				
SYSCO Corp., 4,45 %, 15/03/2048	USD	1 066 000	944 607	0,23
			13 001 146	3,25
Jeux et hôtellerie				
Hilton Domestic Operating Co., Inc., 3,625 %, 15/02/2032		2 524 000	2 119 529	0,53
Marriott International, Inc., 4 %, 15/04/2028		918 000	881 702	0,22
Marriott International, Inc., 2,85 %, 15/04/2031		678 000	577 060	0,15
Marriott International, Inc., 3,5 %, 15/10/2032		2 501 000	2 209 771	0,55
VICI Properties LP / VICI Note Co., Inc., 4,25 %, 1/12/2026		295 000	278 407	0,07
VICI Properties LP / VICI Note Co., Inc., 4,125 %, 15/08/2030		589 000	526 853	0,13
VICI Properties LP, REIT, 4,75 %, 15/02/2028		2 020 000	1 956 021	0,49
			8 549 343	2,14
Assurances				
Corebridge Financial, Inc., 3,9 %, 5/04/2032		1 195 000	1 088 452	0,27
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042		194 000	168 346	0,04
Equitable Holdings, Inc., 5,594 %, 11/01/2033		2 219 000	2 271 919	0,57
			3 528 717	0,88
Assurances - Santé				
Humana, Inc., 2,15 %, 3/02/2032		608 000	493 589	0,12
Humana, Inc., 4,95 %, 1/10/2044		986 000	950 444	0,24
UnitedHealth Group, Inc., 5,3 %, 15/02/2030		993 000	1 044 058	0,26
UnitedHealth Group, Inc., 2,3 %, 15/05/2031		1 693 000	1 456 367	0,36
UnitedHealth Group, Inc., 4,625 %, 15/07/2035		1 369 000	1 382 633	0,35
UnitedHealth Group, Inc., 3,5 %, 15/08/2039		431 000	374 453	0,09
UnitedHealth Group, Inc., 5,875 %, 15/02/2053		1 046 000	1 197 670	0,30
			6 899 214	1,72
Assurances IARD				
Aon Corp., 3,75 %, 2/05/2029		1 961 000	1 862 146	0,46
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 2,05 %, 23/08/2031		1 804 000	1 476 571	0,37
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 2,6 %, 2/12/2031		265 000	224 684	0,06
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 2,9 %, 23/08/2051		2 395 000	1 649 753	0,41
Fairfax Financial Holdings Ltd., 5,625 %, 16/08/2032		2 585 000	2 516 096	0,63
			7 729 250	1,93
Obligations quasi souveraines du marché international				
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties, 2,5 %, 15/10/2031		1 770 000	1 389 687	0,35
Obligations souveraines du marché international				
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		1 741 000	1 748 021	0,44
Machines et outils				
Ashtead Capital, Inc., 5,55 %, 30/05/2033		468 000	469 728	0,12
CNH Industrial Capital LLC, 5,45 %, 14/10/2025		1 521 000	1 545 951	0,38
CNH Industrial N.V., 3,85 %, 15/11/2027		1 857 000	1 804 623	0,45
			3 820 302	0,95
Grandes banques				
Australia and New Zealand Banking Group Ltd., 2,57 % jusqu'au 25/11/2030, FLR jusqu'au 25/11/2035		815 000	628 536	0,16
Bank of America Corp., 2,496 % jusqu'au 13/02/2030, FLR jusqu'au 13/02/2031		637 000	541 848	0,14
Bank of America Corp., 2,676 % jusqu'au 19/06/2040, FLR jusqu'au 19/06/2041		1 047 000	771 848	0,19
Bank of America Corp., 3,311 % jusqu'au 22/04/2041, FLR jusqu'au 22/04/2042		4 051 000	3 259 824	0,81
Bank of New York Mellon Corp., 5,802 % jusqu'au 25/10/2027, FLR jusqu'au 25/10/2028		1 396 000	1 467 768	0,37
Bank of New York Mellon Corp., 5,834 % jusqu'au 25/10/2032, FLR jusqu'au 25/10/2033		1 785 000	1 933 213	0,48
Barclays PLC, 2,894 % jusqu'au 24/11/2031, FLR jusqu'au 24/11/2032		2 468 000	2 014 775	0,50
Commonwealth Bank of Australia, 3,61 % jusqu'au 12/09/2029, FLR jusqu'au 12/09/2034		1 078 000	932 231	0,23
Commonwealth Bank of Australia, 3,305 %, 11/03/2041		1 883 000	1 386 872	0,35
Credit Agricole S.A., 1,247 % jusqu'au 26/01/2026, FLR jusqu'au 26/01/2027		948 000	847 636	0,21
Goldman Sachs Group, Inc., 2,64 % jusqu'au 24/02/2027, FLR jusqu'au 24/02/2028		2 034 000	1 865 001	0,47
Goldman Sachs Group, Inc., 2,6 %, 7/02/2030		5 288 000	4 599 285	1,15
Goldman Sachs Group, Inc., 3,102 % jusqu'au 24/02/2032, FLR jusqu'au 24/02/2033		968 000	829 539	0,21

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Grandes banques, suite				
HSBC Holdings PLC, 2,357 % jusqu'au 18/08/2030, FLR jusqu'au 18/08/2031	USD	2 379 000	1 924 871	0,48
HSBC Holdings PLC, 2,871 % jusqu'au 22/11/2031, FLR jusqu'au 22/11/2032		1 068 000	874 900	0,22
JPMorgan Chase & Co., 3,782 % jusqu'au 1/02/2027, FLR jusqu'au 1/02/2028		1 486 000	1 428 352	0,36
JPMorgan Chase & Co., 2,545 % jusqu'au 8/11/2031, FLR jusqu'au 8/11/2032		3 282 000	2 724 386	0,68
JPMorgan Chase & Co., 3,897 % jusqu'au 23/01/2048, FLR jusqu'au 23/01/2049		1 894 000	1 617 133	0,40
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 1,64 % jusqu'au 13/10/2026, FLR jusqu'au 13/10/2027		891 000	785 400	0,20
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2,494 % jusqu'au 13/10/2031, FLR jusqu'au 13/10/2032		1 356 000	1 105 373	0,28
Morgan Stanley, 4,431 % jusqu'au 23/01/2029, FLR jusqu'au 23/01/2030		414 000	403 435	0,10
Morgan Stanley, 2,699 % jusqu'au 22/01/2030, FLR jusqu'au 22/01/2031		6 692 000	5 807 143	1,45
Morgan Stanley, 3,622 % jusqu'au 1/04/2030, FLR jusqu'au 1/04/2031		4 895 000	4 502 519	1,13
Morgan Stanley, 3,217 % jusqu'au 22/04/2041, FLR jusqu'au 22/04/2042		655 000	523 189	0,13
National Australia Bank Ltd., 3,347 % jusqu'au 12/01/2032, FLR jusqu'au 12/01/2037		1 001 000	808 281	0,20
Nordea Bank Abp, 1,5 %, 30/09/2026		2 963 000	2 618 461	0,65
Royal Bank of Canada, 2,3 %, 3/11/2031		2 780 000	2 307 162	0,58
Royal Bank of Canada, 5 %, 1/02/2033		2 200 000	2 233 246	0,56
Société Générale S.A., 2,797 % jusqu'au 19/01/2027, FLR jusqu'au 19/01/2028		459 000	413 612	0,10
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 1,71 %, 12/01/2031		952 000	748 671	0,19
Toronto-Dominion Bank, 4,108 %, 8/06/2027		1 027 000	1 010 245	0,25
Toronto-Dominion Bank, 4,693 %, 15/09/2027		1 329 000	1 336 253	0,33
Toronto-Dominion Bank, 2 %, 10/09/2031		1 746 000	1 430 097	0,36
Toronto-Dominion Bank, 4,456 %, 8/06/2032		1 570 000	1 541 033	0,38
UBS Group AG, 3,126 % jusqu'au 13/08/2029, FLR jusqu'au 13/08/2030		1 307 000	1 151 588	0,29
UBS Group AG, 3,179 % jusqu'au 11/02/2042, FLR jusqu'au 11/02/2043		453 000	347 656	0,09
UBS Group AG, 4,375 % jusqu'au 10/02/2031, FLR jusqu'au 10/08/2171		1 737 000	1 424 166	0,36
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026		1 553 000	1 408 894	0,35
UniCredit S.p.A., 1,982 % jusqu'au 3/06/2026, FLR jusqu'au 3/06/2027		326 000	287 424	0,07
Wells Fargo & Co., 3,908 % jusqu'au 25/04/2025, FLR jusqu'au 25/04/2026		1 911 000	1 866 990	0,47
Wells Fargo & Co., 3,35 % jusqu'au 2/03/2032, FLR jusqu'au 2/03/2033		3 198 000	2 820 002	0,70
			66 528 858	16,63
Technologies et services médicaux et de santé				
Alcon Finance Corp., 2,6 %, 27/05/2030		2 428 000	2 123 150	0,53
Alcon Finance Corp., 5,375 %, 6/12/2032		416 000	435 321	0,11
Becton, Dickinson and Co., 2,823 %, 20/05/2030		384 000	341 581	0,09
Becton, Dickinson and Co., 4,298 %, 22/08/2032		941 000	918 552	0,23
Becton, Dickinson and Co., 4,685 %, 15/12/2044		142 000	134 963	0,03
Becton, Dickinson and Co., 4,669 %, 6/06/2047		1 415 000	1 335 322	0,33
HCA, Inc., 5,875 %, 1/02/2029		1 582 000	1 627 200	0,41
Thermo Fisher Scientific, Inc., 2 %, 15/10/2031		638 000	535 486	0,14
Thermo Fisher Scientific, Inc., 2,8 %, 15/10/2041		425 000	333 710	0,08
			7 785 285	1,95
Équipements médicaux				
Boston Scientific Corp., 2,65 %, 1/06/2030		942 000	836 125	0,21
Danaher Corp., 2,6 %, 1/10/2050		1 667 000	1 151 520	0,29
			1 987 645	0,50
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 2,625 %, 10/09/2030		2 580 000	2 192 294	0,55
Anglo American Capital PLC, 2,875 %, 17/03/2031		1 206 000	1 035 850	0,26
Coeur Mining, Inc., 5,125 %, 15/02/2029		691 000	556 396	0,14
First Quantum Minerals Ltd., 6,875 %, 1/03/2026		206 000	200 325	0,05
First Quantum Minerals Ltd., 6,875 %, 15/10/2027		1 059 000	1 026 568	0,26
FMG Resources Ltd., 4,375 %, 1/04/2031		1 517 000	1 334 960	0,33
Glencore Funding LLC, 2,5 %, 1/09/2030		1 105 000	936 358	0,23
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031		1 786 000	1 529 634	0,38

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Métaux et exploitation minière, suite				
Novelis Corp., 4,75 %, 30/01/2030	USD	1 321 000	1 195 505	0,30
			10 007 890	2,50
Secteur intermédiaire				
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 3,7 %, 15/11/2029		812 000	762 549	0,19
Enbridge, Inc., 3,4 %, 1/08/2051		2 543 000	1 896 326	0,47
Energy Transfer LP, 4 %, 1/10/2027		674 000	645 515	0,16
Energy Transfer LP, 5,55 %, 15/02/2028		593 000	602 624	0,15
Energy Transfer LP, 3,75 %, 15/05/2030		864 000	791 854	0,20
Energy Transfer LP, 5,75 %, 15/02/2033		684 000	702 947	0,18
Energy Transfer LP, 7,125 % jusqu'au 15/05/2030, FLR jusqu'au 15/05/2171		1 286 000	1 174 761	0,29
EQM Midstream Partners LP, 4,5 %, 15/01/2029		1 248 000	1 094 571	0,27
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 1,75 %, 30/09/2027		1 748 214	1 621 319	0,41
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 2,16 %, 31/03/2034		1 466 511	1 265 373	0,32
Plains All American Pipeline, 4,9 %, 15/02/2045		868 000	730 652	0,18
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp., 4,65 %, 15/10/2025		637 000	630 338	0,16
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp., 3,55 %, 15/12/2029		1 873 000	1 684 568	0,42
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,2 %, 15/03/2028		1 073 000	1 039 894	0,26
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,5 %, 15/05/2030		469 000	455 255	0,11
Targa Resources Corp., 4,2 %, 1/02/2033		954 000	864 563	0,22
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		1 591 000	1 362 284	0,34
			17 325 393	4,33
Obligations municipales				
Golden State, CA, Tobacco Securitization Corp., Tobacco Settlement Rev., Taxable, "B", 2,746 %, 1/06/2034		885 000	747 475	0,19
Golden State, CA, Tobacco Securitization Corp., Tobacco Settlement Rev., Taxable, "B", 3 %, 1/06/2046		750 000	697 455	0,17
			1 444 930	0,36
Gaz naturel - Distribution				
NiSource, Inc., 5,65 %, 1/02/2045		535 000	559 573	0,14
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 4,25 %, 15/07/2027		292 000	279 615	0,07
APA Infrastructure Ltd., 5 %, 23/03/2035		691 000	650 810	0,16
			930 425	0,23
Réseaux et télécommunications				
AT&T, Inc., 2,75 %, 1/06/2031		3 126 000	2 695 958	0,67
Verizon Communications, Inc., 2,1 %, 22/03/2028		1 068 000	952 449	0,24
			3 648 407	0,91
Pétrole				
Puma International Financing S.A., 5 %, 24/01/2026		2 265 000	2 084 026	0,52
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
American Express Co., 4,989 % jusqu'au 26/05/2032, FLR jusqu'au 26/05/2033		2 622 000	2 598 898	0,65
Mizrahi Tefahot Bank Ltd., 3,077 % jusqu'au 7/04/2026, FLR jusqu'au 7/04/2031		1 249 000	1 123 475	0,28
			3 722 373	0,93
Produits pharmaceutiques				
AstraZeneca PLC, 1,375 %, 6/08/2030		1 374 000	1 127 834	0,28
Merck & Co., Inc., 2,75 %, 10/12/2051		658 000	473 867	0,12
Pfizer, Inc., 2,55 %, 28/05/2040		658 000	506 352	0,13
			2 108 053	0,53
Lutte contre la pollution				
Waste Connections, Inc., 4,2 %, 15/01/2033		2 888 000	2 805 540	0,70
Chemins de fer et transport maritime				
Canadian Pacific Railway Co., 3 %, 2/12/2041		953 000	756 422	0,19
Canadian Pacific Railway Co., 3,1 %, 2/12/2051		1 274 000	939 320	0,23
			1 695 742	0,42
Immobilier - Appartements				
American Homes 4 Rent LP, REIT, 2,375 %, 15/07/2031		1 831 000	1 494 419	0,37

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Immobilier - Bureaux				
Corporate Office Property LP, REIT, 2 %, 15/01/2029	USD	2 062 000	1 635 031	0,41
Corporate Office Property LP, REIT, 2,75 %, 15/04/2031		2 908 000	2 269 746	0,57
			3 904 777	0,98
Immobilier - Autres				
EPR Properties, REIT, 3,6 %, 15/11/2031		1 127 000	871 258	0,22
Lexington Realty Trust Co., 2,375 %, 1/10/2031		2 101 000	1 653 326	0,41
W.P. Carey, Inc., REIT, 2,45 %, 1/02/2032		1 399 000	1 141 852	0,29
			3 666 436	0,92
Immobilier - Distribution				
Brixmor Operating Partnership LP, REIT, 4,125 %, 15/05/2029		1 082 000	1 000 725	0,25
Brixmor Operating Partnership LP, REIT, 2,5 %, 16/08/2031		1 330 000	1 064 511	0,27
Spirit Realty, LP, REIT, 4,45 %, 15/09/2026		496 000	479 851	0,12
Spirit Realty, LP, REIT, 3,2 %, 15/02/2031		1 291 000	1 086 821	0,27
STORE Capital Corp., REIT, 2,7 %, 1/12/2031		1 756 000	1 324 122	0,33
			4 956 030	1,24
Distribution				
Alimentation Couche-Tard, Inc., 3,8 %, 25/01/2050		1 791 000	1 339 758	0,34
Amazon.com, Inc., 3,6 %, 13/04/2032		1 760 000	1 674 493	0,42
AutoZone, Inc., 4,75 %, 1/08/2032		1 870 000	1 870 011	0,47
Home Depot, Inc., 3,3 %, 15/04/2040		1 954 000	1 654 955	0,41
Nordstrom, Inc., 4,25 %, 1/08/2031		1 653 000	1 241 254	0,31
			7 780 471	1,95
Produits chimiques spéciaux				
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,23 %, 1/10/2025		366 000	329 120	0,08
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,832 %, 15/10/2027		369 000	319 329	0,08
International Flavors & Fragrances, Inc., 2,3 %, 1/11/2030		666 000	551 994	0,14
International Flavors & Fragrances, Inc., 3,268 %, 15/11/2040		965 000	739 620	0,18
			1 940 063	0,48
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		1 753 000	1 434 340	0,36
DICK'S Sporting Goods, 4,1 %, 15/01/2052		1 029 000	724 336	0,18
			2 158 676	0,54
Télécommunications mobiles				
Cellnex Finance Co. S.A., 3,875 %, 7/07/2041		2 295 000	1 694 071	0,42
Crown Castle, Inc., REIT, 4,45 %, 15/02/2026		1 064 000	1 051 222	0,26
Crown Castle, Inc., REIT, 3,65 %, 1/09/2027		1 496 000	1 427 414	0,36
Millicom International Cellular S.A., 4,5 %, 27/04/2031		1 017 000	860 891	0,21
Rogers Communications, Inc., 3,8 %, 15/03/2032		853 000	767 807	0,19
Rogers Communications, Inc., 4,5 %, 15/03/2042		908 000	789 888	0,20
Rogers Communications, Inc., 4,55 %, 15/03/2052		983 000	826 290	0,21
T-Mobile USA, Inc., 3 %, 15/02/2041		3 397 000	2 533 206	0,63
Vodafone Group PLC, 4,125 % jusqu'au 4/06/2031, FLR jusqu'au 4/06/2081		1 954 000	1 581 958	0,40
			11 532 747	2,88
Tabac				
Philip Morris International, Inc., 5,625 %, 17/11/2029		490 000	511 763	0,13
Transports - Services				
ERAC USA Finance LLC, 7 %, 15/10/2037		105 000	122 112	0,03
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 1,375 %, 15/11/2040		4 902 000	3 392 146	0,85
Obligations du Trésor américain, 2,375 %, 15/02/2042		5 157 000	4 171 932	1,04
Obligations du Trésor américain, 2,875 %, 15/05/2052 (g)		6 640 000	5 721 812	1,43
Bons du Trésor américain, 0,875 %, 31/01/2024		1 809 000	1 740 880	0,44
Bons du Trésor américain, 2,625 %, 15/04/2025		5 225 000	5 062 127	1,27
Bons du Trésor américain, 4,125 %, 15/11/2032		1 426 000	1 500 197	0,37
			21 589 094	5,40

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services publics - Énergie électrique				
American Transmission Systems, Inc., 2,65 %, 15/01/2032	USD	432 000	367 743	0,09
CenterPoint Energy, Inc., 2,65 %, 1/06/2031		1 729 000	1 479 220	0,37
Duke Energy Carolinas LLC, 2,45 %, 1/02/2030		1 537 000	1 348 136	0,34
Duke Energy Corp., 3,3 %, 15/06/2041		1 918 000	1 491 077	0,37
Enel Finance International N.V., 4,625 %, 15/06/2027		1 203 000	1 176 764	0,29
Enel Finance International N.V., 2,25 %, 12/07/2031		504 000	393 275	0,10
Enel Finance International N.V., 7,75 %, 14/10/2052		682 000	811 874	0,20
Evergy, Inc., 2,9 %, 15/09/2029		4 266 000	3 793 745	0,95
FirstEnergy Corp., 4,15 %, 15/07/2027		1 267 000	1 210 809	0,30
FirstEnergy Corp., 2,65 %, 1/03/2030		1 094 000	934 757	0,23
FirstEnergy Corp., 3,4 %, 1/03/2050		1 830 000	1 300 050	0,33
Florida Power & Light Co., 2,85 %, 1/04/2025		1 515 000	1 460 730	0,37
Florida Power & Light Co., 2,45 %, 3/02/2032		1 692 000	1 459 710	0,37
Florida Power & Light Co., 3,95 %, 1/03/2048		729 000	642 573	0,16
Georgia Power Co., 4,7 %, 15/05/2032		1 837 000	1 831 529	0,46
Georgia Power Co., 5,125 %, 15/05/2052		1 493 000	1 495 498	0,37
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		2 617 000	2 214 737	0,55
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 2,44 %, 15/01/2032		1 850 000	1 545 020	0,39
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 3,8 % jusqu'au 15/03/2027, FLR jusqu'au 15/03/2082		1 303 000	1 138 312	0,28
Pacific Gas & Electric Co., 5,45 %, 15/06/2027		704 000	706 824	0,18
Pacific Gas & Electric Co., 2,5 %, 1/02/2031		2 687 000	2 167 989	0,54
Southern California Edison Co., 4,5 %, 1/09/2040		727 000	657 963	0,16
Southern California Edison Co., 3,65 %, 1/02/2050		703 000	552 617	0,14
Southern Co., 3,7 %, 30/04/2030		348 000	325 549	0,08
Virginia Electric & Power Co., 2,875 %, 15/07/2029		374 000	339 257	0,09
Xcel Energy, Inc., 4,6 %, 1/06/2032		1 939 000	1 919 855	0,48
			32 765 613	8,19
Total des obligations (coût identifié, 413 480 860 $)			372 645 930	93,17
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 22 910 000 $)	USD	22 910 000	22 910 000	5,73
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 436 390 860 $)			395 555 930	98,90

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES				
Markit CDX North America High Yield Series 39 Index Credit Default Swap - Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mars 2023 @ 0,98 %	USD	7 000 000	15 085	0,00
Markit CDX North America High Yield Series 39 Index Credit Default Swap - Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 0,99 %		13 100 000	87 738	0,02
Total des options de vente achetées (primes versées, 285 108 $)			102 823	0,02
Total des investissements (coût identifié, 436 675 968 $)			395 658 753	98,92
OPTIONS DE VENTE VENDUES				
Markit CDX North America High Yield Series 39 Index Credit Default Swap - Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mars 2023 @ 0,91 %	USD	(7 000 000)	(3 939)	(0,00)
Markit CDX North America High Yield Series 39 Index Credit Default Swap - Le Compartiment paie 5 %, Le Fonds reçoit un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Avril 2023 @ 0,92 %		(13 100 000)	(20 700)	(0,01)
Total Put Options Written (primes reçues, 83 180 $)			(24 639)	(0,01)
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			4 343 267	1,09
ACTIF NET			399 977 381	100,00

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

MFS Meridian Funds - U.S. Government Bond Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Créances adossées à des actifs et titrisées				
ACREC 2021-FL1 Ltd., "AS", FLR, 5,97 %, 16/10/2036	USD	993 000	951 547	0,27
Arbor Multi-Family Mortgage Securities Trust, 2021-MF3, "XA", 0,741 %, 15/10/2054 (i)		8 513 325	354 571	0,10
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL3, "AS", FLR, 5,854 %, 15/08/2034		849 000	803 381	0,23
AREIT 2022-CRE6 Trust, "AS", FLR, 5,96 %, 16/01/2037		1 068 500	1 005 921	0,29
BSPDF 2021-FL1 Issuer Ltd., "A", FLR, 5,654 %, 15/10/2036		473 000	452 271	0,13
BSPDF 2021-FL1 Issuer Ltd., "AS", FLR, 5,934 %, 15/10/2036		598 500	581 453	0,17
BSPRT 2021-FL6 Issuer Ltd., "AS", FLR, 5,754 %, 15/03/2036		938 500	893 114	0,26
BXMT 2021-FL4 Ltd., "AS", FLR, 5,759 %, 15/05/2038		1 085 500	1 040 704	0,30
KREF 2018-FT1 Ltd., "AS", FLR, 5,764 %, 15/02/2039		270 500	257 714	0,07
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "AS", FLR, 6,204 %, 15/07/2036		921 500	873 738	0,25
LoanCore 2021-CRE6 Ltd., "AS", FLR, 6,109 %, 15/11/2038		1 008 500	951 591	0,28
MF1 2021-FL5 Ltd., "AS", FLR, 5,797 %, 15/07/2036		846 000	817 265	0,24
MF1 2021-FL5 Ltd., "B", FLR, 6,047 %, 15/07/2036		726 000	701 278	0,20
Morgan Stanley Capital I Trust, 2018-H4, "XA", 0,831 %, 15/12/2051 (i)		3 597 719	130 751	0,04
PFP III 2021-8 Ltd., "AS", FLR, 5,704 %, 9/08/2037		717 000	675 148	0,20
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL7, "A", FLR, 5,705 %, 25/11/2036		505 985	490 650	0,14
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL7, "AS", FLR, 6,005 %, 25/11/2036		158 500	151 690	0,04
Santander Drive Auto Receivables Trust, 2022-5, "A2", 3,98 %, 15/01/2025		205 848	205 074	0,06
Santander Drive Auto Receivables Trust, 2022-6, "A2", 4,37 %, 15/05/2025		229 000	228 176	0,07
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, 2018-C48, "XA", 0,943 %, 15/01/2052 (i)		1 951 402	81 244	0,02
Westlake Automobile Receivable Trust, 2023-1A, "A2B", FLR, 5,25 %, 15/06/2026		154 000	153 999	0,04
Westlake Automobile Receivables Trust, 2022-3A, "A2", 5,24 %, 15/07/2025		623 000	622 377	0,18
			12 423 657	3,58
Industrie automobile				
Hyundai Capital America, 2,375 %, 10/02/2023		306 000	305 763	0,09
Services de consommation				
Conservation Fund, 3,474 %, 15/12/2029		382 000	336 512	0,10
Industrie				
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,416 %, 1/10/2024		89 000	84 493	0,03
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,516 %, 1/10/2025		110 000	103 737	0,03
			188 230	0,06
Technologies et services médicaux et de santé				
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,325 %, 15/11/2028		671 000	678 696	0,19
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,75 %, 15/11/2038		442 000	444 940	0,13
			1 123 636	0,32
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 2,41 %, 1/05/2023		231 207	228 980	0,07
Fannie Mae, 5 %, 1/03/2024–1/03/2042		1 126 700	1 156 910	0,36
Fannie Mae, 4,5 %, 1/05/2025–1/06/2044		2 820 622	2 860 910	0,83
Fannie Mae, 4 %, 25/03/2028–1/07/2048		6 156 762	6 069 712	1,77
Fannie Mae, 3 %, 1/11/2028–25/05/2053		3 050 869	2 920 346	0,84
Fannie Mae, 2,5 %, 1/11/2031–1/10/2046		558 495	515 533	0,15
Fannie Mae, 3,5 %, 25/12/2031–25/02/2036(i)		258 658	25 058	0,01
Fannie Mae, 6,5 %, 1/02/2032–1/10/2037		213 856	223 599	0,06
Fannie Mae, 3 %, 25/02/2033 (i)		251 049	23 007	0,01
Fannie Mae, 5,5 %, 1/10/2033–1/05/2044		1 578 581	1 648 985	0,46
Fannie Mae, 6 %, 1/01/2036–1/06/2038		305 208	319 381	0,09
Fannie Mae, 3,5 %, 1/04/2038–1/12/2047		4 274 773	4 112 081	1,18
Fannie Mae, 2 %, 25/10/2040–25/04/2046		229 166	212 392	0,06
Fannie Mae, 1,75 %, 25/09/2041–25/10/2041		808 592	752 602	0,22
Fannie Mae, 2,75 %, 25/09/2042		277 965	262 228	0,08
Fannie Mae, UMBS, 2 %, 1/09/2036–1/04/2052		19 227 835	16 684 745	4,83
Fannie Mae, UMBS, 2,5 %, 1/03/2037–1/09/2052		29 631 624	26 153 280	7,53
Fannie Mae, UMBS, 1,5 %, 1/02/2042–1/04/2052		1 245 595	997 813	0,29
Fannie Mae, UMBS, 5,5 %, 1/05/2044–1/11/2052		1 032 746	1 057 603	0,30

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques, suite				
Fannie Mae, UMBS, 3,5 %, 1/05/2049–1/08/2052	USD	1 425 970	1 340 737	0,39
Fannie Mae, UMBS, 3 %, 1/06/2051–1/11/2052		6 234 832	5 684 974	1,63
Fannie Mae, UMBS, 4,5 %, 1/08/2052–1/09/2052		627 491	620 865	0,18
Fannie Mae, UMBS, 4 %, 1/09/2052		348 809	336 850	0,10
Fannie Mae, UMBS, 6 %, 1/10/2052		1 213 513	1 247 660	0,36
Fannie Mae, UMBS, 5 %, 1/11/2052		294 676	295 944	0,09
Freddie Mac, 5 %, 1/04/2023–1/12/2044		1 531 664	1 573 742	0,44
Freddie Mac, 6 %, 1/06/2023–1/06/2038		206 566	216 617	0,06
Freddie Mac, 3,06 %, 25/07/2023		946 000	937 502	0,27
Freddie Mac, 3,458 %, 25/08/2023		3 097 218	3 070 396	0,89
Freddie Mac, 0,903 %, 25/04/2024 (i)		6 354 796	55 091	0,02
Freddie Mac, 0,597 %, 25/07/2024 (i)		7 967 851	50 477	0,01
Freddie Mac, 3,064 %, 25/08/2024		894 835	873 221	0,25
Freddie Mac, 3,171 %, 25/10/2024		1 125 000	1 098 031	0,32
Freddie Mac, 2,67 %, 25/12/2024		1 828 000	1 766 586	0,51
Freddie Mac, 2,811 %, 25/01/2025		1 194 984	1 156 572	0,33
Freddie Mac, 3,329 %, 25/05/2025		2 111 000	2 059 929	0,59
Freddie Mac, 4 %, 1/07/2025–1/01/2041		292 049	289 711	0,08
Freddie Mac, 4,5 %, 1/07/2025–1/05/2042		713 919	725 617	0,20
Freddie Mac, 3,5 %, 15/11/2025–1/12/2046		4 033 183	3 906 454	1,13
Freddie Mac, 0,573 %, 25/07/2027 (i)		15 572 743	333 782	0,10
Freddie Mac, 0,424 %, 25/08/2027 (i)		13 411 466	222 982	0,06
Freddie Mac, 3,444 %, 25/12/2027		883 000	861 669	0,25
Freddie Mac, 0,293 %, 25/01/2028 (i)		21 478 247	292 310	0,08
Freddie Mac, 0,304 %, 25/01/2028 (i)		9 259 908	129 769	0,04
Freddie Mac, 0,135 %, 25/02/2028 (i)		25 900 556	185 634	0,05
Freddie Mac, 2,5 %, 15/03/2028		33 333	33 047	0,01
Freddie Mac, 0,12 %, 25/04/2028 (i)		16 614 866	112 868	0,03
Freddie Mac, 3 %, 15/06/2028–25/08/2049		3 089 262	2 904 932	0,83
Freddie Mac, 3,78 %, 25/10/2028		2 300 000	2 275 476	0,66
Freddie Mac, 4,06 %, 25/10/2028		2 009 000	2 005 351	0,58
Freddie Mac, 5,5 %, 1/05/2034–1/09/2041		493 318	517 777	0,15
Freddie Mac, 5,5 %, 15/02/2036 (i)		61 412	9 929	0,00
Freddie Mac, 2 %, 15/08/2036		169 942	167 883	0,05
Freddie Mac, 6,5 %, 1/05/2037		5 788	6 135	0,00
Freddie Mac, 4,5 %, 15/12/2040 (i)		19 237	1 696	0,00
Freddie Mac, 1,75 %, 15/08/2041		228 700	212 215	0,06
Freddie Mac, UMBS, 2 %, 1/04/2036–1/09/2052		9 920 340	8 485 170	2,46
Freddie Mac, UMBS, 2,5 %, 1/03/2037–1/11/2052		7 275 338	6 424 880	1,85
Freddie Mac, UMBS, 3,5 %, 1/12/2046–1/05/2052		439 478	418 837	0,12
Freddie Mac, UMBS, 3 %, 1/02/2050–1/09/2052		3 529 441	3 218 806	0,92
Freddie Mac, UMBS, 1,5 %, 1/05/2051		24 279	19 420	0,01
Freddie Mac, UMBS, 4 %, 1/05/2052		504 569	491 391	0,14
Freddie Mac, UMBS, 4,5 %, 1/07/2052		257 532	254 362	0,07
Freddie Mac, UMBS, 6 %, 1/11/2052		60 330	61 976	0,02
Ginnie Mae, 5,5 %, 15/01/2033–20/01/2053		2 499 730	2 547 561	0,73
Ginnie Mae, 5,682 %, 20/08/2034		228 798	236 378	0,07
Ginnie Mae, 4 %, 16/05/2039–20/11/2052		2 987 901	2 908 157	0,84
Ginnie Mae, 4,5 %, 15/08/2039–20/11/2052		8 327 556	8 284 613	2,38
Ginnie Mae, 3,5 %, 20/10/2041 (i)		78 021	3 913	0,00
Ginnie Mae, 3,5 %, 15/12/2041–20/11/2052		5 463 501	5 193 851	1,49
Ginnie Mae, 2,5 %, 20/06/2042–20/06/2052		6 149 254	5 483 989	1,59
Ginnie Mae, 4 %, 16/08/2042 (i)		110 730	16 333	0,00
Ginnie Mae, 2,25 %, 20/09/2043		150 446	143 546	0,04

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques, suite				
Ginnie Mae, 3 %, 20/04/2045–20/10/2052	USD	6 900 857	6 376 777	1,85
Ginnie Mae, 2 %, 20/01/2052–20/03/2052		6 836 636	5 908 713	1,71
Ginnie Mae, 5 %, 20/09/2052–20/11/2052		2 141 839	2 157 237	0,63
Ginnie Mae, 6 %, 21/02/2053		50 000	51 242	0,01
Ginnie Mae, 0,585 %, 16/02/2059 (i)		420 473	14 705	0,00
UMBS, TBA, 2 %, 16/02/2038		545 807	495 981	0,14
UMBS, TBA, 3 %, 25/02/2038		100 000	95 915	0,03
UMBS, TBA, 5,5 %, 13/02/2053		700 000	711 320	0,21
UMBS, TBA, 5 %, 13/04/2053		300 000	300 727	0,09
			164 111 396	47,34
Obligations municipales				
Chicago, IL, Transit Authority Sales Tax Receipts Refunding Rev., Taxable, "B", 2,064 %, 1/12/2024		377 000	360 840	0,10
Chicago, IL, Transit Authority Sales Tax Receipts Refunding Rev., Taxable, "B", 2,214 %, 1/12/2025		283 000	266 136	0,08
Golden State, CA, Tobacco Securitization Corp., Tobacco Settlement Rev., Taxable, "B", 3 %, 1/06/2046		530 000	492 868	0,14
Michigan Finance Authority Tobacco Settlement Asset-Backed Rev., Taxable (2006 Recettes vendues de tabac), "A-1", 2,326 %, 1/06/2030		221 515	212 061	0,06
Philadelphia, PA, School District, Taxable, "A", AGM, 5,995 %, 1/09/2030		600 000	646 990	0,19
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,497 %, 1/06/2024		300 000	286 186	0,08
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,647 %, 1/06/2025		245 000	226 783	0,07
			2 491 864	0,72
Sociétés publiques fédérales américaines et sociétés similaires				
Small Business Administration, 4,98 %, 1/11/2023		4 245	4 211	0,00
Small Business Administration, 4,89 %, 1/12/2023		12 798	12 635	0,00
Small Business Administration, 4,77 %, 1/04/2024		18 680	18 426	0,01
Small Business Administration, 4,99 %, 1/09/2024		13 280	13 070	0,00
Small Business Administration, 4,86 %, 1/10/2024		8 157	8 080	0,00
Small Business Administration, 4,86 %, 1/01/2025		12 091	11 946	0,00
Small Business Administration, 5,11 %, 1/04/2025		14 299	14 037	0,01
Small Business Administration, 5,16 %, 1/02/2028		65 300	63 828	0,02
Small Business Administration, 2,21 %, 1/02/2033		188 623	173 719	0,05
Small Business Administration, 2,22 %, 1/03/2033		287 035	264 013	0,08
Small Business Administration, 3,15 %, 1/07/2033		222 660	213 429	0,06
			797 394	0,23
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 6,25 %, 15/08/2023		857 000	863 093	0,25
Obligations du Trésor américain, 6 %, 15/02/2026		62 000	65 749	0,02
Obligations du Trésor américain, 6,75 %, 15/08/2026		614 000	673 721	0,19
Obligations du Trésor américain, 2,25 %, 15/02/2027		5 100 000	4 826 871	1,39
Obligations du Trésor américain, 4,5 %, 15/02/2036		560 000	622 584	0,18
Obligations du Trésor américain, 4,5 %, 15/08/2039		734 300	818 630	0,24
Obligations du Trésor américain, 3,75 %, 15/08/2041		1 538 000	1 547 612	0,45
Obligations du Trésor américain, 3,125 %, 15/02/2043		476 500	432 275	0,13
Obligations du Trésor américain, 2,875 %, 15/05/2043		7 495 400	6 526 854	1,88
Obligations du Trésor américain, 2,5 %, 15/02/2045		10 295 000	8 305 572	2,40
Obligations du Trésor américain, 3 %, 15/11/2045		1 600 000	1 406 937	0,41
Obligations du Trésor américain, 2,875 %, 15/11/2046		3 105 000	2 673 090	0,77
Bons du Trésor américain, 2,625 %, 28/02/2023		5 000 000	4 992 499	1,44
Bons du Trésor américain, 2,5 %, 31/03/2023		4 000 000	3 986 210	1,15
Bons du Trésor américain, 0,125 %, 31/05/2023		3 704 000	3 649 019	1,05
Bons du Trésor américain, 0,125 %, 15/07/2023		1 492 000	1 461 053	0,42
Bons du Trésor américain, 2,5 %, 15/08/2023		10 145 000	10 021 358	2,89
Bons du Trésor américain, 0,125 %, 31/08/2023		2 674 000	2 603 912	0,75
Bons du Trésor américain, 0,375 %, 31/10/2023		1 697 100	1 642 607	0,47

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations du Trésor américain, suite				
Bons du Trésor américain, 2,75 %, 15/02/2024	USD	1 176 000	1 152 158	0,33
Bons du Trésor américain, 3 %, 31/07/2024		7 367 000	7 208 725	2,08
Bons du Trésor américain, 4,375 %, 31/10/2024 (g)		15 537 000	15 543 069	4,48
Bons du Trésor américain, 0,25 %, 30/09/2025		8 998 000	8 175 526	2,36
Bons du Trésor américain, 2,625 %, 31/12/2025		4 600 000	4 447 266	1,28
Bons du Trésor américain, 2,875 %, 15/05/2028		9 650 000	9 302 826	2,68
Bons du Trésor américain, 2,375 %, 15/05/2029		6 715 000	6 258 590	1,81
Bons du Trésor américain, 3,25 %, 30/06/2029		8 691 000	8 521 254	2,46
Bons du Trésor américain, 2,625 %, 31/07/2029		8 116 000	7 669 303	2,21
Bons du Trésor américain, 1,625 %, 15/08/2029		8 091 000	7 206 047	2,08
Bons du Trésor américain, 1,75 %, 15/11/2029		5 874 000	5 264 802	1,52
			137 869 212	39,77
Total des obligations (coût identifié, 340 263 455 $)			319 647 664	92,21
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 21 400 000 $)	USD	21 400 000	21 400 000	6,17
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 361 663 455 $)			341 047 664	98,38
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			5 613 501	1,62
ACTIF NET			346 661 165	100,00

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

MFS Meridian Funds - U.S. Growth Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Industrie de la confection			
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	699	610 636	1,33
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Charles Schwab Corp.	7 936	614 405	1,33
CME Group, Inc.	1 926	340 247	0,74
		954 652	2,07
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	466	130 037	0,28
CoStar Group, Inc.	7 235	563 607	1,22
Equifax, Inc.	1 323	293 971	0,64
MSCI, Inc.	1 945	1 033 884	2,25
TransUnion	3 604	258 587	0,56
Verisk Analytics, Inc., "A"	3 905	709 890	1,54
		2 989 976	6,49
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	2 884	1 068 061	2,32
Autodesk, Inc.	709	152 548	0,33
Black Knight, Inc.	1 879	113 849	0,25
Cadence Design Systems, Inc.	2 186	399 666	0,87
Intuit, Inc.	2 606	1 101 478	2,39
Microsoft Corp.	16 873	4 181 298	9,08
Synopsys, Inc.	579	204 821	0,45
		7 221 721	15,69
Logiciels - Systèmes			
Apple, Inc.	16 653	2 402 861	5,22
Block, Inc., "A"	1 934	158 047	0,34

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels - Systèmes, suite			
ServiceNow, Inc.	1 022	465 143	1,01
		3 026 051	6,57
Construction			
Martin Marietta Materials, Inc.	438	157 522	0,34
Sherwin-Williams Co.	2 638	624 124	1,36
Vulcan Materials Co.	4 496	824 252	1,79
		1 605 898	3,49
Biens de consommation			
Colgate-Palmolive Co.	4 980	371 159	0,81
Estee Lauder Cos., Inc., "A"	2 643	732 323	1,59
		1 103 482	2,40
Équipements électriques			
AMETEK, Inc.	4 118	596 781	1,30
Amphenol Corp., "A"	2 543	202 855	0,44
Johnson Controls International PLC	8 473	589 467	1,28
Rockwell Automation, Inc.	675	190 370	0,41
		1 579 473	3,43
Électronique			
Applied Materials, Inc.	1 389	154 859	0,34
ASML Holding N.V., ADR	970	641 015	1,39
KLA Corp.	168	65 937	0,14
Lam Research Corp.	811	405 581	0,88
NVIDIA Corp.	5 946	1 161 670	2,53
		2 429 062	5,28
Énergie - Sociétés indépendantes			
EOG Resources, Inc.	2 256	298 356	0,65
Hess Corp.	2 543	381 857	0,83
		680 213	1,48
Énergie - Renouvelables			
Enphase Energy, Inc.	346	76 597	0,17
Jeux et hôtellerie			
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	3 796	550 762	1,20
Marchandises générales			
Dollar Tree, Inc.	1 542	231 578	0,50
Organisations de soins de santé intégrés			
UnitedHealth Group, Inc.	1 806	901 537	1,96
Assurances			
Aon PLC	2 467	786 184	1,71
Arthur J. Gallagher & Co.	1 153	225 665	0,49
		1 011 849	2,20
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	24 496	2 421 185	5,26
Alphabet, Inc., "C"	7 505	749 524	1,63
Gartner, Inc.	1 030	348 284	0,76
Match Group, Inc.	3 614	195 590	0,42
		3 714 583	8,07
Loisirs et jouets			
Electronic Arts, Inc.	3 477	447 420	0,97
Take-Two Interactive Software, Inc.	1 474	166 901	0,36
		614 321	1,33
Machines et outils			
Caterpillar, Inc.	360	90 825	0,20
Eaton Corp. PLC	1 406	228 067	0,49
		318 892	0,69

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Technologies et services médicaux et de santé				
ICON PLC		1 833	422 891	0,92
Veeva Systems, Inc.		405	69 073	0,15
			491 964	1,07
Équipements médicaux				
Abbott Laboratories		7 668	847 697	1,84
Agilent Technologies, Inc.		1 099	167 136	0,37
Becton, Dickinson and Co.		1 455	366 980	0,80
Boston Scientific Corp.		18 814	870 148	1,89
Danaher Corp.		3 327	879 592	1,91
STERIS PLC		1 076	222 205	0,48
Thermo Fisher Scientific, Inc.		1 695	966 709	2,10
			4 320 467	9,39
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
American Express Co.		647	113 180	0,24
Mastercard, Inc., "A"		5 125	1 899 325	4,13
Visa, Inc., "A"		7 097	1 633 800	3,55
			3 646 305	7,92
Produits pharmaceutiques				
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.		513	389 095	0,84
Vertex Pharmaceuticals, Inc.		2 434	786 425	1,71
Zoetis, Inc.		2 454	406 113	0,88
			1 581 633	3,43
Chemins de fer et transport maritime				
Canadian Pacific Railway Ltd.		5 641	445 075	0,97
Restaurants				
Chipotle Mexican Grill, Inc., "A"		159	261 774	0,57
Produits chimiques spéciaux				
Air Products & Chemicals, Inc.		2 016	646 148	1,41
Linde PLC		742	245 558	0,53
			891 706	1,94
Magasins spécialisés				
Amazon.com, Inc.		26 246	2 706 750	5,88
Lululemon Athletica, Inc.		680	208 678	0,45
O'Reilly Automotive, Inc.		445	352 596	0,77
			3 268 024	7,10
Télécommunications mobiles				
American Tower Corp., REIT		2 519	562 719	1,22
Total des actions ordinaires (coût identifié, 45 082 235 $)			45 090 950	97,96
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 984 000 $)	USD	984 000	984 000	2,14
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 46 066 235 $) (k)			46 074 950	100,10
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			(45 554)	(0,10)
ACTIF NET			46 029 396	100,00

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

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

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Aérospatiale et défense				
TransDigm, Inc., 4,625 %, 15/01/2029	USD	1 219 000	1 099 733	0,25
Créances adossées à des actifs et titrisées				
ACRES 2021-FL2 Issuer Ltd., "C", FLR, 7,115 %, 15/01/2037		998 000	943 375	0,21
Allegro CLO Ltd., 2014-1RA, "A2", FLR, 6,415 %, 21/10/2028		1 609 799	1 590 821	0,36
Allegro CLO Ltd., 2016-1A, "CR2", 6,792 %, 15/01/2030		3 725 053	3 592 836	0,81
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2020-FL1, "C", FLR, 6,647 %, 15/02/2035		1 298 500	1 275 278	0,29
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "C", FLR, 6,423 %, 15/12/2035		323 000	305 884	0,07
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "D", FLR, 7,373 %, 15/12/2035		296 500	276 584	0,06
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL2, "B", FLR, 6,054 %, 15/05/2036		371 500	351 989	0,08
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL4, "C", FLR, 6,754 %, 15/11/2036		1 095 000	1 046 358	0,24
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2022-FL1, "D", FLR, 7,278 %, 15/01/2037		2 933 500	2 759 335	0,62
AREIT 2019-CRE3 Trust, "A", FLR, 5,867 %, 14/09/2036		46 923	46 408	0,01
AREIT 2019-CRE3 Trust, "B", FLR, 6,147 %, 14/09/2036		764 500	735 714	0,17
AREIT 2019-CRE3 Trust, "C", FLR, 6,497 %, 14/09/2036		667 000	632 939	0,14
AREIT 2019-CRE3 Trust, "D", FLR, 7,247 %, 14/09/2036		656 000	612 934	0,14
AREIT 2022-CRE6 Trust, "B", FLR, 6,16 %, 16/01/2037		357 000	328 514	0,07
AREIT 2022-CRE6 Trust, "C", FLR, 6,46 %, 16/01/2037		736 500	685 428	0,16
AREIT 2022-CRE6 Trust, "D", FLR, 7,16 %, 17/12/2024		312 000	288 777	0,07
Bayview Commercial Asset Trust, 0 %, 25/12/2036		68 881	7	0,00
Bayview Financial Revolving Mortgage Loan Trust, FLR, 6,147 %, 28/12/2040		27 067	33 695	0,01
BDS 2021-FL7 Ltd., "B", FLR, 5,97 %, 16/06/2036		408 500	384 832	0,09
Brazos Securitization LLC, 5,413 %, 1/09/2052		1 024 000	1 073 788	0,24
BSPRT 2019-FL5 Issuer Ltd., "C", FLR, 6,454 %, 9/05/2029		990 000	965 774	0,22
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "C", FLR, 6,754 %, 15/12/2038		267 000	247 546	0,06
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "D", FLR, 7,204 %, 15/12/2038		304 000	283 227	0,06
Business Jet Securities LLC, 2020-1A, "A", 2,981 %, 15/11/2035		336 992	309 200	0,07
Business Jet Securities LLC, 2021-1A, "B", 2,918 %, 15/04/2036		155 543	135 511	0,03
BXMT 2020-FL2 Ltd., "B", FLR, 5,997 %, 15/02/2038		654 000	618 433	0,14
Capital Automotive, 2020-1A, "A4", REIT, 3,19 %, 15/02/2050		865 056	817 192	0,18
Citigroup Commercial Mortgage Trust, 2016-P6, "A5", 3,72 %, 10/12/2049		1 500 000	1 431 673	0,32
CLNC 2019-FL1 Ltd., "B", FLR, 6,497 %, 20/08/2035		670 000	643 780	0,15
CLNC 2019-FL1 Ltd., "C", FLR, 6,997 %, 20/08/2035		1 087 000	1 020 287	0,23
Commercial Mortgage Pass-Through Certificates, 2014-LC19 "A4", 3,183 %, 10/02/2048		3 819 000	3 675 555	0,83
Commercial Mortgage Trust, 2015-DC1, "A5", 3,35 %, 10/02/2048		4 044 000	3 895 036	0,88
Commercial Mortgage Trust, 2015-LC21, "A4", 3,708 %, 10/07/2048		1 901 154	1 834 371	0,41
Commercial Mortgage Trust, 2015-PC1, "A5", 3,902 %, 10/07/2050		3 754 051	3 651 866	0,82
Commercial Mortgage Trust, 2017-COR2, "A3", 3,51 %, 10/09/2050		3 410 000	3 228 855	0,73
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-3A, "C", 1,63 %, 16/09/2030		250 000	227 413	0,05
CSAIL Commercial Mortgage Trust, 2015-C2, "A4", 3,504 %, 15/06/2057		600 929	578 247	0,13
Cutwater 2014-1A Ltd., "BR", FLR, 7,192 %, 15/07/2026		102 367	101 802	0,02
Cutwater 2015-1A Ltd., "BR", FLR, 6,592 %, 15/01/2029		2 965 000	2 922 968	0,66
HarbourView CLO VII Ltd., 7RA, "B", FLR, 6,494 %, 18/07/2031		1 745 000	1 674 849	0,38
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp., 5,708 %, 15/07/2042		15 294	12 423	0,00
LCCM 2021-FL2 Trust, "C", FLR, 6,609 %, 13/12/2038		629 000	606 281	0,14
LoanCore 2018-CRE1 Ltd., "AS", FLR, 5,959 %, 15/05/2028		1 391 933	1 386 620	0,31
LoanCore 2018-CRE1 Ltd., "C", FLR, 7,009 %, 15/05/2028		620 000	602 667	0,14
LoanCore 2018-CRE1 Ltd., "C", FLR, 6,409 %, 15/04/2034		409 050	413 366	0,09
LoanCore 2018-CRE3 Ltd., "B", FLR, 6,059 %, 15/04/2034		558 450	559 539	0,13
LoanCore 2019-CRE2 Ltd., "D", FLR, 6,909 %, 15/05/2036		335 000	327 931	0,07
LoanCore 2019-CRE3 Ltd., "AS", FLR, 5,829 %, 15/04/2034		396 359	398 140	0,09
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "AS", FLR, 6,204 %, 15/07/2036		1 828 500	1 733 727	0,39
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "B", FLR, 6,454 %, 15/07/2036		662 500	625 819	0,14
LoanCore 2021-CRE6 Ltd., "B", FLR, 6,359 %, 15/11/2038		3 182 500	2 987 219	0,67
Madison Park Funding XLI Ltd., 2012-A, "B1R", FLR, 6,165 %, 22/04/2027		1 950 000	1 917 940	0,43
MF1 2020-FL4 Ltd., "AS", FLR, 6,697 %, 15/11/2035		1 097 500	1 096 143	0,25

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Créances adossées à des actifs et titrisées, suite				
MF1 2022-FL8 Ltd., "C", FLR, 6,509 %, 19/02/2037	USD	769 833	721 438	0,16
MF1 2022-FL8 Ltd., "D", FLR, 6,96 %, 19/02/2037		444 984	414 869	0,09
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, 2015-C21, "A4", 3,338 %, 15/03/2048		1 111 591	1 065 452	0,24
OneMain Financial Issuance Trust 2022-3A, "A", 5,94 %, 15/05/2034		986 000	994 560	0,23
Parallel 2015-1A Ltd., "C1R", FLR, 6,557 %, 20/07/2027		440 000	434 149	0,10
Parallel 2015-1A Ltd., "C2R", FLR, 6,558 %, 20/07/2027		470 000	461 270	0,10
Preferred Term Securities XIX Ltd., CDO, FLR, 5,119 %, 22/12/2035		210 146	188 102	0,04
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL7, "C", FLR, 6,705 %, 25/11/2036		425 000	399 977	0,09
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL7, "D", FLR, 7,456 %, 25/11/2036		505 000	466 553	0,11
Residential Funding Mortgage Securities, Inc., FGIC, 4,171 %, 25/12/2035		3 129	3 105	0,00
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "C", FLR, 6,57 %, 18/04/2038		652 500	611 545	0,14
Starwood Commercial Mortgage, 2022-FL3, "B", FLR, 6,229 %, 15/11/2038		439 000	418 189	0,09
Starwood Commercial Mortgage, 2022-FL3, "C", FLR, 6,478 %, 15/11/2038		831 500	778 838	0,18
TICP CLO 2018-IA Ltd., "A2", FLR, 6,321 %, 26/04/2028		1 809 935	1 791 690	0,40
UBS Commercial Mortgage Trust, 2017-C7, "A4", 3,679 %, 15/12/2050		2 000 000	1 897 160	0,43
UBS Commercial Mortgage Trust, 2017-C8, "A4", 3,983 %, 15/02/2051		1 926 975	1 839 234	0,42
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, 2015-C28, "A4", 3,54 %, 15/05/2048		2 448 036	2 363 541	0,53
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, 2016-C34, "A4", 3,096 %, 15/06/2049		1 500 000	1 412 031	0,32
			74 158 599	16,73
Industrie automobile				
Stellantis N.V., 2,691 %, 15/09/2031		2 000 000	1 611 935	0,36
Radio-télévision				
Discovery, Inc., 4,65 %, 15/05/2050		1 349 000	1 053 481	0,24
Prosus N.V., 3,68 %, 21/01/2030		1 791 000	1 549 214	0,35
Warnermedia Holdings, Inc., 5,05 %, 15/03/2042		1 714 000	1 463 471	0,33
Warnermedia Holdings, Inc., 5,141 %, 15/03/2052		1 537 000	1 276 571	0,29
Warnermedia Holdings, Inc., 5,391 %, 15/03/2062		615 000	511 771	0,11
WMG Acquisition Corp., 3 %, 15/02/2031		812 000	673 416	0,15
			6 527 924	1,47
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Charles Schwab Corp., 5 % jusqu'au 1/06/2027, FLR jusqu'au 1/06/2170		1 941 000	1 873 065	0,42
LPL Holdings, Inc., 4 %, 15/03/2029		1 278 000	1 143 810	0,26
Raymond James Financial, Inc., 4,95 %, 15/07/2046		845 000	814 688	0,19
			3 831 563	0,87
Construction				
Standard Industries, Inc., 4,375 %, 15/07/2030		1 491 000	1 274 612	0,29
Standard Industries, Inc., 3,375 %, 15/01/2031		775 000	615 519	0,14
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030		498 000	455 048	0,10
			2 345 179	0,53
Services aux entreprises				
Equinix, Inc., 1,8 %, 15/07/2027		1 000 000	875 734	0,20
Equinix, Inc., 2,15 %, 15/07/2030		1 748 000	1 452 035	0,33
Fiserv, Inc., 3,5 %, 1/07/2029		1 010 000	940 670	0,21
Global Payments, Inc., 2,9 %, 15/05/2030		1 542 000	1 323 413	0,30
Global Payments, Inc., 2,9 %, 15/11/2031		452 000	376 564	0,08
Iron Mountain, Inc., 4,5 %, 15/02/2031		1 325 000	1 135 379	0,26
			6 103 795	1,38
Télévision par câble				
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,5 %, 15/08/2030		875 000	747 653	0,17
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 4,908 %, 23/07/2025		623 000	619 798	0,14
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 6,384 %, 23/10/2035		848 000	867 272	0,20
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 5,25 %, 1/04/2053		2 566 000	2 154 891	0,49

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Télévision par câble, suite				
CSC Holdings LLC, 4,125 %, 1/12/2030	USD	875 000	646 861	0,15
CSC Holdings LLC, 4,5 %, 15/11/2031		910 000	670 197	0,15
Sirius XM Radio, Inc., 5,5 %, 1/07/2029		393 000	368 300	0,08
Sirius XM Radio, Inc., 4,125 %, 1/07/2030		1 010 000	866 206	0,19
Time Warner Cable, Inc., 4,5 %, 15/09/2042		1 136 000	903 522	0,20
Time Warner Entertainment Co. LP, 8,375 %, 15/07/2033		408 000	478 246	0,11
			8 322 946	1,88
Produits chimiques				
Axalta Coating Systems Ltd., 3,375 %, 15/02/2029		680 000	584 800	0,13
Logiciels				
Dell International LLC/EMC Corp., 5,3 %, 1/10/2029		1 088 000	1 098 335	0,25
Oracle Corp., 6,15 %, 9/11/2029		493 000	526 945	0,12
			1 625 280	0,37
Logiciels - Systèmes				
SS&C Technologies Holdings, Inc., 5,5 %, 30/09/2027		1 252 000	1 204 104	0,27
Conglomérats				
BWX Technologies, Inc., 4,125 %, 30/06/2028		523 000	472 011	0,11
Carrier Global Corp., 3,577 %, 5/04/2050		505 000	393 213	0,09
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		455 000	461 923	0,10
Regal Rexnord Corp., 6,3 %, 15/02/2030		1 388 000	1 415 292	0,32
Regal Rexnord Corp., 6,4 %, 15/04/2033		1 076 000	1 103 250	0,25
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,95 %, 15/09/2028		2 000 000	1 986 672	0,45
			5 832 361	1,32
Biens de consommation				
GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3,375 %, 24/03/2029		482 000	444 598	0,10
GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3,625 %, 24/03/2032		1 030 000	942 923	0,21
			1 387 521	0,31
Services de consommation				
Match Group Holdings II LLC, 3,625 %, 1/10/2031		1 236 000	991 890	0,23
Meituan, 3,05 %, 28/10/2030		831 000	676 261	0,15
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPFG, 0 %, 15/02/2026		562 000	454 202	0,10
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPFG, 0 %, 15/02/2029		1 629 000	1 064 208	0,24
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPFG, 0 %, 15/02/2031		562 000	318 841	0,07
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPFG, 0 %, 15/02/2043		1 869 912	519 045	0,12
			4 024 447	0,91
Conteneurs				
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. VI, 4,75 %, 1/02/2026		359 000	350 721	0,08
Équipements électriques				
Arrow Electronics, Inc., 2,95 %, 15/02/2032		1 540 000	1 277 418	0,29
Électronique				
Broadcom, Inc., 3,469 %, 15/04/2034		1 332 000	1 104 398	0,25
Broadcom, Inc., 3,137 %, 15/11/2035		1 195 000	927 746	0,21
Broadcom, Inc., 3,187 %, 15/11/2036		1 148 000	877 814	0,20
			2 909 958	0,66
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Indian Railway Finance Corp., 2,8 %, 10/02/2031		437 000	363 173	0,08
Énergie - Sociétés indépendantes				
Energean Israel Finance Ltd., 4,875 %, 30/03/2026		1 387 000	1 295 111	0,29
EQT Corp., 3,9 %, 1/10/2027		704 000	667 871	0,15
EQT Corp., 5 %, 15/01/2029		386 000	374 177	0,09
EQT Corp., 3,625 %, 15/05/2031		458 000	400 878	0,09
Leviathan Bond Ltd., 6,5 %, 30/06/2027		853 000	839 139	0,19
Leviathan Bond Ltd., 6,75 %, 30/06/2030		1 036 000	1 006 105	0,23
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 3,25 %, 15/08/2030		1 063 000	809 283	0,18
			5 392 564	1,22

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Énergie - Sociétés intégrées				
Eni S.p.A., 4,25 %, 9/05/2029	USD	938 000	891 242	0,20
Établissements financiers				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 6,5 %, 15/07/2025		1 206 000	1 228 070	0,28
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3 %, 29/10/2028		742 000	654 104	0,15
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,3 %, 30/01/2032		880 000	738 856	0,17
Air Lease Corp., 5,85 %, 15/12/2027		1 034 000	1 055 293	0,24
Avolon Holdings Funding Ltd., 5,25 %, 15/05/2024		1 444 000	1 426 644	0,32
Avolon Holdings Funding Ltd., 3,95 %, 1/07/2024		1 251 000	1 212 236	0,27
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,125 %, 21/02/2026		974 000	871 298	0,19
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,25 %, 15/04/2026		641 000	608 718	0,14
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,75 %, 21/02/2028		881 000	759 012	0,17
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		647 119	590 550	0,13
			9 144 781	2,06
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 5,45 %, 23/01/2039		638 000	668 092	0,15
JBS USA Lux S.A./JBS USA Finance, Inc., 5,5 %, 15/01/2030		1 935 000	1 880 336	0,43
PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, 3,541 %, 27/04/2032		1 662 000	1 391 925	0,31
			3 940 353	0,89
Jeux et hôtellerie				
Marriott International, Inc., 3,5 %, 15/10/2032		1 247 000	1 101 793	0,25
Assurances				
Corebridge Financial, Inc., 3,9 %, 5/04/2032		827 000	753 264	0,17
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042		121 000	104 999	0,02
Corebridge Financial, Inc., 4,4 %, 5/04/2052		352 000	301 423	0,07
			1 159 686	0,26
Assurances - Santé				
Humana, Inc., 5,875 %, 1/03/2033		1 465 000	1 567 812	0,35
Assurances IARD				
Allied World Assurance Co. Holdings Ltd., 4,35 %, 29/10/2025		1 553 000	1 501 752	0,34
Aon Corp., 3,75 %, 2/05/2029		1 080 000	1 025 557	0,23
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 2,6 %, 2/12/2031		198 000	167 877	0,04
Brown & Brown, Inc., 4,95 %, 17/03/2052		1 260 000	1 136 195	0,26
Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,85 %, 17/04/2028		1 945 000	1 889 183	0,42
Fairfax Financial Holdings Ltd., 3,375 %, 3/03/2031		375 000	318 906	0,07
Liberty Mutual Group, Inc., 3,951 %, 15/10/2050		1 209 000	938 025	0,21
			6 977 495	1,57
Machines et outils				
CNH Industrial Capital LLC, 4,2 %, 15/01/2024		306 000	303 280	0,07
CNH Industrial N.V., 3,85 %, 15/11/2027		467 000	453 828	0,10
			757 108	0,17
Grandes banques				
Bank of America Corp., 2,496 % jusqu'au 13/02/2030, FLR jusqu'au 13/02/2031		3 685 000	3 134 554	0,71
Bank of America Corp., 2,572 % jusqu'au 20/10/2031, FLR jusqu'au 20/10/2032		2 285 000	1 889 345	0,43
Bank of America Corp., 6,5 % jusqu'au 23/10/2024, FLR jusqu'au 23/10/2049		553 000	555 744	0,13
Bank of America Corp., 6,1 %, 29/12/2049		873 000	873 349	0,20
Bank of America Corp., 5,875 % jusqu'au 15/03/2028, FLR jusqu'au 31/12/2059		1 299 000	1 243 793	0,28
Barclays PLC, 4,375 %, 12/01/2026		521 000	510 483	0,11
Barclays PLC, 4,972 % jusqu'au 16/05/2028, FLR jusqu'au 16/05/2029		976 000	952 053	0,21
Barclays PLC, 2,894 % jusqu'au 24/11/2031, FLR jusqu'au 24/11/2032		1 203 000	982 081	0,22
Deutsche Bank AG, 2,311 % jusqu'au 16/11/2026, FLR jusqu'au 16/11/2027		1 616 000	1 428 255	0,32
Deutsche Bank AG, 6,72 % jusqu'au 18/01/2028, FLR jusqu'au 18/01/2029		2 333 000	2 454 863	0,55
HSBC Holdings PLC, 4,7 % jusqu'au 9/09/2031, FLR jusqu'au 9/09/2169		2 183 000	1 850 638	0,42
HSBC Holdings PLC, 4 % jusqu'au 9/09/2026, FLR jusqu'au 9/09/2170		862 000	772 783	0,17
JPMorgan Chase & Co., 4,203 % jusqu'au 23/07/2028, FLR jusqu'au 23/07/2029		1 320 000	1 273 636	0,29
JPMorgan Chase & Co., 2,739 % jusqu'au 15/10/2029, FLR jusqu'au 15/10/2030		1 100 000	961 414	0,22

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Grandes banques, suite				
JPMorgan Chase & Co., 2,956 % jusqu'au 13/05/2030, FLR jusqu'au 13/05/2031	USD	1 249 000	1 083 572	0,24
JPMorgan Chase & Co., 2,545 % jusqu'au 8/11/2031, FLR jusqu'au 8/11/2032		2 089 000	1 734 077	0,39
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2,048 %, 17/07/2030		1 852 000	1 519 905	0,34
Morgan Stanley, 3,125 %, 27/07/2026		965 000	914 586	0,21
Morgan Stanley, 2,699 % jusqu'au 22/01/2030, FLR jusqu'au 22/01/2031		179 000	155 332	0,03
Morgan Stanley, 2,511 % jusqu'au 20/10/2031, FLR jusqu'au 20/10/2032		2 040 000	1 684 748	0,38
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 2,13 %, 8/07/2030		2 514 000	2 078 180	0,47
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0,85 %, 25/03/2024		354 000	337 135	0,08
UBS Group AG, 4,375 % jusqu'au 10/02/2031, FLR jusqu'au 10/08/2171		2 526 000	2 071 067	0,47
UBS Group Funding (Jersey) Ltd., 4,125 %, 24/09/2025		2 083 000	2 040 293	0,46
Wells Fargo & Co., 2,572 % jusqu'au 11/02/2030, FLR jusqu'au 11/02/2031		1 693 000	1 458 996	0,33
Westpac Banking Corp., 2,894 % jusqu'au 4/02/2025, FLR jusqu'au 4/02/2030		756 000	705 618	0,16
			34 666 500	7,82
Technologies et services médicaux et de santé				
Adventist Health System/West, 5,43 %, 1/03/2032		1 339 000	1 368 024	0,31
Alcon Finance Corp., 2,6 %, 27/05/2030		436 000	381 258	0,09
Alcon Finance Corp., 5,375 %, 6/12/2032		393 000	411 253	0,09
Alcon, Inc., 2,75 %, 23/09/2026		419 000	389 469	0,09
Alcon, Inc., 3 %, 23/09/2029		1 178 000	1 052 332	0,24
DaVita, Inc., 4,625 %, 1/06/2030		860 000	724 550	0,16
HCA, Inc., 5,25 %, 15/06/2026		349 000	349 409	0,08
HCA, Inc., 4,375 %, 15/03/2042		1 040 000	884 632	0,20
HCA, Inc., 4,625 %, 15/03/2052		685 000	577 779	0,13
Northwell Healthcare, Inc., 3,979 %, 1/11/2046		396 000	319 676	0,07
ProMedica Toledo Hospital, "B", 5,325 %, 15/11/2028		2 461 000	2 007 820	0,45
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,75 %, 15/11/2038		969 000	975 445	0,22
Tower Health, 4,451 %, 1/02/2050		2 362 000	1 102 841	0,25
			10 544 488	2,38
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 2,25 %, 17/03/2028		873 000	763 709	0,17
Anglo American Capital PLC, 3,875 %, 16/03/2029		1 161 000	1 081 304	0,24
Anglo American Capital PLC, 2,875 %, 17/03/2031		1 020 000	876 092	0,20
Anglo American Capital PLC, 4,75 %, 16/03/2052		1 461 000	1 324 489	0,30
FMG Resources Ltd., 4,375 %, 1/04/2031		903 000	794 640	0,18
Glencore Funding LLC, 4,125 %, 30/05/2023		880 000	877 093	0,20
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031		1 289 000	1 103 975	0,25
Novelis Corp., 3,25 %, 15/11/2026		141 000	127 650	0,03
Novelis Corp., 3,875 %, 15/08/2031		545 000	459 980	0,10
			7 408 932	1,67
Secteur intermédiaire				
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, 31/12/2039		1 209 000	990 873	0,22
Cheniere Energy Partners LP, 4,5 %, 1/10/2029		613 000	575 067	0,13
Enbridge, Inc., 4,25 %, 1/12/2026		562 000	550 425	0,12
Energy Transfer LP, 5,55 %, 15/02/2028		454 000	461 368	0,10
Energy Transfer LP, 5,75 %, 15/02/2033		1 154 000	1 185 966	0,27
Kinder Morgan Energy Partners LP, 5,4 %, 1/09/2044		1 440 000	1 374 930	0,31
MPLX LP, 4,95 %, 14/03/2052		2 025 000	1 794 738	0,41
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp., 3,55 %, 15/12/2029		3 009 000	2 706 282	0,61
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,5 %, 15/05/2030		684 000	663 955	0,15
Targa Resources Corp., 4,2 %, 1/02/2033		298 000	270 063	0,06
Targa Resources Corp., 6,125 %, 15/03/2033		1 842 000	1 921 515	0,43
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		491 000	420 416	0,10
Venture Global Calcasieu Pass LLC , 6,25 %, 15/01/2030		1 301 000	1 325 433	0,30
			14 241 031	3,21

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 2,41 %, 1/05/2023	USD	281 959	279 244	0,06
Fannie Mae, 5 %, 1/07/2023–1/03/2042		745 646	765 986	0,18
Fannie Mae, 5,5 %, 1/03/2024–1/04/2040		770 336	805 611	0,18
Fannie Mae, 4,5 %, 1/05/2024–1/06/2044		2 443 847	2 473 458	0,56
Fannie Mae, 4,54 %, 1/07/2026		558 662	564 598	0,13
Fannie Mae, 3,95 %, 1/01/2027		111 643	111 018	0,03
Fannie Mae, 3 %, 1/11/2028–1/10/2046		1 567 419	1 477 842	0,35
Fannie Mae, 2,5 %, 1/11/2031–1/11/2046		289 960	259 954	0,06
Fannie Mae, 6,5 %, 1/01/2033		1 236	1 288	0,00
Fannie Mae, 3 %, 25/02/2033(i)		132 821	12 064	0,00
Fannie Mae, 6 %, 1/09/2034–1/06/2038		260 243	273 630	0,04
Fannie Mae, 3,5 %, 1/04/2038–1/04/2049		2 558 501	2 460 670	0,55
Fannie Mae, 3,25 %, 25/05/2040		41 256	39 069	0,01
Fannie Mae, 4 %, 1/09/2040–1/07/2048		4 007 489	3 942 621	0,88
Fannie Mae, 2 %, 25/10/2040–25/04/2046		81 563	75 090	0,02
Fannie Mae, 4 %, 25/07/2046 (i)		134 467	25 448	0,01
Fannie Mae, UMBS, 2 %, 1/06/2037–1/03/2052		11 754 500	10 131 551	2,31
Fannie Mae, UMBS, 2,5 %, 1/08/2037–1/07/2052		20 177 439	17 851 211	3,99
Fannie Mae, UMBS, 1,5 %, 1/02/2042		43 523	36 269	0,01
Fannie Mae, UMBS, 5,5 %, 1/05/2044–1/11/2052		1 183 820	1 209 835	0,28
Fannie Mae, UMBS, 3,5 %, 1/05/2049–1/06/2052		1 522 910	1 435 770	0,33
Fannie Mae, UMBS, 3 %, 1/06/2051–1/11/2052		1 873 957	1 720 981	0,38
Fannie Mae, UMBS, 4,5 %, 1/09/2052–1/01/2053		244 828	242 599	0,06
Freddie Mac, 3,06 %, 25/07/2023		228 000	225 952	0,05
Freddie Mac, 3,531 %, 25/07/2023		420 118	416 725	0,09
Freddie Mac, 3,458 %, 25/08/2023		797 785	790 876	0,18
Freddie Mac, 2,67 %, 25/12/2024		1 482 000	1 432 210	0,32
Freddie Mac, 2,811 %, 25/01/2025		887 963	859 419	0,19
Freddie Mac, 4 %, 1/07/2025–1/01/2041		359 594	356 063	0,07
Freddie Mac, 4,5 %, 1/07/2025–1/05/2042		624 189	634 257	0,14
Freddie Mac, 3 %, 15/06/2028–1/10/2046		3 731 604	3 489 436	0,79
Freddie Mac, 4,06 %, 25/10/2028		512 000	511 070	0,12
Freddie Mac, 6 %, 1/08/2034–1/11/2037		16 239	16 987	0,00
Freddie Mac, 5,5 %, 1/06/2035–1/01/2038		57 779	60 186	0,00
Freddie Mac, 5 %, 1/11/2035–1/07/2041		315 328	324 625	0,08
Freddie Mac, 5,5 %, 15/02/2036 (i)		25 465	4 117	0,00
Freddie Mac, 3,5 %, 1/11/2037–1/11/2047		2 938 845	2 826 201	0,63
Freddie Mac, 4,5 %, 15/12/2040 (i)		19 942	1 758	0,00
Freddie Mac, UMBS, 3 %, 1/11/2034–1/04/2052		2 052 466	1 899 111	0,43
Freddie Mac, UMBS, 2 %, 1/03/2037–1/05/2052		10 651 590	9 063 160	2,05
Freddie Mac, UMBS, 2,5 %, 1/08/2040–1/03/2052		2 786 444	2 462 316	0,56
Freddie Mac, UMBS, 3,5 %, 1/12/2046–1/05/2052		499 603	475 855	0,11
Freddie Mac, UMBS, 6 %, 1/12/2052		924 130	964 595	0,22
Ginnie Mae, 6 %, 20/01/2036–21/02/2053		486 559	499 343	0,10
Ginnie Mae, 5,5 %, 15/04/2038–20/12/2052		1 094 829	1 117 924	0,25
Ginnie Mae, 4,5 %, 15/04/2039–20/12/2052		3 871 963	3 867 109	0,88
Ginnie Mae, 4 %, 20/10/2040–20/10/2052		2 194 140	2 135 068	0,47
Ginnie Mae, 3,5 %, 15/12/2041–20/10/2052		2 302 418	2 211 562	0,51
Ginnie Mae, 3 %, 20/11/2044–20/10/2052		4 480 043	4 140 559	0,95
Ginnie Mae, 2,5 %, 20/08/2051–20/05/2052		3 399 021	3 032 414	0,70
Ginnie Mae, 2 %, 20/03/2052–20/04/2052		1 424 858	1 231 213	0,28
Ginnie Mae, 5 %, 20/09/2052–20/11/2052		3 307 787	3 331 567	0,75
UMBS, TBA, 5,5 %, 13/02/2053		775 000	787 533	0,18
UMBS, TBA, 5 %, 13/04/2053		550 000	551 332	0,12
			95 916 350	21,64

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations municipales				
Bridgeview, IL, Stadium and Redevelopment Projects, Taxable, AAC, 5,06 %, 1/12/2025	USD	175 000	169 933	0,04
Bridgeview, IL, Stadium and Redevelopment Projects, Taxable, AAC, 5,14 %, 1/12/2036		2 640 000	2 410 914	0,54
Escambia County, FL, Health Facilities Authority Rev., Taxable (Baptist Health Care Corp.), "B", AGM, 3,607 %, 15/08/2040		490 000	393 604	0,09
New Jersey Economic Development Authority State Pension Funding Rev., Appréciation du capital, Taxable "B", AGM, 0 %, 15/02/2023		3 453 000	3 446 895	0,78
New Jersey Economic Development Authority State Pension Funding Rev., Taxable, "A", NPFG, 7,425 %, 15/02/2029		2 543 000	2 794 209	0,63
Oklahoma Development Finance Authority, Health System Rev., Taxable (OU Medicine Project), "C", 5,45 %, 15/08/2028 923 000		755 606	0,17	
Philadelphia, PA, School District, Taxable, "B", AGM, 6,615 %, 1/06/2030		945 000	1 028 745	0,23
Philadelphia, PA, School District, Taxable, "B", AGM, 6,765 %, 1/06/2040		640 000	742 322	0,17
State of Florida, Taxable, "A", 2,154 %, 1/07/2030		3 024 000	2 536 296	0,57
			14 278 524	3,22
Gaz naturel - Distribution				
NiSource, Inc., 3,6 %, 1/05/2030		833 000	770 396	0,17
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
Bangkok Bank (Hong Kong), 3,733 % jusqu'au 25/09/2029, FLR jusqu'au 25/09/2034		1 279 000	1 123 499	0,25
Discover Financial Services, 6,7 %, 29/11/2032		2 233 000	2 383 689	0,54
Groupe BPCE S.A., 4,5 %, 15/03/2025		942 000	917 202	0,21
Macquarie Bank Ltd. of London, 6,125 % jusqu'au 8/03/2027, FLR jusqu'au 31/12/2165		991 000	912 242	0,21
Macquarie Group Ltd., 4,442 % jusqu'au 21/06/2032, FLR jusqu'au 21/06/2033		2 923 000	2 662 501	0,60
			7 999 133	1,81
Produits pharmaceutiques				
Jazz Securities DAC, 4,375 %, 15/01/2029		1 250 000	1 140 425	0,26
Organon Finance 1 LLC, 4,125 %, 30/04/2028		850 000	768 783	0,17
			1 909 208	0,43
Immobilier - Bureaux				
Boston Properties Ltd. LP, REIT, 2,55 %, 1/04/2032		2 558 000	2 019 130	0,46
Produits chimiques spéciaux				
International Flavors & Fragrances, Inc., 2,3 %, 1/11/2030		1 341 000	1 111 447	0,25
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		1 000 000	818 220	0,19
Penske Automotive Group Co., 3,75 %, 15/06/2029		1 009 000	853 242	0,19
			1 671 462	0,38
Télécommunications mobiles				
Crown Castle International Corp., REIT, 4 %, 1/03/2027		226 000	219 209	0,05
Crown Castle, Inc., REIT, 3,7 %, 15/06/2026		506 000	488 181	0,11
Crown Castle, Inc., REIT, 3,25 %, 15/01/2051		52 000	37 191	0,01
Rogers Communications, Inc., 4,5 %, 15/03/2042		1 968 000	1 712 003	0,39
Rogers Communications, Inc., 4,55 %, 15/03/2052		1 968 000	1 654 262	0,37
SBA Communications Corp., 3,125 %, 1/02/2029		1 035 000	876 834	0,20
T-Mobile USA, Inc., 2,55 %, 15/02/2031		4 398 000	3 733 655	0,84
T-Mobile USA, Inc., 4,375 %, 15/04/2040		87 000	78 720	0,02
			8 800 055	1,99
Tabac				
B.A.T. Capital Corp., 3,222 %, 15/08/2024		668 000	649 771	0,15
B.A.T. Capital Corp., 4,906 %, 2/04/2030		215 000	203 650	0,05
B.A.T. Capital Corp., 4,742 %, 16/03/2032		1 793 000	1 657 384	0,37
B.A.T. International Finance PLC, 4,448 %, 16/03/2028		1 731 000	1 656 733	0,37
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 17/11/2027		642 000	656 145	0,15
Philip Morris International, Inc., 5,625 %, 17/11/2029		276 000	288 259	0,06
			5 111 942	1,15

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
Transports - Services				
Element Fleet Management Corp., 1,6 %, 6/04/2024	USD	846 000	806 770	0,18
ERAC USA Finance LLC, 7 %, 15/10/2037		1 000 000	1 162 975	0,27
			1 969 745	0,45
Sociétés publiques fédérales américaines et sociétés similaires				
Small Business Administration, 4,35 %, 1/07/2023		244	242	0,00
Small Business Administration, 4,98 %, 1/11/2023		394	391	0,00
Small Business Administration, 4,89 %, 1/12/2023		472	466	0,00
Small Business Administration, 4,93 %, 1/01/2024		231	229	0,00
Small Business Administration, 4,34 %, 1/03/2024		660	655	0,00
Small Business Administration, 5,52 %, 1/06/2024		422	422	0,00
Small Business Administration, 5,19 %, 1/07/2024		505	497	0,00
Small Business Administration, 4,86 %, 1/10/2024		524	519	0,00
Small Business Administration, 4,57 %, 1/06/2025		3 046	3 029	0,00
Small Business Administration, 4,76 %, 1/09/2025		7 808	7 609	0,00
Small Business Administration, 5,35 %, 1/02/2026		7 025	6 944	0,00
Small Business Administration, 4,43 %, 1/05/2029		49 696	48 750	0,01
Small Business Administration, 3,25 %, 1/11/2030		69 871	66 467	0,02
Small Business Administration, 2,85 %, 1/09/2031		128 242	120 412	0,03
Small Business Administration, 2,37 %, 1/08/2032		155 410	143 366	0,03
Small Business Administration, 2,13 %, 1/01/2033		349 721	320 754	0,07
Small Business Administration, 2,21 %, 1/02/2033		103 123	94 975	0,02
Small Business Administration, 2,22 %, 1/03/2033		323 458	297 514	0,07
Small Business Administration, 2,08 %, 1/04/2033		465 349	427 376	0,10
Small Business Administration, 2,45 %, 1/06/2033		434 227	401 781	0,09
Small Business Administration, 3,62 %, 1/09/2033		112 914	110 226	0,02
			2 052 624	0,46
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 3,5 %, 15/02/2039		4 146 000	4 102 921	0,93
Obligations du Trésor américain, 1,125 %, 15/08/2040		4 000 000	2 654 062	0,60
Obligations du Trésor américain, 1,375 %, 15/11/2040		3 500 000	2 421 973	0,55
Obligations du Trésor américain, 1,75 %, 15/08/2041		4 700 000	3 424 023	0,77
Obligations du Trésor américain, 2,375 %, 15/02/2042		4 900 000	3 964 023	0,89
Obligations du Trésor américain, 4 %, 15/11/2042		2 400 000	2 480 250	0,56
Obligations du Trésor américain, 2,875 %, 15/11/2046		2 800 000	2 410 516	0,54
Obligations du Trésor américain, 1,625 %, 15/11/2050		10 000 000	6 467 969	1,46
Bons du Trésor américain, 2,25 %, 31/03/2024		5 000 000	4 862 305	1,10
Bons du Trésor américain, 4,25 %, 30/09/2024 (g)		18 000 000	17 959 219	4,05
Bons du Trésor américain, 2,5 %, 31/03/2027		8 500 000	8 109 863	1,83
			58 857 124	13,28
Services publics - Énergie électrique				
AEP Transmission Co. LLC, 4 %, 1/12/2046		1 207 000	1 022 233	0,23
American Electric Power Co., Inc., 5,95 %, 1/11/2032		1 106 000	1 188 692	0,27
Calpine Corp., 3,75 %, 1/03/2031		790 000	658 590	0,15
Enel Finance International N.V., 3,5 %, 6/04/2028		2 146 000	1 964 875	0,44
FirstEnergy Corp., 2,65 %, 1/03/2030		1 000 000	854 440	0,19
FirstEnergy Corp., 5,1 %, 15/07/2047		456 000	420 660	0,09
FirstEnergy Corp., 3,4 %, 1/03/2050		879 000	624 450	0,14
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		1 708 000	1 445 461	0,33
Pacific Gas & Electric Co., 3 %, 15/06/2028		847 000	757 376	0,17
Pacific Gas & Electric Co., 3,3 %, 1/08/2040		2 024 000	1 452 614	0,33
			10 389 391	2,34
Total des obligations (coût identifié, 474 644 444 $)			**434 211 773**	**97,97**

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 2 751 000 $)	USD	2 751 000	2 751 000	0,62
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 477 395 444 $)			436 962 773	98,59
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			6 268 089	1,41
ACTIF NET			443 230 862	100,00

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

MFS Meridian Funds - U.S. Value Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
General Dynamics Corp.	168 020	39 158 741	1,78
Honeywell International, Inc.	232 022	48 371 947	2,19
Northrop Grumman Corp.	109 499	49 059 932	2,22
Raytheon Technologies Corp.	146 548	14 632 818	0,66
		151 223 438	6,85
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	756 631	32 834 988	1,49
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
BlackRock, Inc.	36 005	27 335 356	1,24
Citigroup, Inc.	534 916	27 933 313	1,27
KKR & Co., Inc.	245 422	13 697 002	0,62
NASDAQ, Inc.	603 399	36 318 586	1,64
		105 284 257	4,77
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	143 229	39 968 052	1,81
Equifax, Inc.	130 513	28 999 989	1,32
		68 968 041	3,13
Télévision par câble			
Charter Communications, Inc., "A"	61 653	23 693 865	1,07
Comcast Corp., "A"	1 326 455	52 196 004	2,37
		75 889 869	3,44
Produits chimiques			
PPG Industries, Inc.	201 371	26 246 696	1,19
Construction			
Masco Corp.	235 364	12 521 365	0,57
Otis Worldwide Corp.	85 744	7 050 729	0,32
Sherwin-Williams Co.	98 247	23 244 258	1,05
		42 816 352	1,94
Biens de consommation			
International Flavors & Fragrances, Inc.	80 836	9 090 817	0,41
Kimberly-Clark Corp.	135 712	17 643 917	0,80
Reckitt Benckiser Group PLC	138 879	9 889 816	0,45
		36 624 550	1,66
Équipements électriques			
Johnson Controls International PLC	463 086	32 216 893	1,46
Électronique			
Analog Devices, Inc.	97 053	16 641 678	0,75
KLA Corp.	68 459	26 868 788	1,22
NXP Semiconductors N.V.	133 012	24 515 442	1,11

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Électronique, suite			
Texas Instruments, Inc.	302 724	53 645 720	2,43
		121 671 628	5,51
Énergie - Sociétés indépendantes			
ConocoPhillips	389 140	47 424 492	2,15
EOG Resources, Inc.	154 179	20 390 173	0,92
Pioneer Natural Resources Co.	152 489	35 125 841	1,59
		102 940 506	4,66
Alimentation et boissons			
Archer Daniels Midland Co.	84 072	6 965 365	0,32
Nestlé S.A.	276 533	33 745 723	1,53
PepsiCo, Inc.	112 876	19 304 054	0,87
		60 015 142	2,72
Jeux et hôtellerie			
Marriott International, Inc., "A"	146 679	25 548 548	1,16
Organisations de soins de santé intégrés			
Cigna Corp.	194 735	61 666 732	2,79
Assurances			
Aon PLC	170 676	54 391 028	2,46
Chubb Ltd.	217 772	49 540 952	2,25
Marsh & McLennan Cos., Inc.	295 652	51 712 491	2,34
Progressive Corp.	381 793	52 057 475	2,36
Travelers Cos., Inc.	189 339	36 186 470	1,64
		243 888 416	11,05
Machines et outils			
Eaton Corp. PLC	192 015	31 146 753	1,41
Illinois Tool Works, Inc.	152 095	35 900 504	1,63
PACCAR, Inc.	106 174	11 605 880	0,52
Trane Technologies PLC	109 254	19 569 576	0,89
		98 222 713	4,45
Grandes banques			
Goldman Sachs Group, Inc.	34 211	12 514 726	0,57
JPMorgan Chase & Co. (g)	604 500	84 605 820	3,83
Morgan Stanley	453 660	44 154 728	2,00
PNC Financial Services Group, Inc.	145 115	24 006 374	1,09
		165 281 648	7,49
Technologies et services médicaux et de santé			
McKesson Corp.	88 914	33 669 954	1,53
Équipements médicaux			
Abbott Laboratories	295 348	32 650 721	1,48
Boston Scientific Corp.	553 682	25 607 793	1,16
Danaher Corp.	66 411	17 557 740	0,80
Medtronic PLC	285 930	23 929 482	1,08
Thermo Fisher Scientific, Inc.	76 158	43 435 192	1,97
		143 180 928	6,49
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
American Express Co.	210 057	36 745 271	1,66
Moody's Corp.	45 987	14 842 305	0,67
Truist Financial Corp.	262 375	12 958 701	0,59
		64 546 277	2,92
Produits pharmaceutiques			
Johnson & Johnson	379 566	62 028 675	2,81
Merck & Co., Inc.	380 580	40 878 098	1,85
Pfizer, Inc.	1 088 881	48 084 985	2,18
Roche Holding AG	24 527	7 665 506	0,35
		158 657 264	7,19

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

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché ($)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Chemins de fer et transport maritime				
Canadian National Railway Co.		109 671	13 060 720	0,59
Union Pacific Corp.		179 791	36 711 524	1,67
			49 772 244	2,26
Immobilier				
Prologis, Inc., REIT		194 446	25 137 979	1,14
Public Storage, Inc., REIT		28 347	8 627 126	0,39
			33 765 105	1,53
Produits chimiques spéciaux				
DuPont de Nemours, Inc.		437 732	32 370 281	1,47
Magasins spécialisés				
Lowe's Cos., Inc.		207 077	43 123 785	1,96
Target Corp.		178 578	30 740 417	1,39
			73 864 202	3,35
Services publics - Énergie électrique				
American Electric Power Co., Inc.		134 787	12 664 586	0,57
Dominion Energy, Inc.		482 275	30 691 981	1,39
Duke Energy Corp.		427 499	43 797 273	1,99
Services publics - Énergie électrique, suite				
Exelon Corp.		183 261	7 731 782	0,35
Southern Co.		549 471	37 188 197	1,69
Xcel Energy, Inc.		193 290	13 292 553	0,60
			145 366 372	6,59
Total des actions ordinaires (coût identifié, 1 742 785 244 $)			2 186 533 044	99,09
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Freddie Mac, 4,11 %, 1/02/2023 (coût identifié, 20 169 000 $)	USD	20 169 000	20 169 000	0,91
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 1 762 954 244 $) (k)			2 206 702 044	100,00
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			(26 840)	(0,00)
ACTIF NET			2 206 675 204	100,00

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

Notes de bas de page des Tableaux des investissements :

Imposable : Titre non exonéré des impôts fédéraux américains

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

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

(d) En défaut.

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

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

(k) Au 31 janvier 2023, les compartiments suivants détenaient des titres qui étaient valorisés à leur juste valeur conformément aux politiques adoptées par le Conseil d'administration :

Compartiment	Valeur de marché	% de la valeur totale de marché du compartiment	Nombre de titres
Asia Ex-Japan Fund	33 747 269 $	66,12 %	42
Blended Research European Equity Fund	7 506 979 €	90,59 %	68
Continental European Equity Fund	17 146 017 €	89,50 %	41
Contrarian Value Fund	142 579 136 $	54,15 %	19
Diversified Income Fund	6 522 019 $	7,46 %	45
Emerging Markets Debt Fund	1 669 949 $	0,07 %	1
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	35 711 $	0,14 %	1
Emerging Markets Equity Fund	45 934 880 $	55,53 %	48
Emerging Markets Equity Research Fund	1 541 511 $	52,17 %	37
European Core Equity Fund	102 243 035 €	79,79 %	58
European Research Fund	1 996 903 173 €	90,03 %	66
European Smaller Companies Fund	173 464 456 €	57,45 %	57
European Value Fund	3 116 329 914 €	79,00 %	49
Global Concentrated Fund	233 953 748 $	35,00 %	9
Global Equity Fund	1 261 866 798 $	36,78 %	35
Global Equity Income Fund	1 901 854 $	38,21 %	40
Global High Yield Fund	3 862 773 $	1,64 %	7
Global Intrinsic Value Fund	35 789 769 $	37,41 %	48
Global New Discovery Fund	2 162 680 $	35,46 %	43
Global Research Focused Fund	30 060 129 $	21,83 %	11
Global Strategic Equity Fund	715 589 $	29,83 %	11
Global Total Return Fund	354 040 856 $	20,92 %	63
Japan Equity Fund	365 624 565 ¥	98,56 %	54
Managed Wealth Fund	5 280 202 $	28,54 %	62
Prudent Capital Fund	1 331 487 986 $	36,02 %	28
Prudent Wealth Fund	1 473 666 313 $	41,42 %	42
U.K. Equity Fund	18 440 882 £	84,92 %	37
U.S. Concentrated Growth Fund	8 978 701 $	1,97 %	1
U.S. Growth Fund	610 636 $	1,33 %	1
U.S. Value Fund	51 301 045 $	2,32 %	3

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

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

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

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

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

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2023

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

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

Voir les notes aux états financiers

BILANS	Asia Ex-Japan Fund $	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund $	Diversified Income Fund $	Emerging Markets Debt Fund $	Emerging Markets Debt Local Currency Fund $	Emerging Markets Equity Fund $
Actif :								
Placements, à leur valeur	51 036 263	8 286 376	19 158 561	263 309 659	87 408 455	2 240 301 872	26 159 975	82 718 807
Accords de mise en pension (Note 12)	24 000	—	—	587 000	260 000	4 913 000	105 000	75 000
Numéraire et autres liquidités	956	20 555	47 562	—	8 243	3 589 937	372 512	178 077
Numéraire soumis à restrictions (Note 2)	—	—	—	—	82 508	10 000	920	—
Dépôts auprès des courtiers (Note 2)	—	—	—	—	9 167	3 590 331	101 741	—
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	—	—	—	23 928	1 706 717	261 692	—
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	—	101	59	8 083	52	17 331	1	9
Créances découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	—	—	2 475	53 840	1 422	—
Créances pour actions de fonds vendues	82 815	44	829 663	7 047 590	68 945	9 810 218	74 619	372 847
Créances pour placements vendus	434 917	—	—	4 479 110	354 187	11 964 649	159 220	842 283
Intérêts et dividendes à recevoir	173 475	21 729	39 117	135 552	684 239	28 249 986	393 989	404 882
Intérêts à recevoir sur contrats de swap	—	—	—	—	—	—	6 000	—
Créances à recevoir des parties liées (Note 5)	28 868	43 499	35 294	33 444	35 422	—	29 614	31 781
Créances à recevoir des courtiers	—	—	—	—	—	—	5 326	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	2 835	—
Autres actifs	323	102	157	1 131	566	8 649	220	471
Actif total	**51 781 617**	**8 372 406**	**20 110 413**	**275 601 569**	**88 938 187**	**2 304 216 530**	**27 675 086**	**84 624 157**
Passif :								
Engagements envers le dépositaire (cash overdraft)	—	—	—	2 683	—	—	—	10 398
Distributions à payer	—	—	—	—	46 869	1 387 681	12 441	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	—	—	—	24 891	1 322 108	214 936	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	—	208	3 128	1 757	522	57 913	582	921
Engagements découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	—	—	—	—	—	—
Engagements pour placements achetés	427 862	—	850 294	10 126 833	344 940	36 138 435	442 695	1 478 333
Engagements pour actions de fonds rachetées	373 821	1 965	2 367	3 481 351	84 276	2 475 638	102	2 563
Engagements au titre de l'impôt sur les plus-values	50 977	—	—	—	1 251	—	—	145 426
Intérêts payables sur contrats de swap	—	—	—	—	—	7 541	6 059	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	82 152	—	—
Options vendues, à leur valeur	—	—	—	—	1 653	—	—	—
Engagements envers les parties liées (Note 5)	—	—	—	—	—	72 692	—	—
Passifs transitoires et autres engagements	162 104	110 848	96 239	123 914	187 234	565 228	132 054	186 455
Passif total	**1 014 764**	**113 021**	**952 028**	**13 736 538**	**691 636**	**42 109 388**	**808 869**	**1 824 096**
Actif net total	**50 766 853**	**8 259 385**	**19 158 385**	**261 865 031**	**88 246 551**	**2 262 107 142**	**26 866 217**	**82 800 061**

Voir les notes aux états financiers

BILANS	Emerging Markets Equity Research Fund $	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund $	Global Credit Fund $
Actif :								
Placements, à leur valeur	2 954 685	75 699 804	128 136 297	2 218 073 136	301 918 462	3 944 883 930	668 400 009	78 469 965
Accords de mise en pension (Note 12)	5 000	—	—	—	—	—	335 000	99 000
Numéraire et autres liquidités	132	222 425	320 292	11 096 375	6 184 619	11 137 645	567	25 887
Numéraire soumis à restrictions (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	—
Dépôts auprès des courtiers (Note 2)	—	674 120	—	—	—	—	—	638 743
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	41 886	—	—	—	—	—	30 067
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	3	—	381	16 571	1 781	102 813	104	4
Créances découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	—	—	—	—	—	—
Créances pour actions de fonds vendues	—	79 221	124 074	10 934 642	3 119 843	13 117 695	780 322	2 717
Créances pour placements vendus	—	87 505	—	2 767 119	—	4 486 710	—	97 179
Intérêts et dividendes à recevoir	9 689	650 318	264 469	5 660 309	1 267 646	7 472 904	741 516	733 896
Intérêts à recevoir sur contrats de swap	—	—	—	—	—	—	—	—
Créances à recevoir des parties liées (Note 5)	12 772	33 419	23 148	—	—	—	—	34 073
Créances à recevoir des courtiers	—	60 690	—	—	—	—	—	48 578
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	—	—
Autres actifs	58	483	753	9 555	1 480	16 500	2 950	493
Actif total	**2 982 339**	**77 549 871**	**128 869 414**	**2 248 557 707**	**312 493 831**	**3 981 218 197**	**670 260 468**	**80 180 602**
Passif :								
Engagements envers le dépositaire (cash overdraft)	—	—	—	—	—	—	—	—
Distributions à payer	—	—	—	—	—	—	—	2 771
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	5 798	—	—	—	—	—	60 633
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	195	—	669	162 738	417	12 924	1 450	187
Engagements découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	9 332	—	—	—	—	—	14 185
Engagements pour placements achetés	7 639	199 640	—	3 444 754	—	1 729 627	—	216 895
Engagements pour actions de fonds rachetées	—	13 608	8 828	3 433 450	1 064 561	14 742 383	2 477 454	10 000
Engagements au titre de l'impôt sur les plus-values	890	—	—	—	—	—	—	—
Intérêts payables sur contrats de swap	—	42 663	—	—	—	—	—	45 089
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	—	—
Options vendues, à leur valeur	—	—	—	—	—	—	—	—
Engagements envers les parties liées (Note 5)	—	—	—	109 742	514	292 620	46 147	—
Passifs transitoires et autres engagements	96 689	106 529	153 971	606 352	247 909	885 359	245 718	114 947
Passif total	**105 413**	**377 570**	**163 468**	**7 757 036**	**1 313 401**	**17 662 913**	**2 770 769**	**464 707**
Actif net total	**2 876 926**	**77 172 301**	**128 705 946**	**2 240 800 671**	**311 180 430**	**3 963 555 284**	**667 489 699**	**79 715 895**

Voir les notes aux états financiers

BILANS	Global Equity Fund $	Global Equity Income Fund $	Global High Yield Fund $	Global Intrinsic Value Fund $	Global New Discovery Fund $	Global Opportunistic Bond Fund $	Global Research Focused Fund $	Global Strategic Equity Fund (b) $
Actif :								
Placements, à leur valeur	3 430 469 697	4 977 235	236 043 189	95 662 746	6 098 984	348 665 702	137 669 666	2 398 529
Accords de mise en pension (Note 12)	778 000	4 000	318 000	78 000	7 000	539 000	30 000	67 000
Numéraire et autres liquidités	—	11 864	134 347	677	19 834	57 517	562	660
Numéraire soumis à restrictions (Note 2)	—	—	—	—	—	2 309 996	—	—
Dépôts auprès des courtiers (Note 2)	—	—	37 895	—	—	4 411 731	—	—
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	—	7 995	—	—	1 270 758	—	—
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	6 526	7	17	122	14	1 161	2 166	3
Créances découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	—	—	—	—	—	—
Créances pour actions de fonds vendues	7 151 290	346 750	433 994	33 862	—	986 094	9 087	—
Créances pour placements vendus	—	243	88 978	13 414	32 933	1 869 302	—	—
Intérêts et dividendes à recevoir	4 563 304	9 493	3 257 217	75 509	3 310	2 763 099	183 348	2 174
Intérêts à recevoir sur contrats de swap	—	—	—	—	—	—	—	—
Créances à recevoir des parties liées (Note 5)	—	39 665	—	36 281	31 409	—	19 381	19 994
Créances à recevoir des courtiers	—	—	—	—	—	102 761	—	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	—	—
Autres actifs	13 766	73	1 243	609	95	1 603	780	58
Actif total	**3 442 982 583**	**5 389 330**	**240 322 875**	**95 901 220**	**6 193 579**	**362 978 724**	**137 914 990**	**2 488 418**
Passif :								
Engagements envers le dépositaire (cash overdraft)	54 933	—	—	—	—	—	—	—
Distributions à payer	—	—	230 366	—	—	67 674	—	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	—	252 101	—	—	4 009 832	—	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	40 696	193	252	696	235	76 949	311	189
Engagements découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	6 552	—	—	236 629	—	—
Engagements pour placements achetés	—	337 284	1 712 650	187 744	19 625	9 151 931	97 998	1 926
Engagements pour actions de fonds rachetées	4 682 755	—	273 539	26 692	—	309 666	140 025	—
Engagements au titre de l'impôt sur les plus-values	—	185	—	—	—	—	—	—
Intérêts payables sur contrats de swap	—	—	—	—	—	95 320	—	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	—	—
Options vendues, à leur valeur	—	—	—	—	—	—	—	—
Engagements envers les parties liées (Note 5)	231 367	—	2 190	—	—	5 030	—	—
Passifs transitoires et autres engagements	551 489	110 960	198 254	153 337	98 384	303 569	111 615	64 240
Passif total	**5 561 240**	**448 622**	**2 675 904**	**368 469**	**118 244**	**14 256 600**	**349 949**	**66 355**
Actif net total	**3 437 421 343**	**4 940 708**	**237 646 971**	**95 532 751**	**6 075 335**	**348 722 124**	**137 565 041**	**2 422 063**

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

Voir les notes aux états financiers

BILANS	Global Total Return Fund $	Inflation-Adjusted Bond Fund $	Japan Equity Fund ¥	Limited Maturity Fund $	Managed Wealth Fund $	Prudent Capital Fund $	Prudent Wealth Fund $	U.K. Equity Fund £
Actif :								
Placements, à leur valeur	1 692 065 768	208 197 372	370 977 565	851 426 473	18 498 514	3 696 329 260	3 557 988 598	21 715 579
Accords de mise en pension (Note 12)	2 225 000	18 000	—	1 469 000	201 000	2 817 000	6 885 000	—
Numéraire et autres liquidités	99 999	495	7 959 776	2 589	1 091	3 293	2 973 823	120 030
Numéraire soumis à restrictions (Note 2)	1 920 000	—	—	—	—	4 362 744	—	—
Dépôts auprès des courtiers (Note 2)	4 969 216	90 350	—	1 807 852	769 294	7 483 074	6 952 250	—
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	1 524 710	—	—	—	—	—	—	—
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	485	229	—	—	5	599 087	12 509	—
Créances découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	10 452	—	17 857	—	—	—	—
Créances pour actions de fonds vendues	3 273 949	74 805	—	2 765 579	—	3 962 009	1 114 716	3 579
Créances pour placements vendus	2 076 904	—	—	—	1 694	241 410 205	5 954 978	173 380
Intérêts et dividendes à recevoir	6 445 979	265 977	679 470	4 494 629	18 589	10 828 913	8 350 357	60 495
Intérêts à recevoir sur contrats de swap	—	—	—	642 309	—	—	—	—
Créances à recevoir des parties liées (Note 5)	—	28 532	4 282 556	—	49 663	—	—	30 560
Créances à recevoir des courtiers	123 477	—	—	188 197	—	—	—	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	—	—
Autres actifs	7 232	1 211	9 785	3 829	192	16 999	15 783	192
Actif total	**1 714 732 719**	**208 687 423**	**383 909 152**	**862 818 314**	**19 540 042**	**3 967 812 584**	**3 590 248 014**	**22 103 815**
Passif :								
Engagements envers le dépositaire (cash overdraft)	—	—	—	—	—	—	—	—
Distributions à payer	3 474	—	—	55 803	—	140 288	—	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	4 245 959	—	—	—	—	141 420	—	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	6 441	857	—	—	188	133 707	66 500	—
Engagements découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	322 115	—	—	—	167 569	6 059 363	1 576 543	—
Engagements pour placements achetés	8 533 752	—	—	—	3 589	112 105 055	2 975 285	157 963
Engagements pour actions de fonds rachetées	6 835 544	378 468	17 089	2 884 440	—	14 264 679	10 720 859	197
Engagements au titre de l'impôt sur les plus-values	25 770	—	—	—	—	—	—	—
Intérêts payables sur contrats de swap	176 482	—	—	659 906	—	—	—	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	—	—
Options vendues, à leur valeur	—	—	—	—	100	1 538 940	1 413 204	—
Engagements envers les parties liées (Note 5)	156 548	—	—	37 652	—	341 924	350 732	—
Passifs transitoires et autres engagements	508 296	137 599	9 490 725	255 887	104 902	758 062	674 360	91 852
Passif total	**20 814 381**	**516 924**	**9 507 814**	**3 893 688**	**276 348**	**135 483 438**	**17 777 483**	**250 012**
Actif net total	**1 693 918 338**	**208 170 499**	**374 401 338**	**858 924 626**	**19 263 694**	**3 832 329 146**	**3 572 470 531**	**21 853 803**

Voir les notes aux états financiers

BILANS	U.S. Concentrated Growth Fund $	U.S. Corporate Bond Fund $	U.S. Government Bond Fund $	U.S. Growth Fund $	U.S. Total Return Bond Fund $	U.S. Value Fund $	Total €
Actif :							
Placements, à leur valeur	455 291 194	395 658 753	341 047 664	46 074 950	436 962 773	2 206 702 044	26 655 320 020
Accords de mise en pension (Note 12)	83 000	827 000	772 000	—	100 000	728 000	22 397 087
Numéraire et autres liquidités	918	858	2 394	916	886	—	36 110 521
Numéraire soumis à restrictions (Note 2)	—	—	—	—	—	—	7 989 850
Dépôts auprès des courtiers (Note 2)	—	659 812	1 271 400	—	947 700	—	31 709 898
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	482	—	—	—	—	4 481 336
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	0	121	2 945	4	882	2 394	723 522
Créances découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	58 937	—	704	—	134 008
Créances pour actions de fonds vendues	457 161	1 059 054	4 348 254	—	367 392	2 965 007	71 983 386
Créances pour placements vendus	7 345 178	—	2 712 062	1 539	11 039 295	—	275 098 255
Intérêts et dividendes à recevoir	289 115	3 873 700	1 496 027	15 064	3 439 138	1 826 381	92 466 428
Intérêts à recevoir sur contrats de swap	—	—	—	—	—	—	596 338
Créances à recevoir des parties liées (Note 5)	—	—	29 406	24 995	—	—	646 676
Créances à recevoir des courtiers	—	—	—	—	—	—	491 485
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	2 608
Autres actifs	2 134	1 812	1 681	330	2 212	9 744	117 848
Actif total	**463 468 700**	**402 081 592**	**351 742 770**	**46 117 798**	**452 860 982**	**2 212 233 570**	**27 200 269 266**
Passif :							
Engagements envers le dépositaire (cash overdraft)	—	—	—	—	—	179 142	227 343
Distributions à payer	—	79 178	90 253	—	75 430	—	2 016 490
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	—	—	—	—	—	9 454 243
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	1 628	12 162	6 162	177	2 975	11 058	570 925
Engagements découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	74 264	—	—	—	—	7 788 587
Engagements pour placements achetés	6 398 237	1 537 819	3 633 495	—	7 488 224	—	193 468 882
Engagements pour actions de fonds rachetées	553 879	186 982	1 184 911	—	1 851 910	4 790 428	72 608 779
Engagements au titre de l'impôt sur les plus-values	—	—	—	—	—	—	206 502
Intérêts payables sur contrats de swap	—	—	—	—	—	—	953 666
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	75 566
Options vendues, à leur valeur	—	24 639	—	—	—	—	2 739 765
Engagements envers les parties liées (Note 5)	27 497	11 986	—	—	2 996	168 414	1 741 398
Passifs transitoires et autres engagements	185 634	177 181	166 784	88 225	208 585	409 324	8 891 823
Passif total	**7 166 875**	**2 104 211**	**5 081 605**	**88 402**	**9 630 120**	**5 558 366**	**300 743 969**
Actif net total	**456 301 825**	**399 977 381**	**346 661 165**	**46 029 396**	**443 230 862**	**2 206 675 204**	**26 899 525 297**

Voir les notes aux états financiers

COMPTES DE PROFITS ET PERTES ET TABLEAUX DE VARIATION DE L'ACTIF NET	Asia Ex-Japan Fund $	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund $	Diversified Income Fund $	Emerging Markets Debt Fund $	Emerging Markets Debt Local Currency Fund $	Emerging Markets Equity Fund $
Produit (perte) net(te) des placements								
Revenus								
Dividendes	1 056 887	305 086	644 923	4 337 428	1 350 524	—	—	2 636 161
Intérêts	12 588	—	—	243 806	3 140 184	130 250 096	1 606 039	24 720
Revenu sur accords de mise en pension (Note 2)	527	—	—	9 012	4 618	80 134	1 825	920
Revenus sur titres prêtés (Note 4)	—	—	3 935	—	1 528	—	—	—
Autre	6 288	114	145	191	11 381	71 656	188	17 593
Impôts à la source (Note 8)	(270 651)	(26 706)	(99 236)	(338 788)	(279 917)	(22)	(16 862)	(356 640)
Total du produit des placements	**805 639**	**278 494**	**549 767**	**4 251 649**	**4 228 318**	**130 401 864**	**1 591 190**	**2 322 754**
Charges								
Commission de gestion financière (Note 5)	492 829	46 591	186 732	1 411 880	804 559	16 369 199	229 539	657 906
Commissions de distribution et de service (Note 5)	358 243	52 472	77 854	294 128	761 405	5 264 739	163 104	217 571
Commission de la Société de Gestion (Note 5)	22 257	17 792	17 854	63 729	35 814	637 750	20 057	30 985
Commissions de Dépositaire (Note 6)	110 245	65 392	55 099	94 676	116 941	403 965	95 105	156 942
Coûts du service actionnaires	33 158	20 674	21 378	28 791	37 320	241 957	19 696	27 814
Frais d'impression	54 928	68 711	52 586	53 498	74 311	54 928	53 286	54 928
Révision comptable et autres honoraires	91 229	47 251	45 686	42 871	66 071	85 122	51 072	69 861
Taxe d'abonnement (Note 8)	21 758	3 322	6 959	32 377	44 430	553 373	11 565	16 865
Intérêts et charges assimilées (Note 2)	477	—	121	23	170	24 408	612	133
Commissions de prêt de titres (Note 4)	—	—	590	—	229	—	—	—
Divers	29 577	27 237	25 182	30 552	56 676	264 737	30 579	33 145
Charges totales	**1 214 701**	**349 442**	**490 041**	**2 052 525**	**1 997 926**	**23 900 178**	**674 615**	**1 266 150**
Charges remboursées par les parties liées (Note 5)	(278 963)	(231 698)	(207 037)	(235 740)	(202 753)	(634 022)	(256 004)	(340 961)
Charges nettes	**935 738**	**117 744**	**283 004**	**1 816 785**	**1 795 173**	**23 266 156**	**418 611**	**925 189**
Produit (perte) net(te) des placements	**(130 099)**	**160 750**	**266 763**	**2 434 864**	**2 433 145**	**107 135 708**	**1 172 579**	**1 397 565**
Plus-values (moins-values) réalisées et non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change								
Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change	(3 561 254)	429 952	2 354 587	(3 367 713)	(2 717 835)	(241 268 507)	(3 834 553)	(2 152 313)
Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les conversions de devises	(3 037 872)	(597 555)	(4 753 789)	17 116 064	(9 229 065)	(167 814 603)	865 624	(11 078 999)
Résultat d'exploitation	**(6 729 225)**	**(6 853)**	**(2 132 439)**	**16 183 215**	**(9 513 755)**	**(301 947 402)**	**(1 796 350)**	**(11 833 747)**
Distributions déclarées aux actionnaires (Note 2)	—	—	—	—	(655 748)	(19 916 737)	(381 529)	(176 888)
Variation de l'actif net résultant des opérations sur les actions de fonds	(720 752)	(176 645)	(19 005 133)	109 922 804	(18 243 842)	(148 820 975)	(6 224 338)	(1 824 695)
Variation totale de l'actif net	**(7 449 977)**	**(183 498)**	**(21 137 572)**	**126 106 019**	**(28 413 345)**	**(470 685 114)**	**(8 402 217)**	**(13 835 330)**
Actif net								
À l'ouverture de l'exercice	58 216 830	8 442 883	40 295 957	135 759 012	116 659 896	2 732 792 256	35 268 434	96 635 391
Conversion de devises à l'ouverture de l'exercice (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	—
À la clôture de l'exercice	**50 766 853**	**8 259 385**	**19 158 385**	**261 865 031**	**88 246 551**	**2 262 107 142**	**26 866 217**	**82 800 061**

Voir les notes aux états financiers

COMPTES DE PROFITS ET PERTES ET TABLEAUX DE VARIATION DE L'ACTIF NET	Emerging Markets Equity Research Fund $	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund $	Global Credit Fund $
Produit (perte) net(te) des placements								
Revenus								
Dividendes	70 767	5 281	3 432 653	69 778 462	8 682 513	99 860 380	12 194 468	—
Intérêts	2 642	1 949 706	—	38 982	10 791	76 297	69 910	2 879 460
Revenu sur accords de mise en pension (Note 2)	190	—	—	—	—	—	2 628	1 610
Revenus sur titres prêtés (Note 4)	—	—	3 338	143 802	1 805	495 387	26 779	—
Autre	108	381	135	1 972	193	11 542	178	17 550
Impôts à la source (Note 8)	(8 202)	(2 448)	(301 467)	(5 512 340)	(463 127)	(12 063 229)	(2 100 654)	(2 202)
Total du produit des placements	**65 505**	**1 952 920**	**3 134 659**	**64 450 878**	**8 232 175**	**88 380 377**	**10 193 309**	**2 896 418**
Charges								
Commission de gestion financière (Note 5)	23 740	310 469	1 219 742	18 400 622	3 329 689	38 881 254	6 654 192	375 980
Commissions de distribution et de service (Note 5)	1 841	10 801	450 421	2 975 060	1 549 922	15 988 406	1 931 156	76 684
Commission de la Société de Gestion (Note 5)	20 057	29 719	47 477	671 647	105 188	1 034 358	194 070	31 665
Commissions de Dépositaire (Note 6)	29 653	76 874	126 215	617 367	234 535	829 736	226 393	70 135
Coûts du service actionnaires	2 410	17 455	39 038	249 524	83 156	247 170	76 216	20 181
Frais d'impression	53 432	50 979	52 573	53 371	52 587	53 371	55 140	53 497
Révision comptable et autres honoraires	51 408	45 598	49 241	60 094	51 794	57 362	55 245	50 181
Taxe d'abonnement (Note 8)	366	8 200	42 222	421 876	102 799	1 263 232	157 224	12 403
Intérêts et charges assimilées (Note 2)	—	6 118	255	31 762	735	72 473	186	733
Commissions de prêt de titres (Note 4)	—	—	501	21 570	271	74 308	4 017	—
Divers	19 383	24 265	38 665	196 788	56 357	320 262	46 525	32 479
Charges totales	**202 290**	**580 478**	**2 066 350**	**23 699 681**	**5 567 033**	**58 821 932**	**9 400 364**	**723 938**
Charges remboursées par les parties liées (Note 5)	(175 265)	(174 224)	(120 024)	(400 960)	(176 988)	(1 397)	(32 398)	(217 601)
Charges nettes	**27 025**	**406 254**	**1 946 326**	**23 298 721**	**5 390 045**	**58 820 535**	**9 367 966**	**506 337**
Produit (perte) net(te) des placements	**38 480**	**1 546 666**	**1 188 333**	**41 152 157**	**2 842 130**	**29 559 842**	**825 343**	**2 390 081**
Plus-values (moins-values) réalisées et non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change								
Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change	(165 507)	(9 386 398)	7 339 247	65 282 102	45 407 202	387 271 257	30 030 587	(8 365 564)
Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les conversions de devises	(273 311)	(2 005 738)	(14 420 451)	(182 902 979)	(94 532 928)	(627 776 317)	(88 711 466)	(5 696 870)
Résultat d'exploitation	(400 338)	(9 845 470)	(5 892 871)	(76 468 720)	(46 283 596)	(210 945 218)	(57 855 536)	(11 672 353)
Distributions déclarées aux actionnaires (Note 2)	—	(1 570)	—	(377 351)	—	—	—	(47 354)
Variation de l'actif net résultant des opérations sur les actions de fonds	186 176	157 831	(38 367 436)	(493 013 025)	(168 965 370)	(879 903 383)	(34 989 422)	(4 427 394)
Variation totale de l'actif net	(214 162)	(9 689 209)	(44 260 307)	(569 859 096)	(215 248 966)	(1 090 848 601)	(92 844 958)	(16 147 101)
Actif net								
À l'ouverture de l'exercice	3 091 088	86 861 510	172 966 253	2 810 659 767	526 429 396	5 054 403 885	760 334 657	95 862 996
Conversion de devises à l'ouverture de l'exercice (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	—
À la clôture de l'exercice	**2 876 926**	**77 172 301**	**128 705 946**	**2 240 800 671**	**311 180 430**	**3 963 555 284**	**667 489 699**	**79 715 895**

Voir les notes aux états financiers

COMPTES DE PROFITS ET PERTES ET TABLEAUX DE VARIATION DE L'ACTIF NET	Global Equity Fund $	Global Equity Income Fund $	Global High Yield Fund $	Global Intrinsic Value Fund $	Global New Discovery Fund $	Global Opportunistic Bond Fund $	Global Research Focused Fund $	Global Strategic Equity Fund (b) $
Produit (perte) net(te) des placements								
Revenus								
Dividendes	60 257 880	141 869	128 388	1 616 416	76 367	—	2 628 286	12 961
Intérêts	304 940	2 184	14 595 213	34 977	4 713	13 810 107	25 953	16
Revenu sur accords de mise en pension (Note 2)	10 204	184	5 299	1 291	320	9 995	964	925
Revenus sur titres prêtés (Note 4)	110 247	—	—	—	—	—	3 257	—
Autre	604	392	13 960	128	106	23 629	122	148
Impôts à la source (Note 8)	(10 380 550)	(22 793)	420	(315 905)	(10 753)	(54 874)	(480 289)	(2 379)
Total du produit des placements	**50 303 325**	**121 836**	**14 743 280**	**1 336 907**	**70 753**	**13 788 857**	**2 178 293**	**11 671**
Charges								
Commission de gestion financière (Note 5)	31 440 887	21 419	1 871 086	1 015 462	52 913	1 948 132	1 286 124	11 627
Commissions de distribution et de service (Note 5)	10 428 264	22 882	1 887 856	665 231	29 689	1 667 451	812 409	1 878
Commission de la Société de Gestion (Note 5)	975 670	20 057	81 521	40 185	20 057	117 101	47 589	14 232
Commissions de Dépositaire (Note 6)	470 805	48 581	121 259	109 549	47 309	239 445	69 739	32 657
Coûts du service actionnaires	249 350	17 676	91 451	48 596	17 668	73 323	29 759	11 557
Frais d'impression	55 139	69 107	54 928	59 905	53 286	53 498	55 139	30 533
Révision comptable et autres honoraires	60 663	58 113	60 795	55 143	46 141	68 238	52 930	33 523
Taxe d'abonnement (Note 8)	841 347	1 491	113 698	39 206	1 915	122 417	51 221	313
Intérêts et charges assimilées (Note 2)	10 101	—	185	28	—	6 214	310	—
Commissions de prêt de titres (Note 4)	16 537	—	—	—	—	—	488	—
Divers	185 600	25 982	52 838	37 505	26 269	94 925	28 712	18 093
Charges totales	**44 734 363**	**285 308**	**4 335 617**	**2 070 810**	**295 247**	**4 390 744**	**2 434 420**	**154 413**
Charges remboursées par les parties liées (Note 5)	(75 194)	(233 599)	(213 275)	(294 741)	(207 977)	(270 297)	(226 520)	(139 972)
Charges nettes	**44 659 169**	**51 709**	**4 122 342**	**1 776 069**	**87 270**	**4 120 447**	**2 207 900**	**14 441**
Produit (perte) net(te) des placements	**5 644 156**	**70 127**	**10 620 938**	**(439 162)**	**(16 517)**	**9 668 410**	**(29 607)**	**(2 770)**
Plus-values (moins-values) réalisées et non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change								
Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change	189 960 810	(25 532)	(10 422 850)	5 619 131	(671 885)	(50 134 169)	3 250 834	(23 688)
Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les conversions de devises	(509 772 887)	(65 514)	(18 267 491)	(22 391 377)	(184 423)	(8 978 126)	(19 945 599)	150 114
Résultat d'exploitation	(314 167 921)	(20 919)	(18 069 403)	(17 211 408)	(872 825)	(49 443 885)	(16 724 372)	123 656
Distributions déclarées aux actionnaires (Note 2)	—	(15 895)	(4 019 042)	—	—	(1 114 028)	—	—
Variation de l'actif net résultant des opérations sur les actions de fonds	(299 146 741)	1 722 428	(59 531 342)	(56 162 092)	(134 772)	(135 465 304)	(7 616 649)	2 298 407
Variation totale de l'actif net	(613 314 662)	1 685 614	(81 619 787)	(73 373 500)	(1 007 597)	(186 023 217)	(24 341 021)	2 422 063
Actif net								
À l'ouverture de l'exercice	4 050 736 005	3 255 094	319 266 758	168 906 251	7 082 932	534 745 341	161 906 062	—
Conversion de devises à l'ouverture de l'exercice (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	—
À la clôture de l'exercice	3 437 421 343	4 940 708	237 646 971	95 532 751	6 075 335	348 722 124	137 565 041	2 422 063

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

Voir les notes aux états financiers

COMPTES DE PROFITS ET PERTES ET TABLEAUX DE VARIATION DE L'ACTIF NET	Global Total Return Fund $	Inflation-Adjusted Bond Fund $	Japan Equity Fund (c) ¥	Latin American Equity Fund (d) $	Limited Maturity Fund $	Managed Wealth Fund $	Prudent Capital Fund $	Prudent Wealth Fund $
Produit (perte) net(te) des placements								
Revenus								
Dividendes	32 389 293	—	8 578 679	191 251	—	313 054	51 065 201	58 513 600
Intérêts	19 672 275	18 606 299	—	1 007	24 412 144	34 491	50 479 983	25 621 546
Revenu sur accords de mise en pension (Note 2)	27 596	830	55	36	14 736	2 874	103 172	98 222
Revenus sur titres prêtés (Note 4)	95 410	—	—	—	—	—	—	142 991
Autre	53 822	129	46 576	—	169 804	113	10 587	6 474
Impôts à la source (Note 8)	(5 474 233)	—	(1 319 183)	(7 467)	—	(64 844)	(6 012 603)	(6 616 658)
Total du produit des placements	**46 764 163**	**18 607 258**	**7 306 127**	**184 827**	**24 596 684**	**285 688**	**95 646 340**	**77 766 175**
Charges								
Commission de gestion financière (Note 5)	17 032 125	1 212 511	3 733 147	25 594	4 774 043	166 523	42 326 966	45 061 062
Commissions de distribution et de service (Note 5)	11 794 245	1 315 314	2 067 318	17 837	3 712 010	67 803	26 820 115	26 770 536
Commission de la Société de Gestion (Note 5)	492 947	79 050	2 587 466	8 133	253 956	20 057	1 145 144	1 112 020
Commissions de Dépositaire (Note 6)	435 244	91 170	2 484 211	14 308	227 769	61 925	598 334	575 387
Coûts du service actionnaires	213 754	65 773	2 212 257	6 604	122 126	16 545	495 193	267 447
Frais d'impression	61 249	54 928	7 248 832	8 071	55 139	71 863	53 498	55 140
Révision comptable et autres honoraires	82 689	47 948	6 259 789	32 943	50 099	43 931	53 169	54 279
Taxe d'abonnement (Note 8)	713 875	104 989	26 717	523	349 237	5 321	1 656 309	1 601 856
Intérêts et charges assimilées (Note 2)	6 249	2 109	7 855	—	11 556	3 529	9 262	7 778
Commissions de prêt de titres (Note 4)	14 312	—	—	—	—	—	—	21 449
Divers	116 772	31 272	2 791 796	10 327	60 769	25 075	315 731	309 175
Charges totales	**30 963 461**	**3 005 064**	**29 419 388**	**124 340**	**9 616 704**	**482 572**	**73 473 721**	**75 836 129**
Charges remboursées par les parties liées (Note 5)	(53 091)	(285 424)	(23 233 849)	(78 683)	(122 165)	(220 174)	(14 280)	(537)
Charges nettes	**30 910 370**	**2 719 640**	**6 185 539**	**45 657**	**9 494 539**	**262 398**	**73 459 441**	**75 835 592**
Produit (perte) net(te) des placements	**15 853 793**	**15 887 618**	**1 120 588**	**139 170**	**15 102 145**	**23 290**	**22 186 899**	**1 930 583**
Plus-values (moins-values) réalisées et non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change								
Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change	(3 701 668)	(15 951 669)	(83 790 171)	(589 685)	(16 798 195)	2 332 985	(70 520 270)	70 859 615
Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les conversions de devises	(127 971 043)	(22 075 439)	21 558 106	(239 193)	(24 920 104)	(2 418 442)	(436 464 243)	(676 756 258)
Résultat d'exploitation	(115 818 918)	(22 139 490)	(61 111 477)	(689 708)	(26 616 154)	(62 167)	(484 797 614)	(603 966 060)
Distributions déclarées aux actionnaires (Note 2)	(1 310 848)	(1 466 995)	—	—	(806 432)	—	(140 343)	—
Variation de l'actif net résultant des opérations sur les actions de fonds	(110 050 060)	(45 167 588)	(151 567 227)	(3 480 389)	(94 764 300)	(887 351)	(991 566 482)	(805 979 577)
Variation totale de l'actif net	(227 179 826)	(68 774 073)	(212 678 704)	(4 170 097)	(122 186 886)	(949 518)	(1 476 504 439)	(1 409 945 637)
Actif net								
À l'ouverture de l'exercice	1 921 098 164	276 944 572	587 080 042	4 170 097	981 111 512	20 213 212	5 308 833 585	4 982 416 168
Conversion de devises à l'ouverture de l'exercice (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	—
À la clôture de l'exercice	**1 693 918 338**	**208 170 499**	**374 401 338**	**—**	**858 924 626**	**19 263 694**	**3 832 329 146**	**3 572 470 531**

(c) À compter du 7 juin 2022, la devise de référence du Japan Equity Fund est passée du dollar américain au yen japonais. L'actif net à l'ouverture de l'exercice prend en compte un ajustement de conversion de devises de 70 774 425 JPY résultant de la conversion de la devise de référence expliquée plus en détail à la Note 2.
(d) Le compartiment a cessé ses activités le 28 juin 2022.

Voir les notes aux états financiers

COMPTES DE PROFITS ET PERTES ET TABLEAUX DE VARIATION DE L'ACTIF NET	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund €	U.S. Corporate Bond Fund $	U.S. Government Bond Fund $	U.S. Growth Fund $	U.S. Total Return Bond Fund $	U.S. Value Fund $	Total €
Produit (perte) net(te) des placements								
Revenus								
Dividendes	908 949	4 763 595	—	—	268 237	—	52 642 362	447 476 271
Intérêts	392	66 423	14 539 248	8 581 824	24 861	17 515 593	443 015	321 265 068
Revenu sur accords de mise en pension (Note 2)	—	2 377	11 220	20 064	—	12 685	16 082	405 225
Revenus sur titres prêtés (Note 4)	—	—	—	—	—	—	14 918	1 011 722
Autre	103	155	231 974	1 905	1 073	404 815	25 027	999 244
Impôts à la source (Note 8)	(14 245)	(1 203 099)	—	(112 365)	(74 684)	(157 684)	(14 093 436)	(63 067 566)
Total du produit des placements	**895 199**	**3 629 451**	**14 782 442**	**8 491 428**	**219 487**	**17 775 409**	**39 047 968**	**708 089 964**
Charges								
Commission de gestion financière (Note 5)	208 271	5 159 585	2 034 799	1 424 751	259 170	2 370 262	20 919 598	253 443 350
Commissions de distribution et de service (Note 5)	144 136	3 351 588	2 063 226	945 435	193 752	1 453 025	11 274 248	126 478 814
Commission de la Société de Gestion (Note 5)	15 013	139 785	113 748	92 479	21 074	145 280	654 438	8 077 089
Commissions de Dépositaire (Note 6)	38 289	143 692	120 086	101 933	36 003	163 565	287 092	6 941 239
Coûts du service actionnaires	19 397	89 226	62 329	73 379	24 111	74 118	267 549	3 296 236
Frais d'impression	44 778	55 139	53 498	54 928	53 497	55 139	54 927	1 982 295
Révision comptable et autres honoraires	49 817	47 837	47 075	50 103	43 128	52 662	52 590	1 981 978
Taxe d'abonnement (Note 8)	8 743	189 134	144 834	118 099	11 665	135 489	875 538	9 151 944
Intérêts et charges assimilées (Note 2)	—	385	3 820	3 493	—	7 661	651	203 570
Commissions de prêt de titres (Note 4)	—	—	—	—	—	—	2 238	151 759
Divers	18 544	43 752	45 575	53 401	25 882	60 920	134 769	2 796 383
Charges totales	**546 988**	**9 220 123**	**4 688 990**	**2 918 001**	**668 282**	**4 518 121**	**34 523 638**	**414 504 657**
Charges remboursées par les parties liées (Note 5)	(174 383)	(200 972)	(138 262)	(328 185)	(183 887)	(227 191)	(92 797)	(7 175 743)
Charges nettes	**372 605**	**9 019 151**	**4 550 728**	**2 589 816**	**484 395**	**4 290 930**	**34 430 841**	**407 328 914**
Produit (perte) net(te) des placements	**522 594**	**(5 389 700)**	**10 231 714**	**5 901 612**	**(264 908)**	**13 484 479**	**4 617 127**	**300 761 050**
Plus-values (moins-values) réalisées et non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change								
Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change	(393 308)	26 413 937	(24 138 236)	(6 712 332)	(1 595 458)	(28 236 245)	154 654 073	486 775 248
Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les conversions de devises	8 269	(77 569 065)	(27 594 845)	(20 537 893)	(8 065 737)	(35 834 085)	(211 775 940)	(3 244 389 871)
Résultat d'exploitation	137 555	(56 544 828)	(41 501 367)	(21 348 613)	(9 926 103)	(50 585 851)	(52 504 740)	(2 456 853 573)
Distributions déclarées aux actionnaires (Note 2)	(11 099)	—	(1 583 828)	(831 671)	—	(1 228 963)	—	(31 386 578)
Variation de l'actif net résultant des opérations sur les actions de fonds	(2 399 812)	(17 437 470)	7 852 465	63 941 326	1 345 441	(109 672 471)	(235 308 373)	(4 362 898 681)
Variation totale de l'actif net	(2 273 356)	(73 982 298)	(35 232 730)	41 761 042	(8 580 662)	(161 487 285)	(287 813 113)	(6 851 138 832)
Actif net								
À l'ouverture de l'exercice	24 127 159	530 284 123	435 210 111	304 900 123	54 610 058	604 718 147	2 494 488 317	32 944 184 880
Conversion de devises à l'ouverture de l'exercice (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	806 479 249
À la clôture de l'exercice	**21 853 803**	**456 301 825**	**399 977 381**	**346 661 165**	**46 029 396**	**443 230 862**	**2 206 675 204**	**26 899 525 297**

Voir les notes aux états financiers

STATISTIQUES	Asia Ex-Japan Fund $	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund $	Diversified Income Fund $	Emerging Markets Debt Fund $
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2021	69 042 229	5 586 392	22 357 407	3 075 522	122 149 153	3 494 274 352
31 janvier 2022	58 216 830	8 442 883	40 295 957	135 759 012	116 659 896	2 732 792 256
31 janvier 2023	50 766 853	8 259 385	19 158 385	261 865 031	88 246 551	2 262 107 142
Actions en circulation au 31 janvier 2023						
Catégorie A1 (EUR)	58 534	109 827	104 357	28 524	—	922 689
Catégorie A1 (GBP)	—	—	118 319	—	—	354 200
Catégorie A1 (USD)	1 017 245	86 804	114 131	637 195	2 240 633	10 317 143
Catégorie AH1 (EUR)	—	—	—	66 375	142 078	2 234 750
Catégorie AH1 (USD)	—	48 726	—	—	—	—
Catégorie A2 (USD)	—	—	—	—	1 269 199	10 635 229
Catégorie AH2 (EUR)	—	—	—	—	149 572	693 661
Catégorie A4 (EUR)	—	—	—	—	22 599	—
Catégorie AH4 (EUR)	—	—	—	—	7 354	—
Catégorie C1 (USD)	156 049	22 951	23 777	216 871	1 476 977	2 317 376
Catégorie CH1 (USD)	—	5 000	—	—	—	—
Catégorie C2 (USD)	—	—	—	—	393 797	2 239 952
Catégorie I1 (EUR)	—	408	511	897 159	—	—
Catégorie I1 (GBP)	180	216	1 151	414	—	448
Catégorie I1 (USD)	6 473	79 128	311 783	366 366	1 942	2 612 920
Catégorie IH1 (CHF)	—	—	—	—	—	25 603
Catégorie IH1 (EUR)	—	—	—	447	840	3 240 335
Catégorie IH1 (USD)	—	500	—	—	—	—
Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	—	—	1 060 338
Catégorie I2 (GBP)	—	—	—	—	—	460 376
Catégorie IS1 (USD)	—	—	—	—	—	226
Catégorie ISH1 (EUR)	—	—	—	—	—	3 809
Catégorie ISH2 (EUR)	—	—	—	—	—	530
Catégorie ISH2 (GBP)	—	—	—	—	—	581
Catégorie ISM1 (USD)	—	—	—	—	—	2 084
Catégorie N1 (USD)	164 351	9 281	7 991	859 302	1 254 180	3 789 194
Catégorie NH1 (USD)	—	15 752	—	—	—	—
Catégorie N2 (USD)	—	—	—	—	220 049	756 817
Catégorie P1 (EUR)	—	2 236	—	—	15 732	218 747
Catégorie P1 (USD)	—	—	—	—	4 382	3 643
Catégorie PH1 (EUR)	—	—	—	—	5 412	16 562
Catégorie S1 (USD)	58 506	—	—	—	—	158 832
Catégorie W1 (EUR)	—	3 744	126 526	16 353	30 375	907 998
Catégorie W1 (GBP)	—	—	—	114 417	—	—
Catégorie W1 (USD)	226 285	5 000	6 634	147 210	178 511	3 372 187
Catégorie WH1 (EUR)	—	—	—	8 469	9 462	21 698
Catégorie WH1 (GBP)	—	2 866	37 019	28 080	4 346	122 164
Catégorie WH1 (USD)	—	5 000	—	—	—	—
Catégorie W2 (USD)	—	—	—	—	191 147	6 366 215
Catégorie WH2 (EUR)	—	—	—	—	—	436 368

STATISTIQUES — (suite)	Asia Ex-Japan Fund $	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund $	Diversified Income Fund $	Emerging Markets Debt Fund $
Catégorie WH2 (GBP)	—	—	—	—	—	203 764
Catégorie WS1 (USD)	—	—	—	90 361	—	181 492
Catégorie WSH1 (CHF)	—	—	—	109 922	—	—
Catégorie WSH1 (EUR)	—	—	—	87 289	—	954 947
Catégorie WSH2 (GBP)	—	—	—	—	—	7 280
Catégorie Z1 (USD)	—	—	—	—	—	497 240
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2021	31,90	21,73	24,24	—	—	24,33
31 janvier 2022	30,23	27,46	29,88	—	—	25,02
31 janvier 2023	27,66	27,36	29,84	14,39(a)	—	23,25
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	14,84	—	—	11,82
31 janvier 2022	—	—	17,26	—	—	11,46
31 janvier 2023	—	—	18,20	—	—	11,24
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2021	42,96	18,29	25,07	12,59	12,76	43,72
31 janvier 2022	37,70	21,40	28,60	15,25	13,48	41,62
31 janvier 2023	33,38	20,63	27,64	15,81	12,49	37,42
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	12,09	11,41	14,24
31 janvier 2022	—	—	—	14,46	11,95	13,46
31 janvier 2023	—	—	—	14,40	10,75	11,78
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (USD)						
31 janvier 2021	—	14,85	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	18,92	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	19,40	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	10,99	18,06
31 janvier 2022	—	—	—	—	11,35	16,63
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,21	14,29
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH2 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	9,83	9,61
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,04	8,76
31 janvier 2023	—	—	—	—	8,80	7,31
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A4 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	9,70	—
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,78	—
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,03	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH4 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	10,02	—
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,30	—
31 janvier 2023	—	—	—	—	9,02	—

STATISTIQUES — (suite)	Asia Ex-Japan Fund $	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund $	Diversified Income Fund $	Emerging Markets Debt Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2021	36,41	14,40	14,43	12,45	11,98	36,11
31 janvier 2022	31,71	16,73	16,34	14,96	12,53	34,04
31 janvier 2023	27,86	16,01	15,67	15,40	11,50	30,30
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie CH1 (USD)						
31 janvier 2021	—	14,43	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	18,24	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	18,64	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	10,97	18,05
31 janvier 2022	—	—	—	—	11,32	16,62
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,19	14,28
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	239,29	96,72	116,92	—	—
31 janvier 2022	—	305,48	120,52	154,65	—	—
31 janvier 2023	—	307,46	121,72	167,55	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2021	453,47	242,44	348,32	113,73	—	253,68
31 janvier 2022	409,85	291,90	409,35	141,88	—	247,92
31 janvier 2023	400,15	310,14	436,30	162,26	—	245,01
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2021	389,27	14,50	16,93	127,94	133,45	274,12
31 janvier 2022	345,34	17,14	19,53	156,67	142,18	262,96
31 janvier 2023	309,07	16,69	19,08	164,24	132,88	238,22
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (CHF)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	117,89
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	111,98
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	98,20
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	122,98	111,38	151,11
31 janvier 2022	—	—	—	148,88	117,58	143,81
31 janvier 2023	—	—	—	149,81	107,04	126,85
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (USD)						
31 janvier 2021	—	155,81	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	200,46	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	208,02	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH2 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	136,89
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	124,94
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	104,58
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I2 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	111,70
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	104,80
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	98,29

STATISTIQUES — (suite)	Asia Ex-Japan Fund $	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund $	Diversified Income Fund $	Emerging Markets Debt Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IS1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	277,57
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	266,67
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	241,96
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	153,09
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	145,99
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	129,19
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISH2 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	150,16
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	137,18
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	114,70
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISH2 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	117,66
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	107,94
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	91,36
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISM1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	276,32
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	265,79
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	241,40
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)						
31 janvier 2021	16,81	14,58	14,65	12,50	12,36	12,47
31 janvier 2022	14,68	16,98	16,65	15,06	13,00	11,81
31 janvier 2023	12,93	16,29	16,01	15,54	11,98	10,57
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie NH1 (USD)						
31 janvier 2021	—	14,60	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	18,49	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	18,94	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	10,96	9,48
31 janvier 2022	—	—	—	—	11,32	8,73
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,19	7,50
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	21,72	—	—	11,11	24,33
31 janvier 2022	—	27,45	—	—	12,68	25,02
31 janvier 2023	—	27,36	—	—	12,14	23,24
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	12,76	43,72
31 janvier 2022	—	—	—	—	13,48	41,62
31 janvier 2023	—	—	—	—	12,49	37,43
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	11,43	14,24
31 janvier 2022	—	—	—	—	11,98	13,43
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,80	11,76

STATISTIQUES — (suite)	Asia Ex-Japan Fund $	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund $	Diversified Income Fund $	Emerging Markets Debt Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2021	52,06	—	—	—	—	38,86
31 janvier 2022	46,14	—	—	—	—	37,20
31 janvier 2023	41,25	—	—	—	—	33,62
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	15,79	18,42	—	12,04	12,25
31 janvier 2022	—	20,13	22,94	—	13,84	12,67
31 janvier 2023	—	20,24	23,13	14,92(a)	13,36	11,84
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	—	11,36	—	—
31 janvier 2022	—	—	—	14,15	—	—
31 janvier 2023	—	—	—	16,17	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2021	22,72	15,51	16,59	12,78	13,26	18,84
31 janvier 2022	20,14	18,31	19,11	15,63	14,11	18,04
31 janvier 2023	18,01	17,81	18,66	16,37	13,17	16,32
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	12,28	11,99	12,15
31 janvier 2022	—	—	—	14,85	12,66	11,54
31 janvier 2023	—	—	—	14,91	11,50	10,19
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	17,58	20,53	12,28	12,37	16,51
31 janvier 2022	—	22,49	25,63	14,92	13,14	15,79
31 janvier 2023	—	22,81	26,16	15,19	12,09	14,09
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (USD)						
31 janvier 2021	—	15,49	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	19,91	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	20,64	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	11,02	9,71
31 janvier 2022	—	—	—	—	11,38	8,94
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,23	7,69
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH2 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	9,74
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	8,90
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	7,42
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH2 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	9,31
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	8,56
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	7,23
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WS1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	19,02
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	18,29
31 janvier 2023	—	—	—	16,39(a)	—	16,61

STATISTIQUES — (suite)	Asia Ex-Japan Fund $	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund $	Diversified Income Fund $	Emerging Markets Debt Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WSH1 (CHF)						
31 janvier 2023	—	—	—	11,26(a)	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WSH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	12,52
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	11,94
31 janvier 2023	—	—	—	14,93(a)	—	10,56
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WSH2 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	9,37
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	8,61
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	7,31
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	263,34
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	254,39
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	232,09
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023 :						
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	2,00	1,60	1,85	1,85(e)	—	1,52
Frais sur encours - Catégorie A1 (GBP)	—	—	1,84	—	—	1,51
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,98	1,60	1,85	1,85	1,60	1,52
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	—	—	—	1,85	1,60	1,53
Frais sur encours - Catégorie AH1 (USD)	—	1,60	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	—	—	—	—	1,60	1,51
Frais sur encours - Catégorie AH2 (EUR)	—	—	—	—	1,60	1,55
Frais sur encours - Catégorie A4 (EUR)	—	—	—	—	1,60	—
Frais sur encours - Catégorie AH4 (EUR)	—	—	—	—	1,60	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,75	2,35	2,60	2,60	2,60	2,52
Frais sur encours - Catégorie CH1 (USD)	—	2,35	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	—	—	—	—	2,60	2,52
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	—	0,60	0,76	0,75	—	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	0,90	0,60	0,75	0,75	—	0,75
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,90	0,60	0,75	0,75	0,75	0,75
Frais sur encours - Catégorie IH1 (CHF)	—	—	—	—	—	0,75
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	—	—	—	0,75	0,75	0,75
Frais sur encours - Catégorie IH1 (USD)	—	0,60	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	—	—	0,75
Frais sur encours - Catégorie I2 (GBP)	—	—	—	—	—	0,75
Frais sur encours - Catégorie IS1 (USD)	—	—	—	—	—	0,60
Frais sur encours - Catégorie ISH1 (EUR)	—	—	—	—	—	0,51
Frais sur encours - Catégorie ISH2 (EUR)	—	—	—	—	—	0,51
Frais sur encours - Catégorie ISH2 (GBP)	—	—	—	—	—	0,51
Frais sur encours - Catégorie ISM1 (USD)	—	—	—	—	—	0,48
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,50	2,10	2,35	2,35	2,10	2,02
Frais sur encours - Catégorie NH1 (USD)	—	2,10	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	—	—	—	—	2,10	2,02
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	—	1,60	—	—	1,60	1,52
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	—	—	—	—	1,60	1,51

STATISTIQUES — (suite)	Asia Ex-Japan Fund $	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund $	Diversified Income Fund $	Emerging Markets Debt Fund $
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	—	—	—	—	1,60	1,55
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	1,00	—	—	—	—	0,98
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	—	0,70	0,85	0,85(e)	0,85	0,90
Frais sur encours - Catégorie W1 (GBP)	—	—	—	0,85	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	1,00	0,70	0,85	0,85	0,85	0,90
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	—	—	—	0,85	0,85	0,90
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	—	0,70	0,85	0,85	0,85	0,90
Frais sur encours - Catégorie WH1 (USD)	—	0,70	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	—	—	—	—	0,85	0,90
Frais sur encours - Catégorie WH2 (EUR)	—	—	—	—	—	0,90
Frais sur encours - Catégorie WH2 (GBP)	—	—	—	—	—	0,90
Frais sur encours - Catégorie WS1 (USD)	—	—	—	0,65(e)	—	0,52
Frais sur encours - Catégorie WSH1 (CHF)	—	—	—	0,65(e)	—	—
Frais sur encours - Catégorie WSH1 (EUR)	—	—	—	0,65(e)	—	0,55
Frais sur encours - Catégorie WSH2 (GBP)	—	—	—	—	—	0,55
Frais sur encours - Catégorie Z1 (USD)	—	—	—	—	—	0,05
Rotation de portefeuille (non révisée) (%) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023	48	80	(9)	61	130	17

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

STATISTIQUES	Emerging Markets Debt Local Currency Fund $	Emerging Markets Equity Fund $	Emerging Markets Equity Research Fund $	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2021	51 159 965	113 868 311	—	26 245 507	130 100 703	2 832 927 437
31 janvier 2022	35 268 434	96 635 391	3 091 088	86 861 510	172 966 253	2 810 659 767
31 janvier 2023	26 866 217	82 800 061	2 876 926	77 172 301	128 705 946	2 240 800 671
Actions en circulation au 31 janvier 2023						
Catégorie A1 (EUR)	115 119	47 641	—	37 127	221 089	3 071 931
Catégorie A1 (USD)	488 627	1 087 704	7 742	100 889	1 144 892	5 069 363
Catégorie AH1 (EUR)	—	—	4 220	—	—	—
Catégorie AH1 (USD)	—	—	—	—	92 315	1 790 271
Catégorie A2 (EUR)	—	—	—	6 314	—	—
Catégorie A2 (USD)	940 760	—	—	7 152	—	—
Catégorie C1 (USD)	400 151	417 427	7 770	16 984	116 101	532 992
Catégorie CH1 (USD)	—	—	—	—	83 521	231 715
Catégorie C2 (USD)	210 182	—	—	7 165	—	—
Catégorie I1 (EUR)	—	156 881	648	764 744	124 945	3 021 519
Catégorie I1 (GBP)	—	445	545	524	251	821
Catégorie I1 (USD)	11 919	13 109	27 085	676	382 642	847 918
Catégorie IH1 (EUR)	—	—	791	—	—	—
Catégorie IH1 (SGD)	—	—	—	—	—	1 499 147
Catégorie IH1 (USD)	—	—	—	—	—	52 137
Catégorie IH1R (EUR)	—	—	—	—	—	629
Catégorie I2 (EUR)	—	50 390	—	—	—	—
Catégorie I3 (EUR)	—	—	—	—	—	8 502
Catégorie IS1 (EUR)	—	—	—	—	—	1 050 596
Catégorie ISB1 (EUR)	—	—	—	—	—	346 261
Catégorie N1 (USD)	111 758	326 799	7 757	40 088	69 002	702 553
Catégorie NH1 (USD)	—	—	—	—	38 428	507 343
Catégorie N2 (USD)	64 625	—	—	—	—	—
Catégorie P1 (EUR)	—	3 718	—	—	—	37 837
Catégorie P1 (USD)	—	4 772	—	—	—	—
Catégorie PH1 (EUR)	—	4 631	—	—	—	—
Catégorie S1 (USD)	—	44 289	—	—	—	—
Catégorie W1 (EUR)	—	—	—	19 953	149 793	1 581 329
Catégorie W1 (GBP)	—	—	—	5 241	133 351	—
Catégorie W1 (USD)	281 102	125 092	7 710	6 765	886 064	4 621 118
Catégorie WH1 (EUR)	6 008	5 494	7 919	—	—	—
Catégorie WH1 (GBP)	18 837	26 202	6 824	—	7 509	248 373
Catégorie WH1 (USD)	—	—	—	—	10 204	3 679 849
Catégorie W2 (USD)	134 020	—	—	—	—	—
Catégorie Z1 (EUR)	—	535	—	—	—	325
Catégorie Z1 (JPY)	—	140 581	—	—	—	—

STATISTIQUES — (suite)	Emerging Markets Debt Local Currency Fund $	Emerging Markets Equity Fund $	Emerging Markets Equity Research Fund $	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2021	15,86	17,78	—	11,04	41,25	40,85
31 janvier 2022	15,96	17,45	—	10,82	50,23	47,48
31 janvier 2023	15,69	15,73	—	9,53	48,62	45,81
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2021	14,20	16,86	—	11,87	28,87	28,84
31 janvier 2022	13,23	15,31	9,61	10,76	32,55	31,02
31 janvier 2023	12,58	13,36	8,19	9,17	30,48	28,97
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	9,56	—	—	—
31 janvier 2023	—	—	7,89	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	29,36	17,04
31 janvier 2022	—	—	—	—	35,98	19,95
31 janvier 2023	—	—	—	—	35,90	19,88
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	10,92	—	—
31 janvier 2022	—	—	—	10,62	—	—
31 janvier 2023	—	—	—	9,23	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2021	7,90	—	—	11,74	—	—
31 janvier 2022	7,03	—	—	10,57	—	—
31 janvier 2023	6,39	—	—	8,89	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2021	12,63	15,12	—	11,64	14,21	13,35
31 janvier 2022	11,65	13,63	9,57	10,45	15,90	14,26
31 janvier 2023	10,97	11,80	8,13	8,81	14,78	13,21
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie CH1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	15,81	14,70
31 janvier 2022	—	—	—	—	19,25	17,08
31 janvier 2023	—	—	—	—	19,05	16,86
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2021	7,89	—	—	11,64	—	—
31 janvier 2022	7,02	—	—	10,45	—	—
31 janvier 2023	6,38	—	—	8,78	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	206,96	—	111,97	339,02	270,92
31 janvier 2022	—	205,22	101,85	110,41	417,57	318,30
31 janvier 2023	—	186,94	90,60	97,93	408,80	310,46
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	251,09	—	112,49	301,18	328,48
31 janvier 2022	—	234,82	99,18	104,61	349,87	363,97
31 janvier 2023	—	225,81	93,13	97,96	361,57	374,76

STATISTIQUES — (suite)	Emerging Markets Debt Local Currency Fund $	Emerging Markets Equity Fund $	Emerging Markets Equity Research Fund $	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2021	155,05	195,99	—	120,34	16,61	244,96
31 janvier 2022	145,47	179,91	96,69	109,85	18,94	266,43
31 janvier 2023	139,39	158,60	83,23	94,30	17,95	251,47
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	96,16	—	—	—
31 janvier 2023	—	—	80,26	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (SGD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	120,42
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	142,40
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	142,42
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	186,83
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	221,10
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	221,96
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1R (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	342,90
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	403,72
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I2 (EUR)						
31 janvier 2021	—	201,63	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	197,04	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	175,90	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I3 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	257,54
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	293,93
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	249,72
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IS1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	271,94
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	319,97
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	312,55
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISB1 (EUR)						
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	312,93(a)
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)						
31 janvier 2021	8,94	11,94	—	11,76	14,44	15,51
31 janvier 2022	8,29	10,80	9,58	10,61	16,19	16,61
31 janvier 2023	7,85	9,37	8,12	9,00	15,09	15,43
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie NH1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	16,11	15,05
31 janvier 2022	—	—	—	—	19,66	17,50
31 janvier 2023	—	—	—	—	19,48	17,30
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2021	6,26	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	5,58	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	5,07	—	—	—	—	—

STATISTIQUES — (suite)	Emerging Markets Debt Local Currency Fund $	Emerging Markets Equity Fund $	Emerging Markets Equity Research Fund $	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	17,78	—	—	—	40,83
31 janvier 2022	—	17,45	—	—	—	47,45
31 janvier 2023	—	15,73	—	—	—	45,79
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2021	—	16,86	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	15,32	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	13,36	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	18,25	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	16,42	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	13,88	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2021	—	20,01	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	18,36	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	16,18	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	11,18	18,09	17,37
31 janvier 2022	—	—	—	11,01	22,26	20,39
31 janvier 2023	—	—	—	9,76	21,77	19,87
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	—	11,23	16,58	—
31 janvier 2022	—	—	—	10,43	19,24	—
31 janvier 2023	—	—	—	9,76	19,86	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2021	12,50	14,91	—	12,01	15,88	14,86
31 janvier 2022	11,71	13,67	9,66	10,95	18,09	16,15
31 janvier 2023	11,21	12,04	8,31	9,39	17,13	15,23
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2021	11,99	15,29	—	—	—	—
31 janvier 2022	11,12	13,87	9,61	—	—	—
31 janvier 2023	10,34	11,81	8,01	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2021	10,64	12,68	—	—	22,01	19,19
31 janvier 2022	9,93	11,56	9,64	—	27,16	22,59
31 janvier 2023	9,36	9,97	8,15	—	26,88	22,22
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	14,81	16,46
31 janvier 2022	—	—	—	—	18,35	19,45
31 janvier 2023	—	—	—	—	18,50	19,54
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2021	6,52	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	5,80	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	5,26	—	—	—	—	—

STATISTIQUES — (suite)	Emerging Markets Debt Local Currency Fund $	Emerging Markets Equity Fund $	Emerging Markets Equity Research Fund $	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	168,61	—	—	—	221,66
31 janvier 2022	—	168,70	—	—	—	262,39
31 janvier 2023	—	155,07	—	—	—	257,86
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (JPY)						
31 janvier 2021	—	11 611	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	11 816	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	11 888	—	—	—	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023 :						
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	1,50	2,00	—	1,21	2,05	1,92
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,50	2,00	2,00	1,21	2,05	1,92
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	—	—	2,00	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie AH1 (USD)	—	—	—	—	2,05	1,96
Frais sur encours - Catégorie A2 (EUR)	—	—	—	1,21	—	—
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	1,50	—	—	1,21	—	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,50	2,75	2,75	2,21	2,80	2,68
Frais sur encours - Catégorie CH1 (USD)	—	—	—	—	2,80	2,73
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	2,50	—	—	2,21	—	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	—	0,95	0,95	0,51	0,90	0,84
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	—	0,95	0,95	0,51	0,90	0,84
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,80	0,95	0,95	0,51	0,90	0,84
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	—	—	0,95	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IH1 (SGD)	—	—	—	—	—	0,86
Frais sur encours - Catégorie IH1 (USD)	—	—	—	—	—	0,87
Frais sur encours - Catégorie IH1R (EUR)	—	—	—	—	—	0,90
Frais sur encours - Catégorie I2 (EUR)	—	0,95	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie I3 (EUR)	—	—	—	—	—	0,83
Frais sur encours - Catégorie IS1 (EUR)	—	—	—	—	—	0,69
Frais sur encours - Catégorie ISB1 (EUR)	—	—	—	—	—	0,47(e)
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,00	2,49	2,50	1,71	2,55	2,42
Frais sur encours - Catégorie NH1 (USD)	—	—	—	—	2,55	2,46
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	2,00	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	—	2,00	—	—	—	1,92
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	—	2,00	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	—	2,00	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	—	1,00	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	—	—	—	0,61	1,00	0,93
Frais sur encours - Catégorie W1 (GBP)	—	—	—	0,61	1,00	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	0,90	1,05	1,05	0,61	1,00	0,93
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	0,90	1,05	1,05	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	0,90	1,05	1,05	—	1,00	0,97
Frais sur encours - Catégorie WH1 (USD)	—	—	—	—	1,00	0,95
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	0,90	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie Z1 (EUR)	—	0,05	—	—	—	0,09

STATISTIQUES — (suite)	Emerging Markets Debt Local Currency Fund $	Emerging Markets Equity Fund $	Emerging Markets Equity Research Fund $	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
Frais sur encours - Catégorie Z1 (JPY)	—	0,05	—	—	—	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023	81	60	80	301	(13)	(22)

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

STATISTIQUES	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund $	Global Credit Fund $	Global Equity Fund $	Global Equity Income Fund $
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2021	513 896 516	4 428 102 500	888 181 180	35 082 270	3 887 080 901	2 639 681
31 janvier 2022	526 429 396	5 054 403 885	760 334 657	95 862 996	4 050 736 005	3 255 094
31 janvier 2023	311 180 430	3 963 555 284	667 489 699	79 715 895	3 437 421 343	4 940 708
Actions en circulation au 31 janvier 2023						
Catégorie A1 (EUR)	1 917 862	25 364 774	1 683 063	222 415	13 113 279	—
Catégorie A1 (GBP)	—	153 045	—	—	731 074	—
Catégorie A1 (USD)	590 289	6 189 876	1 965 323	344 143	6 475 622	40 789
Catégorie AH1 (CHF)	—	438 006	—	—	—	—
Catégorie AH1 (EUR)	—	—	—	13 860	2 149 690	9 052
Catégorie AH1 (USD)	954 647	11 075 424	—	—	—	—
Catégorie A2 (USD)	—	—	—	90 208	—	38 045
Catégorie AH2 (EUR)	—	—	—	—	—	11 088
Catégorie C1 (USD)	7 405	—	401 912	62 948	1 110 045	9 764
Catégorie CH1 (USD)	146 220	—	—	—	—	—
Catégorie C2 (USD)	—	—	—	15 594	—	5 322
Catégorie I1 (EUR)	63 947	3 139 403	281 645	—	1 477 536	497
Catégorie I1 (GBP)	—	4 827	9 600	401	798 226	—
Catégorie I1 (USD)	392 481	6 923 238	612 126	540 284	1 515 612	356
Catégorie IH1 (EUR)	—	—	—	—	627 166	442
Catégorie IH1 (USD)	4 666	4 574 396	—	—	—	—
Catégorie IS1 (EUR)	180 239	692	—	—	155	—
Catégorie N1 (EUR)	—	1 401 159	—	—	—	—
Catégorie N1 (USD)	165 483	1 040 610	486 411	65 427	1 335 010	51 581
Catégorie NH1 (USD)	181 262	—	—	—	—	—
Catégorie N2 (USD)	—	—	—	39 094	—	5 403
Catégorie P1 (EUR)	—	—	12 805	—	28 975	—
Catégorie P1 (USD)	—	—	3 658	—	1 723	—
Catégorie PH1 (EUR)	—	—	2 058	—	1 763	—
Catégorie S1 (USD)	—	—	90 319	—	125 026	—
Catégorie W1 (EUR)	115 032	8 802 320	62 524	—	319 136	—
Catégorie W1 (GBP)	—	70 368	229 883	—	276 060	—
Catégorie W1 (USD)	47 577	1 488 031	1 210 096	5 023	1 552 364	104 292
Catégorie WH1 (CHF)	—	188 863	—	—	—	—
Catégorie WH1 (EUR)	—	—	394 795	5 345	462 394	4 730
Catégorie WH1 (GBP)	—	111 280	11 669	4 721	170 447	3 220
Catégorie WH1 (USD)	29 839	650 083	—	—	—	—
Catégorie W2 (USD)	—	—	—	46 731	—	6 021
Catégorie Z1 (EUR)	—	321 136	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2021	68,41	50,89	31,85	16,48	37,94	—
31 janvier 2022	77,45	61,02	39,46	16,95	46,47	—
31 janvier 2023	70,51	58,54	37,52	15,31	44,25	—

STATISTIQUES — (suite)	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund $	Global Credit Fund $	Global Equity Fund $	Global Equity Income Fund $
31 janvier 2021	—	44,15	—	—	19,71	—
31 janvier 2022	—	49,94	—	—	22,76	—
31 janvier 2023	—	50,57	—	—	22,88	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2021	39,84	31,42	60,94	13,97	72,52	14,09
31 janvier 2022	41,76	34,88	69,91	13,30	82,24	16,26
31 janvier 2023	36,79	32,38	64,33	11,63	75,79	16,43
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (CHF)						
31 janvier 2021	—	20,04	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	23,96	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	22,81	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	11,43	36,75	12,60
31 janvier 2022	—	—	—	10,79	41,31	14,42
31 janvier 2023	—	—	—	9,19	36,71	14,14
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (USD)						
31 janvier 2021	18,53	20,84	—	—	—	—
31 janvier 2022	21,14	25,17	—	—	—	—
31 janvier 2023	19,85	24,84	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	10,68	—	13,11
31 janvier 2022	—	—	—	10,00	—	14,90
31 janvier 2023	—	—	—	8,52	—	14,75
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH2 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	11,69
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	13,18
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	12,63
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2021	15,11	—	50,90	12,51	60,64	13,53
31 janvier 2022	15,72	—	57,95	11,79	68,24	15,49
31 janvier 2023	13,75	—	52,92	10,21	62,41	15,54
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie CH1 (USD)						
31 janvier 2021	16,80	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	19,03	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	17,76	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	10,37	—	12,98
31 janvier 2022	—	—	—	9,70	—	14,76
31 janvier 2023	—	—	—	8,28	—	14,60
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2021	462,14	364,54	374,16	—	356,69	137,40
31 janvier 2022	528,38	441,50	468,27	—	441,22	172,99
31 janvier 2023	485,92	427,72	449,61	—	424,33	182,42

STATISTIQUES — (suite)	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund $	Global Credit Fund $	Global Equity Fund $	Global Equity Income Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	314,38	390,38	170,76	430,86	—
31 janvier 2022	—	359,10	460,79	166,81	502,66	—
31 janvier 2023	—	367,24	467,04	160,22	510,31	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2021	19,25	19,24	380,83	150,74	363,82	149,06
31 janvier 2022	20,37	21,57	441,23	144,54	416,62	172,98
31 janvier 2023	18,14	20,22	409,96	127,27	387,72	176,53
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	353,64	132,86
31 janvier 2022	—	—	—	—	400,96	153,47
31 janvier 2023	—	—	—	—	356,19	151,73
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (USD)						
31 janvier 2021	169,47	22,56	—	—	—	—
31 janvier 2022	195,29	27,50	—	—	—	—
31 janvier 2023	185,16	27,45	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IS1 (EUR)						
31 janvier 2021	464,20	367,52	—	—	359,99	—
31 janvier 2022	531,61	445,78	—	—	445,97	—
31 janvier 2023	489,95	432,51	—	—	429,55	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	20,14	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	24,04	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	22,94	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)						
31 janvier 2021	18,49	18,31	20,38	11,62	18,63	13,71
31 janvier 2022	19,29	20,23	23,26	11,01	21,02	15,74
31 janvier 2023	16,91	18,69	21,30	9,57	19,27	15,82
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie NH1 (USD)						
31 janvier 2021	17,10	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	19,39	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	18,14	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	9,91	—	13,03
31 janvier 2022	—	—	—	9,27	—	14,81
31 janvier 2023	—	—	—	7,91	—	14,65
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	31,84	—	37,94	—
31 janvier 2022	—	—	39,45	—	46,46	—
31 janvier 2023	—	—	37,51	—	44,24	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	60,92	—	72,51	—
31 janvier 2022	—	—	69,88	—	82,22	—
31 janvier 2023	—	—	64,30	—	75,76	—

STATISTIQUES — (suite)	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund $	Global Credit Fund $	Global Equity Fund $	Global Equity Income Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	32,61	—	36,63	—
31 janvier 2022	—	—	36,99	—	41,06	—
31 janvier 2023	—	—	32,76	—	36,49	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	76,95	—	89,89	—
31 janvier 2022	—	—	89,20	—	102,84	—
31 janvier 2023	—	—	82,93	—	95,62	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2021	20,78	20,19	32,56	—	38,79	—
31 janvier 2022	23,70	24,40	40,65	—	47,86	—
31 janvier 2023	21,74	23,58	38,93	—	45,92	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	17,44	18,86	—	18,18	—
31 janvier 2022	—	19,87	22,21	—	21,16	—
31 janvier 2023	—	20,27	22,46	—	21,43	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2021	16,58	28,56	17,20	14,96	30,75	14,80
31 janvier 2022	17,51	31,95	19,88	14,33	35,13	17,23
31 janvier 2023	15,54	29,88	18,43	12,60	32,61	17,57
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (CHF)						
31 janvier 2021	—	14,58	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	17,54	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	16,81	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	15,23	12,39	14,61	12,88
31 janvier 2022	—	—	17,38	11,79	16,50	14,86
31 janvier 2023	—	—	15,50	10,09	14,78	14,67
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	23,65	24,82	13,55	24,09	13,62
31 janvier 2022	—	28,67	28,53	12,95	27,38	15,80
31 janvier 2023	—	28,03	25,78	11,21	24,81	15,78
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (USD)						
31 janvier 2021	18,52	16,02	—	—	—	—
31 janvier 2022	21,30	19,49	—	—	—	—
31 janvier 2023	20,18	19,42	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	9,95	—	13,09
31 janvier 2022	—	—	—	9,31	—	14,88
31 janvier 2023	—	—	—	7,94	—	14,71
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	299,46	—	—	—	—
31 janvier 2022	—	365,78	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	357,38	—	—	—	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023 :						

STATISTIQUES — (suite)	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund $	Global Credit Fund $	Global Equity Fund $	Global Equity Income Fund $
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	2,01	1,91	2,05	1,20	1,91	—
Frais sur encours - Catégorie A1 (GBP)	—	1,91	—	—	1,90	—
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	2,01	1,91	2,04	1,20	1,89	1,70
Frais sur encours - Catégorie AH1 (CHF)	—	1,94	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	—	—	—	1,20	1,93	1,70
Frais sur encours - Catégorie AH1 (USD)	2,05	1,93	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	—	—	—	1,20	—	1,70
Frais sur encours - Catégorie AH2 (EUR)	—	—	—	—	—	1,70
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,77	—	2,80	2,20	2,65	2,45
Frais sur encours - Catégorie CH1 (USD)	2,80	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	—	—	—	2,20	—	2,45
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	1,00	0,92	1,06	—	0,92	0,70
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	—	0,92	1,06	0,50	0,92	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	1,00	0,92	1,06	0,50	0,92	0,70
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	—	—	—	—	0,94	0,70
Frais sur encours - Catégorie IH1 (USD)	1,00	0,94	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IS1 (EUR)	0,80	0,77	—	—	0,76	—
Frais sur encours - Catégorie N1 (EUR)	—	2,41	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,51	2,41	2,55	1,70	2,40	2,20
Frais sur encours - Catégorie NH1 (USD)	2,55	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	—	—	—	1,70	—	2,20
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	—	—	2,05	—	1,91	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	—	—	2,05	—	1,90	—
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	—	—	2,15	—	2,05	—
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	—	—	1,00	—	1,00	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	1,25	1,16	1,30	—	1,16	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (GBP)	—	1,16	1,30	—	1,16	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	1,25	1,16	1,30	0,60	1,16	0,80
Frais sur encours - Catégorie WH1 (CHF)	—	1,25	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	—	—	1,34	0,60	1,21	0,80
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	—	1,22	1,35	0,60	1,19	0,80
Frais sur encours - Catégorie WH1 (USD)	1,25	1,20	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	—	—	—	0,60	—	0,80
Frais sur encours - Catégorie Z1 (EUR)	—	0,07	—	—	—	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023	(19)	21	(8)	135	(26)	79

STATISTIQUES	Global High Yield Fund $	Global Intrinsic Value Fund $	Global New Discovery Fund $	Global Opportunistic Bond Fund $	Global Research Focused Fund $	Global Strategic Equity Fund(b) $
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2021	369 233 336	132 488 079	3 496 670	800 137 145	155 505 663	—
31 janvier 2022	319 266 758	168 906 251	7 082 932	534 745 341	161 906 062	—
31 janvier 2023	237 646 971	95 532 751	6 075 335	348 722 124	137 565 041	2 422 063
Actions en circulation au 31 janvier 2023						
Catégorie A1 (EUR)	213 022	396 279	28 910	133 687	25 811	5 514
Catégorie A1 (USD)	2 195 860	2 915 441	242 950	9 340 980	2 106 827	5 870
Catégorie AH1 (EUR)	—	70 839	7 359	1 032 235	—	5 926
Catégorie A2 (EUR)	270 659	—	—	—	—	—
Catégorie A2 (USD)	10 414 447	—	—	754 677	—	—
Catégorie AH2 (EUR)	127 041	—	—	83 460	—	—
Catégorie C1 (USD)	1 407 994	707 016	44 754	3 666 993	226 133	5 873
Catégorie C2 (USD)	4 545 563	—	—	225 615	—	—
Catégorie I1 (EUR)	—	53 013	669	—	9 471	551
Catégorie I1 (GBP)	—	10 009	1 119	—	204	469
Catégorie I1 (JPY)	—	—	—	—	35 383	—
Catégorie I1 (USD)	33 867	53 196	16 000	723 665	45 088	16 500
Catégorie IH1 (EUR)	—	47 037	6 705	214 936	—	592
Catégorie IH1 (GBP)	—	—	—	115 506	—	—
Catégorie IH1 (JPY)	—	—	—	886	21 476	—
Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	4 554	—	—
Catégorie IH2 (GBP)	—	—	—	102 185	—	—
Catégorie I2 (USD)	—	—	—	9 930	—	—
Catégorie N1 (USD)	1 434 295	555 287	40 391	3 059 798	43 350	5 872
Catégorie N2 (USD)	931 972	—	—	125 033	—	—
Catégorie P1 (EUR)	—	104 145	—	134 468	—	—
Catégorie P1 (USD)	—	—	—	21 005	—	—
Catégorie PH1 (EUR)	—	4 719	—	51 269	—	—
Catégorie S1 (USD)	223 943	—	—	—	222 163	—
Catégorie W1 (EUR)	—	33 817	—	57 077	—	—
Catégorie W1 (GBP)	—	75 265	5 085	—	—	—
Catégorie W1 (USD)	433 219	51 402	9 320	1 815 378	68 649	5 867
Catégorie WH1 (EUR)	6 316	12 140	8 149	72 512	—	5 922
Catégorie WH1 (GBP)	4 453	3 890	6 208	28 311	—	5 166
Catégorie W2 (USD)	312 977	—	—	83 713	—	—
Catégorie Z1 (USD)	—	—	—	500	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2021	19,63	13,11	10,26	10,89	25,27	—
31 janvier 2022	21,21	15,51	11,36	11,34	30,36	—
31 janvier 2023	20,78	14,59	10,23	10,92	28,12	10,10
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2021	32,66	14,10	10,31	11,92	42,08	—
31 janvier 2022	32,67	15,44	10,57	11,50	46,80	—
31 janvier 2023	30,98	14,05	9,21	10,70	41,95	10,44

STATISTIQUES — (suite)	Global High Yield Fund $	Global Intrinsic Value Fund $	Global New Discovery Fund $	Global Opportunistic Bond Fund $	Global Research Focused Fund $	Global Strategic Equity Fund(b) $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	13,47	10,29	10,74	—	—
31 janvier 2022	—	14,60	10,42	10,24	—	—
31 janvier 2023	—	12,84	8,77	9,30	—	10,13
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (EUR)						
31 janvier 2021	12,23	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	12,73	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	11,93	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2021	5,99	—	—	10,90	—	—
31 janvier 2022	5,77	—	—	10,31	—	—
31 janvier 2023	5,23	—	—	9,36	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH2 (EUR)						
31 janvier 2021	9,35	—	—	9,81	—	—
31 janvier 2022	8,91	—	—	9,19	—	—
31 janvier 2023	7,88	—	—	8,15	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2021	26,12	13,89	10,30	11,40	35,28	—
31 janvier 2022	25,87	15,10	10,48	10,89	38,94	—
31 janvier 2023	24,29	13,64	9,06	10,03	34,65	10,38
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2021	6,05	—	—	10,88	—	—
31 janvier 2022	5,83	—	—	10,29	—	—
31 janvier 2023	5,29	—	—	9,34	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	134,06	102,80	—	311,53	—
31 janvier 2022	—	160,38	114,95	—	378,37	—
31 janvier 2023	—	152,47	104,59	—	354,34	101,78
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	134,78	101,11	—	315,09	—
31 janvier 2022	—	152,06	106,64	—	360,93	—
31 janvier 2023	—	152,62	102,42	—	356,82	106,24
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (JPY)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	17 266	—
31 janvier 2022	—	—	—	—	21 329	—
31 janvier 2023	—	—	—	—	21 863	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2021	235,01	144,09	103,30	122,89	308,74	—
31 janvier 2022	236,97	159,58	106,94	119,33	347,15	—
31 janvier 2023	226,55	146,81	94,15	111,80	314,60	105,01
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	137,68	103,07	110,81	—	—
31 janvier 2022	—	150,76	105,38	106,57	—	—
31 janvier 2023	—	133,84	88,70	97,73	—	101,76

STATISTIQUES — (suite)	Global High Yield Fund $	Global Intrinsic Value Fund $	Global New Discovery Fund $	Global Opportunistic Bond Fund $	Global Research Focused Fund $	Global Strategic Equity Fund(b) $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	—	115,84	—	—
31 janvier 2022	—	—	—	112,19	—	—
31 janvier 2023	—	—	—	103,79	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (JPY)						
31 janvier 2021	—	—	—	10 435	15 748	—
31 janvier 2022	—	—	—	10 097	17 630	—
31 janvier 2023	—	—	—	9 204	15 445	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH2 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	107,71	—	—
31 janvier 2022	—	—	—	100,59	—	—
31 janvier 2023	—	—	—	89,33	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH2 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	—	112,28	—	—
31 janvier 2022	—	—	—	105,92	—	—
31 janvier 2023	—	—	—	95,23	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	119,53	—	—
31 janvier 2022	—	—	—	113,04	—	—
31 janvier 2023	—	—	—	102,68	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)						
31 janvier 2021	13,24	13,95	10,30	11,65	15,45	—
31 janvier 2022	13,18	15,21	10,52	11,18	17,10	—
31 janvier 2023	12,44	13,77	9,12	10,36	15,25	10,40
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2021	9,50	—	—	10,89	—	—
31 janvier 2022	9,15	—	—	10,30	—	—
31 janvier 2023	8,30	—	—	9,35	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	13,10	—	10,90	—	—
31 janvier 2022	—	15,50	—	11,35	—	—
31 janvier 2023	—	14,58	—	10,92	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	11,92	—	—
31 janvier 2022	—	—	—	11,49	—	—
31 janvier 2023	—	—	—	10,70	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	13,46	—	10,73	—	—
31 janvier 2022	—	14,58	—	10,25	—	—
31 janvier 2023	—	12,79	—	9,34	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2021	15,15	—	—	—	51,20	—
31 janvier 2022	15,23	—	—	—	57,43	—
31 janvier 2023	14,51	—	—	—	51,91	—

STATISTIQUES — (suite)	Global High Yield Fund $	Global Intrinsic Value Fund $	Global New Discovery Fund $	Global Opportunistic Bond Fund $	Global Research Focused Fund $	Global Strategic Equity Fund(b) $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	13,38	—	11,08	—	—
31 janvier 2022	—	15,99	—	11,61	—	—
31 janvier 2023	—	15,19	—	11,23	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	13,45	10,11	—	—	—
31 janvier 2022	—	15,15	10,65	—	—	—
31 janvier 2023	—	15,19	10,22	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2021	19,71	14,36	10,33	12,23	27,90	—
31 janvier 2022	19,85	15,90	10,68	11,85	31,33	—
31 janvier 2023	18,96	14,61	9,39	11,11	28,37	10,51
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2021	12,48	13,74	10,30	11,05	—	—
31 janvier 2022	12,51	15,02	10,53	10,63	—	—
31 janvier 2023	11,68	13,31	8,95	9,69	—	10,17
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2021	12,50	13,84	10,31	11,51	—	—
31 janvier 2022	12,55	15,22	10,60	11,13	—	—
31 janvier 2023	11,89	13,64	9,11	10,38	—	10,22
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2021	9,69	—	—	10,86	—	—
31 janvier 2022	9,33	—	—	10,28	—	—
31 janvier 2023	8,47	—	—	9,33	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	125,57	—	—
31 janvier 2022	—	—	—	122,38	—	—
31 janvier 2023	—	—	—	115,25	—	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023 :						
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	1,40	1,85	1,85	1,20	1,85	1,85(e)
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,40	1,85	1,85	1,20	1,85	1,85(e)
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	—	1,85	1,85	1,20	—	1,85(e)
Frais sur encours - Catégorie A2 (EUR)	1,40	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	1,40	—	—	1,20	—	—
Frais sur encours - Catégorie AH2 (EUR)	1,40	—	—	1,20	—	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,40	2,60	2,60	2,20	2,60	2,60(e)
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	2,40	—	—	2,20	—	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	—	0,75	0,85	—	0,75	0,75(e)
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	—	0,75	0,85	—	0,75	0,75(e)
Frais sur encours - Catégorie I1 (JPY)	—	—	—	—	0,75	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,60	0,75	0,85	0,55	0,75	0,75(e)
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	—	0,75	0,85	0,55	—	0,75(e)
Frais sur encours - Catégorie IH1 (GBP)	—	—	—	0,55	—	—
Frais sur encours - Catégorie IH1 (JPY)	—	—	—	0,55	0,75	—
Frais sur encours - Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	0,55	—	—

STATISTIQUES — (suite)	Global High Yield Fund $	Global Intrinsic Value Fund $	Global New Discovery Fund $	Global Opportunistic Bond Fund $	Global Research Focused Fund $	Global Strategic Equity Fund(b) $
Frais sur encours - Catégorie IH2 (GBP)	—	—	—	0,55	—	—
Frais sur encours - Catégorie I2 (USD)	—	—	—	0,55	—	—
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	1,90	2,35	2,35	1,70	2,35	2,35(e)
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	1,90	—	—	1,70	—	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	—	1,85	—	1,20	—	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	—	—	—	1,20	—	—
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	—	1,85	—	1,20	—	—
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	0,94	—	—	—	1,00	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	—	0,85	—	0,65	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (GBP)	—	0,85	0,95	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	0,70	0,85	0,95	0,65	0,85	0,85(e)
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	0,70	0,85	0,95	0,65	—	0,85(e)
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	0,70	0,85	0,95	0,65	—	0,85(e)
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	0,70	—	—	0,65	—	—
Frais sur encours - Catégorie Z1 (USD)	—	—	—	0,10	—	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023	18	(7)	43	217	15	21(f)

(b) Le compartiment a commencé ses activités le 18 mai 2022.
(e) Annualisés.
(f) Non annualisés.

STATISTIQUES	Global Total Return Fund $	Inflation-Adjusted Bond Fund $	Japan Equity Fund(c) ¥	Latin American Equity Fund(d) $	Limited Maturity Fund $	Managed Wealth Fund $
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2021	1 901 420 514	190 351 118	4 174 135	5 740 559	1 144 385 617	11 984 774
31 janvier 2022	1 921 098 164	276 944 572	4 486 493	4 170 097	981 111 512	20 213 212
31 janvier 2023	1 693 918 338	208 170 499	374 401 338	4 336 635	858 924 626	19 263 694
Actions en circulation au 31 janvier 2023						
Catégorie A1 (EUR)	7 758 179	—	28 060	18 714	732 240	—
Catégorie A1 (GBP)	504 445	—	—	—	—	—
Catégorie A1 (USD)	15 407 157	7 377 989	86 629	83 480	29 955 425	803 819
Catégorie AH1 (EUR)	1 504 559	—	—	—	—	6 445
Catégorie A2 (USD)	3 759 200	1 150 086	—	—	2 536 985	—
Catégorie AH2 (EUR)	215 893	—	—	—	—	—
Catégorie A4 (EUR)	38 197	—	—	—	—	—
Catégorie AH4 (EUR)	9 252	—	—	—	—	—
Catégorie C1 (USD)	6 706 061	2 012 330	8 292	35 263	6 315 604	20 745
Catégorie C2 (USD)	2 467 161	461 241	—	—	2 723 535	—
Catégorie I1 (EUR)	—	—	223	288	—	442
Catégorie I1 (GBP)	5 480	—	151	836	—	322
Catégorie I1 (JPY)	—	—	660	—	—	—
Catégorie I1 (USD)	821 355	81 849	2 865	2 391	903 116	97 472
Catégorie IH1 (EUR)	40 777	126 806	—	—	—	624
Catégorie N1 (USD)	7 830 547	1 134 713	5 251	150 731	4 579 887	47 373
Catégorie N2 (USD)	122 645	144 258	—	—	252 302	—
Catégorie P1 (EUR)	7 689	—	—	—	—	5 605
Catégorie P1 (USD)	1 559	—	—	—	—	5 935
Catégorie PH1 (EUR)	8 691	—	—	—	—	14 507
Catégorie S1 (USD)	404 638	75 817	—	—	860 316	—
Catégorie W1 (EUR)	431 397	—	—	—	—	—
Catégorie W1 (USD)	3 772 088	795 800	51 693	26 755	7 770 542	12 229
Catégorie WH1 (EUR)	403 024	—	—	8 917	—	6 329
Catégorie WH1 (GBP)	123 450	—	—	39 738	—	5 190
Catégorie W2 (USD)	714 091	124 565	—	—	988 656	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2021	21,76	—	16,78	17,05	12,74	—
31 janvier 2022	25,01	—	16,64	19,28	13,51	—
31 janvier 2023	24,39	—	15,34	19,87	13,57	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (GBP)						
31 janvier 2021	13,44	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	14,58	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	15,00	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2021	38,31	16,69	14,90	15,27	15,46	9,66
31 janvier 2022	40,77	16,96	13,67	16,00	15,19	9,72
31 janvier 2023	38,47	15,54	12,20	14,99	14,76	9,64

STATISTIQUES — (suite)	Global Total Return Fund $	Inflation-Adjusted Bond Fund $	Japan Equity Fund(c) ¥	Latin American Equity Fund(d) $	Limited Maturity Fund $	Managed Wealth Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2021	11,64	—	—	—	—	8,70
31 janvier 2022	12,27	—	—	—	—	8,65
31 janvier 2023	11,24	—	—	—	—	8,39
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2021	30,45	11,95	—	—	8,91	—
31 janvier 2022	32,26	11,68	—	—	8,65	—
31 janvier 2023	30,17	9,93	—	—	8,26	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH2 (EUR)						
31 janvier 2021	11,26	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	11,85	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	10,75	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A4 (EUR)						
31 janvier 2021	11,03	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	12,64	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	12,24	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH4 (EUR)						
31 janvier 2021	11,56	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	12,15	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	11,04	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2021	32,50	14,10	13,52	13,97	12,57	9,27
31 janvier 2022	34,30	14,17	12,32	14,53	12,21	9,26
31 janvier 2023	32,10	12,84	10,91	13,57	11,74	9,12
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2021	29,48	11,81	—	—	8,84	—
31 janvier 2022	31,11	11,50	—	—	8,59	—
31 janvier 2023	29,06	9,78	—	—	8,20	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	195,44	192,71	—	94,75
31 janvier 2022	—	—	195,88	220,32	—	103,88
31 janvier 2023	—	—	182,61	227,95	—	107,61
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2021	298,35	—	247,75	83,76	—	116,05
31 janvier 2022	326,77	—	234,20	90,32	—	119,99
31 janvier 2023	339,69	—	230,48	93,88	—	131,10
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (JPY)						
31 janvier 2023	—	—	10 124(a)	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2021	260,86	172,09	173,64	172,50	145,99	102,60
31 janvier 2022	280,40	175,70	161,11	182,53	144,29	104,14
31 janvier 2023	267,23	161,70	145,34	171,80	141,16	104,29
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2021	126,89	—	—	—	—	92,67
31 janvier 2022	134,97	—	—	—	—	93,22
31 janvier 2023	124,71	97,72(a)	—	—	—	91,00

STATISTIQUES — (suite)	Global Total Return Fund $	Inflation-Adjusted Bond Fund $	Japan Equity Fund(c) ¥	Latin American Equity Fund(d) $	Limited Maturity Fund $	Managed Wealth Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)						
31 janvier 2021	14,57	10,62	14,98	6,42	10,58	9,40
31 janvier 2022	15,42	10,72	13,68	6,69	10,33	9,40
31 janvier 2023	14,46	9,76	12,14	6,25	9,98	9,28
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2021	13,32	9,91	—	—	9,96	—
31 janvier 2022	14,09	9,73	—	—	9,67	—
31 janvier 2023	13,17	8,25	—	—	9,23	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2021	21,75	—	—	—	—	8,43
31 janvier 2022	25,00	—	—	—	—	9,15
31 janvier 2023	24,38	—	—	—	—	9,38
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2021	38,32	—	—	—	—	9,67
31 janvier 2022	40,78	—	—	—	—	9,72
31 janvier 2023	38,48	—	—	—	—	9,64
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2021	11,63	—	—	—	—	8,67
31 janvier 2022	12,24	—	—	—	—	8,64
31 janvier 2023	11,17	—	—	—	—	8,35
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2021	41,21	17,20	—	—	13,88	—
31 janvier 2022	44,22	17,54	—	—	13,69	—
31 janvier 2023	42,08	16,11	—	—	13,35	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2021	12,61	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	14,59	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	14,32	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2021	20,80	14,19	14,88	9,17	12,30	10,21
31 janvier 2022	22,28	14,48	13,79	9,70	12,15	10,35
31 janvier 2023	21,16	13,32	12,43	9,12	11,87	10,39
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2021	12,50	—	—	12,17	—	9,24
31 janvier 2022	13,26	—	—	12,69	—	9,28
31 janvier 2023	12,22	—	—	12,22	—	9,05
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2021	13,85	—	—	7,45	—	9,65
31 janvier 2022	14,79	—	—	7,80	—	9,77
31 janvier 2023	13,83	—	—	7,33	—	9,69
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2021	15,09	9,81	—	—	9,93	—
31 janvier 2022	15,99	9,38	—	—	9,65	—
31 janvier 2023	14,95	7,99	—	—	9,21	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023 :						

STATISTIQUES — (suite)	Global Total Return Fund $	Inflation-Adjusted Bond Fund $	Japan Equity Fund(c) ¥	Latin American Equity Fund(d) $	Limited Maturity Fund $	Managed Wealth Fund $
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	1,83	—	1,85	—	1,15	—
Frais sur encours - Catégorie A1 (GBP)	1,83	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,83	0,98	1,85	—	1,14	1,87
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	1,87	—	—	—	—	1,87
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	1,82	0,98	—	—	1,13	—
Frais sur encours - Catégorie AH2 (EUR)	1,91	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie A4 (EUR)	1,84	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie AH4 (EUR)	1,95	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,68	2,08	2,60	—	2,24	2,62
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	2,68	2,08	—	—	2,24	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	—	—	0,75	—	—	0,91
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	0,84	—	0,75	—	—	0,92
Frais sur encours - Catégorie I1 (JPY)	—	—	0,75(e)	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,84	0,50	0,75	—	0,50	0,92
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	0,90	0,50(e)	—	—	—	0,92
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,43	1,58	2,35	—	1,74	2,38
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	2,43	1,58	—	—	1,74	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	1,83	—	—	—	—	1,87
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	1,83	—	—	—	—	1,87
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	1,95	—	—	—	—	1,87
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	1,00	0,66	—	—	0,70	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	1,18	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	1,18	0,58	0,85	—	0,60	1,02
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	1,23	—	—	—	—	1,02
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	1,23	—	—	—	—	1,02
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	1,18	0,58	—	—	0,60	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023	106	95	12	—	(17)	54

(a) Pour de plus amples informations, voir la Note 18.
(c) À compter du 7 juin 2022, la devise de référence du Japan Equity Fund a été modifiée, passant du dollar américain au yen japonais. Toutes les valeurs nettes d'inventaire et les valeurs nettes d'inventaire par action de l'exercice précédent sont exprimées en dollars américains.
(d) Le compartiment a cessé ses activités le 28 juin 2022. Les informations pour la période actuelle sont valables au 28 juin 2022 et les informations de la fin de période publiées sont valables à compter de cette date.
(e) Annualisés.

STATISTIQUES	Prudent Capital Fund $	Prudent Wealth Fund $	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund $	U.S. Corporate Bond Fund $	U.S. Government Bond Fund $
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2021	4 669 023 979	5 027 903 661	18 522 299	567 453 413	814 558 187	408 181 589
31 janvier 2022	5 308 833 585	4 982 416 168	24 127 159	530 284 123	435 210 111	304 900 123
31 janvier 2023	3 832 329 146	3 572 470 531	21 853 803	456 301 825	399 977 381	346 661 165
Actions en circulation au 31 janvier 2023						
Catégorie A1 (EUR)	40 456 218	35 519 539	—	—	—	4 732 221
Catégorie A1 (GBP)	—	—	409 782	—	—	—
Catégorie A1 (USD)	87 238 743	45 725 247	502 428	7 389 003	8 899 128	5 199 279
Catégorie AH1 (CHF)	35 460	—	—	—	—	—
Catégorie AH1 (EUR)	16 248 412	21 989 673	—	—	155 408	5 051 505
Catégorie A2 (USD)	—	—	—	—	4 246 927	2 217 468
Catégorie A4 (EUR)	4 082 469	—	—	—	—	—
Catégorie AH4 (EUR)	279 611	—	—	—	—	—
Catégorie C1 (USD)	38 999 254	19 636 202	323 878	2 222 206	5 227 610	718 890
Catégorie C2 (USD)	—	—	—	—	1 368 107	206 894
Catégorie I1 (EUR)	2 240 221	854 123	—	—	—	—
Catégorie I1 (GBP)	156 663	15 787	12 323	728	—	—
Catégorie I1 (USD)	2 016 812	426 610	262 959	50 781	795 500	262 542
Catégorie IH1 (EUR)	1 587 751	2 419 952	—	—	19 874	—
Catégorie IH1R (USD)	87 028	—	—	—	—	—
Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	—	—	246 484
Catégorie I2 (GBP)	—	—	1 593	—	—	—
Catégorie N1 (USD)	18 608 899	12 104 533	100 912	1 159 169	1 965 075	551 399
Catégorie N2 (USD)	—	—	—	—	436 875	72 197
Catégorie P1 (EUR)	4 520 642	—	—	—	—	—
Catégorie P1 (USD)	742 838	—	—	—	—	—
Catégorie PH1 (EUR)	1 573 074	—	—	—	—	—
Catégorie S1 (USD)	439	—	—	1 033 920	—	312 474
Catégorie W1 (EUR)	6 464 664	622 994	—	—	—	—
Catégorie W1 (GBP)	463 797	281 414	48 137	—	—	—
Catégorie W1 (USD)	12 243 703	6 659 933	10 877	776 633	3 466 059	2 229 640
Catégorie WH1 (CHF)	191 692	—	—	—	—	—
Catégorie WH1 (EUR)	3 564 056	2 925 601	—	6 029	374 010	—
Catégorie WH1 (GBP)	442 949	265 204	—	15 003	202 739	—
Catégorie W2 (GBP)	—	—	10 734	—	—	—
Catégorie W2 (USD)	—	—	—	—	785 213	348 074
Catégorie ZH1 (JPY)	84 066	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2021	12,29	22,39	—	—	—	11,74
31 janvier 2022	13,36	24,65	—	—	—	12,25
31 janvier 2023	12,71	22,74	—	—	—	11,57
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	9,37	—	—	—
31 janvier 2022	—	—	10,66	—	—	—
31 janvier 2023	—	—	10,80	—	—	—

STATISTIQUES — (suite)	Prudent Capital Fund $	Prudent Wealth Fund $	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund $	U.S. Corporate Bond Fund $	U.S. Government Bond Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2021	13,43	21,80	16,38	32,46	13,66	19,15
31 janvier 2022	13,52	22,22	18,30	38,57	13,10	18,50
31 janvier 2023	12,44	19,84	17,00	34,50	11,74	16,90
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (CHF)						
31 janvier 2021	9,90	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	9,83	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	8,73	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2021	12,17	15,54	—	—	12,14	12,15
31 janvier 2022	12,13	15,68	—	—	11,53	11,62
31 janvier 2023	10,84	13,57	—	—	10,05	10,33
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	11,22	10,75
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,55	10,27
31 janvier 2023	—	—	—	—	9,19	9,21
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A4 (EUR)						
31 janvier 2021	11,79	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	12,81	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	12,16	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH4 (EUR)						
31 janvier 2021	12,30	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	12,26	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	10,91	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2021	13,01	19,63	9,55	27,56	12,61	15,54
31 janvier 2022	13,00	19,86	10,60	32,49	11,97	14,85
31 janvier 2023	11,87	17,60	9,77	28,83	10,62	13,42
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	11,23	10,77
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,56	10,29
31 janvier 2023	—	—	—	—	9,20	9,22
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2021	128,89	247,24	—	—	—	—
31 janvier 2022	141,69	274,90	—	—	—	—
31 janvier 2023	136,21	256,14	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2021	126,83	255,85	213,67	518,92	—	—
31 janvier 2022	131,49	268,29	245,88	634,30	—	—
31 janvier 2023	133,45	263,90	251,85	624,76	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2021	140,83	243,29	11,46	438,60	144,23	173,91
31 janvier 2022	143,32	250,41	12,94	526,26	139,36	168,85
31 janvier 2023	133,33	225,79	12,15	475,16	125,80	154,99

STATISTIQUES — (suite)	Prudent Capital Fund $	Prudent Wealth Fund $	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund $	U.S. Corporate Bond Fund $	U.S. Government Bond Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2021	126,95	169,11	—	—	189,89	—
31 janvier 2022	127,97	172,39	—	—	181,89	—
31 janvier 2023	115,78	151,13	—	—	160,25	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1R (USD)						
31 janvier 2021	107,67	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	117,71	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	125,35	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH2 (EUR)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	—	133,91
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	126,94
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	111,03
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I2 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	122,57	—	—	—
31 janvier 2022	—	—	131,31	—	—	—
31 janvier 2023	—	—	129,93	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)						
31 janvier 2021	13,14	16,81	9,99	26,00	13,12	10,98
31 janvier 2022	13,16	17,04	11,11	30,73	12,52	10,55
31 janvier 2023	12,05	15,14	10,27	27,34	11,16	9,58
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	11,23	9,91
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,56	9,47
31 janvier 2023	—	—	—	—	9,20	8,48
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2021	12,29	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	13,36	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	12,71	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2021	13,43	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	13,52	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	12,44	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2021	12,12	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	12,07	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	10,80	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2021	140,24	—	—	39,91	—	17,25
31 janvier 2022	142,44	—	—	47,92	—	16,72
31 janvier 2023	132,28	—	—	43,29	—	15,33
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2021	12,65	22,89	—	—	—	—
31 janvier 2022	13,90	25,39	—	—	—	—
31 janvier 2023	13,35	23,61	—	—	—	—

STATISTIQUES — (suite)	Prudent Capital Fund $	Prudent Wealth Fund $	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund $	U.S. Corporate Bond Fund $	U.S. Government Bond Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (GBP)						
31 janvier 2021	12,63	16,73	16,71	—	—	—
31 janvier 2022	13,08	17,51	19,21	—	—	—
31 janvier 2023	13,26	17,18	19,66	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2021	14,03	21,21	10,98	42,23	14,29	13,38
31 janvier 2022	14,27	21,78	12,39	50,63	13,80	12,98
31 janvier 2023	13,26	19,60	11,60	45,68	12,44	11,91
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (CHF)						
31 janvier 2021	9,91	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	9,94	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	8,94	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2021	12,78	13,59	—	19,31	12,01	—
31 janvier 2022	12,89	13,80	—	22,91	11,50	—
31 janvier 2023	11,63	12,06	—	19,92	10,13	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2021	13,15	20,68	—	30,60	12,75	—
31 janvier 2022	13,31	21,14	—	36,48	12,28	—
31 janvier 2023	12,17	18,70	—	32,05	10,97	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (GBP)						
31 janvier 2021	—	—	12,30	—	—	—
31 janvier 2022	—	—	13,61	—	—	—
31 janvier 2023	—	—	13,51	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2021	—	—	—	—	11,27	9,72
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,58	9,29
31 janvier 2023	—	—	—	—	9,21	8,32
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ZH1 (JPY)						
31 janvier 2021	11 581	—	—	—	—	—
31 janvier 2022	11 842	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	10 716	—	—	—	—	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023 :						
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	1,91	2,00	—	—	—	0,98
Frais sur encours - Catégorie A1 (GBP)	—	—	1,85	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,90	2,00	1,85	2,03	1,25	0,98
Frais sur encours - Catégorie AH1 (CHF)	2,05	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	1,92	2,02	—	—	1,25	0,98
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	—	—	—	—	1,25	0,97
Frais sur encours - Catégorie A4 (EUR)	1,91	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie AH4 (EUR)	2,02	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,66	2,75	2,60	2,81	2,25	2,08
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	—	—	—	—	2,25	2,08
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	0,82	1,01	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	0,82	1,01	0,75	1,07	—	—

STATISTIQUES — (suite)	Prudent Capital Fund $	Prudent Wealth Fund $	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund $	U.S. Corporate Bond Fund $	U.S. Government Bond Fund $
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,82	1,01	0,75	1,07	0,50	0,50
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	0,84	1,03	—	—	0,50	—
Frais sur encours - Catégorie IH1R (USD)	0,83	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	—	—	0,50
Frais sur encours - Catégorie I2 (GBP)	—	—	0,75	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,41	2,50	2,35	2,56	1,75	1,58
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	—	—	—	—	1,75	1,58
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	1,91	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	1,91	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	1,94	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	1,00	—	—	1,00	—	0,65
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	0,91	1,25	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (GBP)	0,91	1,25	0,85	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	0,90	1,25	0,85	1,15	0,60	0,58
Frais sur encours - Catégorie WH1 (CHF)	1,00	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	0,93	1,28	—	1,15	0,60	—
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	0,95	1,30	—	1,15	0,60	—
Frais sur encours - Catégorie W2 (GBP)	—	—	0,85	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	—	—	—	—	0,60	0,58
Frais sur encours - Catégorie ZH1 (JPY)	0,11	—	—	—	—	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023	61	41	13	41	45	226

STATISTIQUES	U.S. Growth Fund $	U.S. Total Return Bond Fund $	U.S. Value Fund $
Valeur nette d'inventaire			
31 janvier 2021	63 496 168	689 382 247	1 958 083 066
31 janvier 2022	54 610 058	604 718 147	2 494 488 317
31 janvier 2023	46 029 396	443 230 862	2 206 675 204
Actions en circulation au 31 janvier 2023			
Catégorie A1 (USD)	876 487	6 648 443	24 696 598
Catégorie AH1 (EUR)	5 213	65 121	897 857
Catégorie A2 (USD)	—	2 154 771	—
Catégorie C1 (USD)	359 043	1 819 123	5 980 835
Catégorie C2 (USD)	—	1 079 422	—
Catégorie I1 (EUR)	582	—	66 420
Catégorie I1 (GBP)	414	—	8 153
Catégorie I1 (USD)	97 648	1 000 978	1 101 291
Catégorie IH1 (EUR)	447	412 698	49 468
Catégorie N1 (USD)	258 326	1 069 325	4 773 463
Catégorie N2 (USD)	—	262 303	—
Catégorie P1 (USD)	—	—	6 791
Catégorie PH1 (EUR)	—	—	2 562
Catégorie S1 (USD)	—	174 504	843 210
Catégorie W1 (USD)	9 632	1 841 642	12 824 926
Catégorie WH1 (EUR)	6 038	4 730	1 510 885
Catégorie WH1 (GBP)	4 140	4 928	75 654
Catégorie W2 (USD)	—	931 518	—
Catégorie Z1 (USD)	114 664	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)			
31 janvier 2021	13,64	20,23	31,49
31 janvier 2022	15,30	19,62	38,17
31 janvier 2023	12,43	17,79	37,47
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)			
31 janvier 2021	13,25	10,62	19,18
31 janvier 2022	14,72	10,21	23,03
31 janvier 2023	11,53	9,03	21,91
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)			
31 janvier 2021	—	11,12	—
31 janvier 2022	—	10,61	—
31 janvier 2023	—	9,38	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)			
31 janvier 2021	13,48	16,70	26,92
31 janvier 2022	15,01	16,03	32,39
31 janvier 2023	12,10	14,39	31,56
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)			
31 janvier 2021	—	11,12	—
31 janvier 2022	—	10,62	—
31 janvier 2023	—	9,39	—

STATISTIQUES — (suite)	U.S. Growth Fund $	U.S. Total Return Bond Fund $	U.S. Value Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)			
31 janvier 2021	126,68	—	286,82
31 janvier 2022	155,19	—	379,66
31 janvier 2023	131,72	—	389,34
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)			
31 janvier 2021	123,22	—	375,18
31 janvier 2022	142,37	—	468,37
31 janvier 2023	127,53	—	507,03
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)			
31 janvier 2021	138,61	194,96	300,68
31 janvier 2022	157,21	190,33	368,46
31 janvier 2023	129,09	173,86	365,64
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)			
31 janvier 2021	134,76	110,66	212,11
31 janvier 2022	151,38	107,13	257,38
31 janvier 2023	119,64	95,38	247,88
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)			
31 janvier 2021	13,55	12,19	18,22
31 janvier 2022	15,12	11,76	21,98
31 janvier 2023	12,22	10,61	21,46
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)			
31 janvier 2021	—	10,59	—
31 janvier 2022	—	10,10	—
31 janvier 2023	—	8,93	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)			
31 janvier 2021	—	—	31,48
31 janvier 2022	—	—	38,19
31 janvier 2023	—	—	37,48
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)			
31 janvier 2021	—	—	19,21
31 janvier 2022	—	—	23,04
31 janvier 2023	—	—	21,97
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)			
31 janvier 2021	—	19,29	39,50
31 janvier 2022	—	18,80	48,32
31 janvier 2023	—	17,14	47,86
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)			
31 janvier 2021	13,84	15,75	28,94
31 janvier 2022	15,68	15,37	35,44
31 janvier 2023	12,86	14,02	35,13
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)			
31 janvier 2021	13,46	11,27	13,38
31 janvier 2022	15,10	10,91	16,22
31 janvier 2023	11,92	9,70	15,58

STATISTIQUES — (suite)	U.S. Growth Fund $	U.S. Total Return Bond Fund $	U.S. Value Fund $
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)			
31 janvier 2021	13,45	11,71	23,22
31 janvier 2022	15,19	11,40	28,29
31 janvier 2023	12,13	10,31	27,44
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)			
31 janvier 2021	—	10,60	—
31 janvier 2022	—	10,11	—
31 janvier 2023	—	8,93	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (USD)			
31 janvier 2021	133,86	—	—
31 janvier 2022	152,89	—	—
31 janvier 2023	126,42	—	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023 :			
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,85	1,20	1,91
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	1,85	1,20	1,95
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	—	1,20	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,60	2,20	2,66
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	—	2,20	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	0,75	—	0,82
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	0,75	—	0,82
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,75	0,50	0,82
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	0,75	0,50	0,86
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,35	1,70	2,41
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	—	1,70	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	—	—	1,91
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	—	—	2,05
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	—	0,67	1,00
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	0,85	0,60	0,91
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	0,85	0,60	0,94
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	0,85	0,60	1,00
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	—	0,60	—
Frais sur encours - Catégorie Z1 (USD)	0,05	—	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023	23	192	(13)

Note 1 : Le Fonds

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

Le fonds est un « fonds à compartiments multiples », c'est-à-dire qu'il est composé de compartiments distincts qui correspondent chacun à un portefeuille de titres présentant des objectifs d'investissement spécifiques. Au 31 janvier 2023, il comptait 38 compartiments, tous rattachés à un portefeuille distinct constitué de titres, de liquidités et d'autres instruments. Chaque compartiment peut offrir plusieurs types de catégories d'actions, qui peuvent se différencier selon leur montant de souscription minimum, leur montant de participation minimum, leur devise et/ou leurs critères d'éligibilité, leurs commissions et frais et leur politique en matière de dividendes. Le fonds peut être proposé à la vente dans les États membres de l'Espace économique européen (« EEE »), sous réserve d'une notification dans les autres pays que le Grand-Duché de Luxembourg, et dans certaines juridictions sous réserve de respecter les exigences locales concernant l'offre. Veuillez garder à l'esprit que tous les compartiments et toutes les catégories ne sont pas nécessairement enregistrés ou autorisés à la distribution dans toutes les juridictions. La liste des catégories d'actions offertes pour chaque compartiment au 31 janvier 2023 figure à la rubrique « Statistiques » du présent rapport.

Note 2 : Résumé des règles et méthodes comptables importantes

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

D) *Conversion des devises* – Les achats et cessions de placements étrangers, ainsi que les revenus et charges initialement exprimés en devises étrangères, sont convertis chaque jour ouvré dans la devise de référence de chaque compartiment, sur la base des taux de change en vigueur aux dates respectives de telles transactions ou, pour les créances et les engagements libellés en devises étrangères, à la date d'arrêté des états financiers. La devise de référence des compartiments Blended Research European Equity Fund, Continental European Equity Fund, Euro Credit Fund, European Core Equity Fund, European Research Fund, European Smaller Companies Fund et European Value Fund est l'euro. La devise de référence du U.K. Equity Fund est la livre sterling. À compter du 7 juin 2022, la devise de référence du Japan Equity Fund a été modifiée, passant de l'USD au JPY. La devise de référence de chacun des autres compartiments est le dollar US. Les plus-values et moins-values imputables aux taux de change sur les ventes de titres et aux fluctuations des taux de change sur les créances, les dettes, les revenus et les charges sont comptabilisées pour les besoins des états financiers comme des plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change. La part des plus-values et moins-values tant réalisées que non réalisées sur les placements qui résulte des fluctuations des taux de change n'est pas comptabilisée séparément.

E) *Coût des titres vendus* – Pour déterminer le coût des titres vendus, chaque compartiment utilise la méthode du coût identifié.

F) *Exigences en matière de garanties au titre des instruments dérivés* – Le risque de crédit des contreparties aux instruments dérivés est géré au moyen d'une évaluation formelle de la solvabilité de toutes les contreparties potentielles. S'agissant de certains instruments dérivés non compensés, mais non de tous, le compartiment concerné tente de réduire son exposition au risque de crédit lié aux contreparties en concluant un contrat-cadre de l'International Swaps and Derivatives Association (ISDA) sur une base bilatérale, au niveau du compartiment. Le contrat-cadre de l'ISDA permet à chaque partie au contrat de résilier toutes les opérations négociées au titre de ce contrat si la qualité de crédit de l'autre partie venait à se détériorer d'une manière qui aura été définie au préalable. En cas de défaut de la contrepartie ou de résiliation du contrat-cadre de l'ISDA, la partie non défaillante a le droit de dénouer toutes les opérations négociées au titre de ce contrat et de compenser les montants exigibles au titre de chaque contrat en un montant net payable par une partie à l'autre. Ce droit de dénouer et de compenser les paiements sur l'ensemble des opérations négociées au titre du contrat- cadre de l'ISDA pourrait entraîner une réduction du risque de crédit du compartiment à l'égard de cette contrepartie égale à tous montants payables par le compartiment au titre des opérations applicables, le cas échéant. Ces droits de compensation peuvent être suspendus ou limités en cas d'insolvabilité de la contrepartie. Cependant, en l'absence de défaut de la contrepartie ou de résiliation du contrat-cadre de l'ISDA, les actifs et passifs portés au bilan au titre de l'ensemble des opérations conclues entre le compartiment et la contrepartie concernée ne feront pas l'objet d'une compensation en vertu de ce contrat.

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

compartiments peuvent être tenus d'effectuer des paiements d'intérêts sur les obligations en matière de marge ou de sûreté non couvertes vis-à-vis du courtier. Ces paiements sont comptabilisés dans les « Intérêts et charges assimilées » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Les garanties reçues consistent en des liquidités et/ou en des emprunts d'État de haute qualité et ne sont pas reportées dans les Bilans ou les Tableaux des investissements. Au 31 janvier 2023, les compartiments suivants avaient des liquidités isolées ou avaient reçu des liquidités et/ou des emprunts d'État de haute qualité à titre de garanties pour les instruments dérivés ouverts compensés et non compensés.

Compartiment	Liquidités isolées par le Compartiment (Numéraire soumis à restrictions)	Garantie reçue par le Compartiment	Dépôts auprès des courtiers pour des contrats à terme standardisés	Dépôts auprès des courtiers pour des swaps compensés
Diversified Income Fund	82 508 $	— $	9 167 $	— $
Emerging Markets Debt Fund	10 000 $	730 000 $	3 590 331 $	— $
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	920 $	— $	30 086 $	71 655 $
Euro Credit Fund	— €	248 356 €	249 120 €	425 000 €
European Research Fund	— €	386 331 €	— €	— €
European Smaller Companies Fund	— €	55 190 €	— €	— €
European Value Fund	— €	809 456 €	— €	— €
Global Credit Fund	— $	— $	191 073 $	447 670 $
Global Equity Fund	— $	794 138 $	— $	— $
Global High Yield Fund	— $	— $	37 895 $	— $
Global Opportunistic Bond Fund	2 309 996 $	270 000 $	3 465 446 $	946 285 $
Global Total Return Fund	1 920 000 $	— $	3 695 929 $	1 273 287 $
Inflation-Adjusted Bond Fund	— $	— $	90 350 $	— $
Limited Maturity Fund	— $	— $	95 000 $	1 712 852 $
Managed Wealth Fund	— $	— $	769 294 $	— $
Prudent Capital Fund	4 362 744 $	— $	7 483 074 $	— $
Prudent Wealth Fund	— $	13 620 000 $	11 002 904 $	— $
U.S. Corporate Bond Fund	— $	— $	659 812 $	— $
U.S. Government Bond Fund	— $	— $	1 271 400 $	— $
U.S. Total Return Bond Fund	— $	— $	947 700 $	— $

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

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

de la réglementation, pourraient contraindre le compartiment concerné à affecter des sommes plus importantes aux liquidités et instruments assimilés que celles que le Gestionnaire Financier aurait décidé d'allouer en temps normal. Cette situation pourrait nuire aux performances de l'ensemble du compartiment, même si les opérations sur instruments dérivés correspondantes concernent uniquement les Catégories d'Actions Couvertes. De plus amples informations sur les contrats de change à terme spécifiques à certaines catégories en cours figurent à la Note 11.

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

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

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

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

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

de liquidités ou de titres, sont détenues sur des comptes séparés auprès du dépositaire du compartiment dans le cadre de ces contrats. La garantie peut également être envoyée directement à certaines contreparties. Les garanties pour les swaps compensés, sous forme de liquidités ou de titres, sont directement déposées par le compartiment auprès du courtier de compensation.

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

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

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

L) *Contrats à terme standardisés* – Les compartiments peuvent conclure des contrats à terme standardisés, qu'ils peuvent utiliser pour obtenir une large exposition au marché, une exposition aux taux d'intérêt ou une exposition de change, ou une couverture contre ces expositions, ou pour gérer la duration. Un contrat à terme standardisé représente un engagement d'acheter ou de vendre un actif à un prix spécifié et à une date spécifiée. Au moment de conclure un contrat à terme standardisé, un compartiment est tenu de déposer auprès du courtier, soit en numéraire, soit en titres, une marge initiale d'un montant égal à un certain pourcentage du montant notionnel du contrat, ce qui soumet le compartiment au risque de contrepartie vis-à-vis du courtier de compensation et éventuellement de la chambre de compensation au titre de ce dépôt de garantie. Le compartiment exécute ou reçoit chaque jour les versements ultérieurs (marge de variation), en fonction des fluctuations quotidiennes de la valeur du contrat, et les comptabilise aux fins de l'établissement des états financiers comme des plus-values ou des moins-values non réalisées jusqu'au dénouement ou jusqu'à l'expiration du contrat, auquel moment la plus-value ou la moins-value sur le contrat à terme standardisé est réalisée. Lorsqu'il conclut de tels contrats, le compartiment assume le risque de fluctuations imprévues des taux d'intérêt, des taux de change ou des cours des titres, auquel cas il est possible que le compartiment ne réalise pas les bénéfices anticipés des contrats à terme et qu'il réalise une perte. Les contrats à terme standardisés ainsi que les montants de garantie fournis par un compartiment au titre de ceux-ci sont comptabilisés aux Bilans en tant que « Dépôts auprès des courtiers » et les informations y relatives figurent à la Note 13.

M) *Comptes combinés* – Les Bilans, Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net combinés sont présentés en euros au taux de change en vigueur au 31 janvier 2023. L'ajustement au titre de la conversion de devises concerne la reconversion des valeurs nettes d'inventaire de l'ouverture de la période comptable à ce taux de change. Les taux de change (USD/EUR) en vigueur le 31 janvier 2023 et le 31 janvier 2022 étaient respectivement de 0,919836 et de 0,890115. Les taux de change (GBP/EUR) en vigueur le 31 janvier 2023 et le 31 janvier 2022 étaient respectivement de 1,134019 et de 1,197115. Les taux de change (JPY/EUR) en vigueur le 31 janvier 2023 étaient de 0,007067. Dans le cadre de la conversion de la devise de référence du Japan Equity Fund du 7 juin 2022, la valeur d'inventaire d'ouverture a été convertie de l'USD au JPY au taux de change de 130,855000 à la date de conversion du 3 juin 2022, ce qui s'est soldé par un ajustement monétaire de 70 774 425 ¥.

N) *Intérêts négatifs* – Chaque compartiment peut être amené à payer des intérêts (« intérêts négatifs ») sur les soldes. Ces paiements sont comptabilisés dans les « Intérêts et charges assimilées » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net.

O) *Distributions* – Le revenu imputé aux actions de capitalisation (A1, C1, I1, N1, S1, P1, W1 et Z1, si elles sont offertes) de chaque compartiment sera inclus dans la quote-part de l'actif net correspondant à ces actions. Chaque compartiment distribue aux détenteurs d'actions de distribution (A2, A4, C2, I2, N2 et W2, si elles sont offertes) la quasi-totalité des revenus de placements nets imputables à ces actions. Pour les actions de distribution brute (I3, si elles sont offertes), le dividende est calculé à la discrétion du Conseil d'administration en fonction du revenu total des placements attribuable à ces actions, les charges de la catégorie concernée étant déduites après ladite distribution. Pour de plus amples détails, veuillez consulter le prospectus du fonds.

P) *Accords de mise en pension* – Chaque compartiment peut conclure des accords de mise en pension. Chaque accord de mise en pension est comptabilisé au coût. Pour certains accords de mise en pension, les garanties présentées par la contrepartie peuvent être détenues par le dépositaire des compartiments ou son agent, alors que, pour d'autres, elles sont détenues par un agent tiers. Dans ce dernier cas, les compartiments sont exposés au risque de contrepartie supplémentaire au titre de ces garanties en raison de l'insolvabilité éventuelle de l'agent tiers. En application de la réglementation luxembourgeoise, le dépositaire des compartiments a établi des procédures de suivi des garanties détenues par cet agent tiers pour le compte des compartiments. Chaque compartiment suit quotidiennement la valeur des garanties afin de s'assurer que cette valeur, y compris les intérêts courus, est supérieure aux montants dus au compartiment au titre de chaque accord de mise en pension. Les revenus d'intérêts perçus au titre des placements d'un compartiment dans des accords de mise en pension sont portés au poste « Revenus sur accords de mise en pension » dans les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Les détails des accords de mise en pension en circulation, y compris les diverses contreparties et les montants des garanties se rapportant à ces accords, sont présentés à la Note 12. Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023, les compartiments suivants ont eu des frais de transaction pour les accords de mise en pension. Ces montants sont inclus dans le total des frais de transaction de la Note 15.

Compartiment	Frais de transaction
Asia Ex-Japan Fund	1 135 $
Contrarian Value Fund	1 145 $
Diversified Income Fund	1 150 $
Emerging Markets Debt Fund	1 145 $
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	1 130 $
Emerging Markets Equity Fund	1 140 $
Emerging Markets Equity Research Fund	800 $
Global Concentrated Fund	1 125 $
Global Credit Fund	1 145 $
Global Equity Fund	1 070 $
Global Equity Income Fund	1 140 $
Global High Yield Fund	1 150 $
Global Intrinsic Value Fund	1 150 $
Global New Discovery Fund	800 $
Global Opportunistic Bond Fund	1 130 $
Global Research Focused Fund	1 115 $
Global Strategic Equity Fund (b)	445 $
Global Total Return Fund	1 150 $
Inflation-Adjusted Bond Fund	945 $
Japan Equity Fund	51 415 ¥
Latin American Equity Fund (d)	460 $
Limited Maturity Fund	1 120 $
Managed Wealth Fund	1 150 $
Prudent Capital Fund	1 150 $
Prudent Wealth Fund	1 150 $
U.S. Concentrated Growth Fund	1 135 $
U.S. Corporate Bond Fund	1 140 $
U.S. Government Bond Fund	1 145 $
U.S. Total Return Bond Fund	1 145 $
U.S. Value Fund	1 145 $

(b) Le compartiment a commencé ses activités le 18 mai 2022.
(d) Le compartiment a cessé ses activités le 28 juin 2022.

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

Note 3 : Procédure de swing pricing

Les importantes transactions entrantes ou sortantes d'un compartiment peuvent créer une « dilution » de ses actifs car le cours auquel un investisseur achète ou vend des actions ne reflète pas forcément la totalité de la transaction et autres coûts connexes qui sont engagés lorsque le Gestionnaire Financier négocie des titres pour compenser les entrées et sorties de montants considérables. La Société a donc adopté des procédures permettant d'ajuster à la hausse ou à la baisse la valeur nette d'inventaire d'un compartiment (dénommées « swing pricing ») en vue de réduire l'impact de ces coûts pour les actionnaires existants de ce compartiment. Selon ces procédures, les ajustements sont effectués chaque fois que les souscriptions, échanges et rachats nets d'actions de toutes catégories dépassent, un jour ouvré donné, un certain pourcentage de l'actif du compartiment fixé en tant que de besoin par le Conseil d'administration de la Société ou par la Société de Gestion. En cas de montant élevé d'achats nets, la valeur nette d'inventaire par action est ajustée à la hausse et les acquéreurs d'actions du compartiment versent à cette date de valorisation un montant supplémentaire pour compenser les frais de transaction connexes. À l'inverse, la valeur nette d'inventaire par action sera ajustée à la baisse en cas de montant élevé de rachats nets. La valeur nette d'inventaire ajustée s'applique à tous les achats, échanges ou rachats d'actions de toutes les catégories ce jour de valorisation. Étant donné que les achats, rachats et échanges nets d'un compartiment varient d'un jour ouvré à l'autre, il n'est pas possible de prédire la fréquence à laquelle la valeur nette d'inventaire d'un compartiment sera ajustée. En raison de ces ajustements, la volatilité de la valeur nette d'inventaire d'un compartiment peut ne pas refléter entièrement la performance réelle des actifs sous-jacents du compartiment. La VNI par action publiée/négociée, et adaptée conformément aux prescriptions légales et réglementaires luxembourgeoises relatives à l'établissement et à la présentation des états financiers, est communiquée dans la rubrique Statistiques et peut inclure un ajustement au titre du « swing pricing ». Cet ajustement n'est pas pris en considération dans les Bilans et Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Au 31 janvier 2023, aucun compartiment n'a inclus un ajustement au titre du « swing pricing ». Un rapport d'activité historique sur le « swing pricing » est disponible sur *meridian.mfs.com*.

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

Note 4 : Titres prêtés

Goldman Sachs Agency Lending (« GSAL ») peut, en qualité d'agent de prêt, prêter les titres de certains compartiments à certains établissements agréés (les « Emprunteurs ») approuvés par le fonds. Les prêts sont garantis par des garanties constituées de titres de créance d'État de haute qualité dont le montant est au moins égal à la valeur de marché des titres prêtés, lesquels sont valorisés quotidiennement à la valeur de marché (marked-to-market) ; ces garanties sont conservées au sein du réseau de dépositaires du dépositaire du compartiment. GSAL fournit audit compartiment une garantie contre la défaillance de l'Emprunteur, qui couvre le fait de ne pas remettre au compartiment les distributions applicables au titre des titres prêtés ou de ne pas lui rendre les titres prêtés en application du contrat de prêt. L'Emprunteur verse une commission sur les prêts garantis par des titres de créance d'État de haute qualité qui est répartie entre le compartiment et l'agent de prêt (celui-ci n'étant pas une partie liée au fonds, à la Société de Gestion, au Gestionnaire Financier ou au Dépositaire). En vertu du contrat de prêt de titres en vigueur, la Société s'engage à verser à l'agent payeur un certain pourcentage sur les revenus générés par les opérations de prêt de titres : 15 % pour les montants allant jusqu'à 4 millions d'USD et 12,5 % pour les montants dépassant ce plafond. Une commission nominale de gestion de compte et par transaction est également versée à la Société fiduciaire de compensation du Dépositaire dans le cadre de la gestion des garanties. Les produits et les charges découlant des prêts de titres sont comptabilisés séparément dans les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Les revenus de dividendes et d'intérêts tirés des titres prêtés sont comptabilisés de la même manière que les autres revenus de dividendes et d'intérêts comme indiqué dans la Note 2. Au 31 janvier 2023, il n'y avait aucun titre prêté et aucune garantie en cours.

Note 5 : Opérations avec des parties liées

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

Chaque compartiment verse à la Société de Gestion une commission annuelle approuvée par le Conseil d'administration du fonds et destinée à couvrir les frais des prestations de services offerts par la Société de Gestion dans le cadre de son mandat, majorée d'une marge bénéficiaire cible. Ces frais comprennent les commissions versées aux personnes dirigeantes indépendantes et administrateurs de la Société de Gestion, les coûts juridiques, réglementaires et opérationnels de la Société de Gestion, ainsi que les commissions versées par la Société de Gestion aux tiers lui fournissant des prestations de services d'administration, de gestion des risques et de reporting, y compris les prestations de services de soutien administratif fournies par MFS. Le fonds rembourse également à la Société de Gestion les débours liés à ses prestations de services. La commission de la Société de Gestion est calculée quotidiennement et répartie de sorte que chaque compartiment paie une commission fixe de 20 000 USD (ou l'équivalent dans une autre devise) majorée d'une commission calculée en fonction de l'actif net moyen quotidien supérieur à 40 millions USD et allant jusqu'à 4 milliards USD maximum (ou l'équivalent dans une autre devise) pour chaque compartiment. La commission de la Société de Gestion supportée par chaque compartiment pour l'exercice clos le 31 janvier 2023 était équivalente aux pourcentages annuels effectifs suivants de la moyenne quotidienne de l'actif net de chaque compartiment :

Compartiment	% de la moyenne quotidienne de l'actif net
Asia Ex-Japan Fund	0,0464 %
Blended Research European Equity Fund	0,2197 %
Continental European Equity Fund	0,0807 %
Contrarian Value Fund	0,0336 %
Diversified Income Fund	0,0376 %
Emerging Markets Debt Fund	0,0290 %
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	0,0762 %
Emerging Markets Equity Fund	0,0395 %
Emerging Markets Equity Research Fund	0,7762 %
Euro Credit Fund	0,0385 %
European Core Equity Fund	0,0341 %
European Research Fund	0,0291 %
European Smaller Companies Fund	0,0306 %
European Value Fund	0,0250 %
Global Concentrated Fund	0,0301 %
Global Credit Fund	0,0392 %
Global Equity Fund	0,0290 %
Global Equity Income Fund	0,6225 %
Global High Yield Fund	0,0320 %
Global Intrinsic Value Fund	0,0361 %
Global New Discovery Fund	0,3475 %
Global Opportunistic Bond Fund	0,0308 %
Global Research Focused Fund	0,0350 %
Global Strategic Equity Fund (b)	0,9052 %
Global Total Return Fund	0,0293 %
Inflation-Adjusted Bond Fund	0,0323 %
Japan Equity Fund	0,6194 %
Latin American Equity Fund (d)	0,3498 %
Limited Maturity Fund	0,0298 %
Managed Wealth Fund	0,1048 %
Prudent Capital Fund	0,0263 %
Prudent Wealth Fund	0,0274 %
U.K. Equity Fund	0,0658 %
U.S. Concentrated Growth Fund	0,0306 %
U.S. Corporate Bond Fund	0,0311 %
U.S. Government Bond Fund	0,0318 %
U.S. Growth Fund	0,0485 %
U.S. Total Return Bond Fund	0,0305 %
U.S. Value Fund	0,0292 %

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

(d) Le compartiment a cessé ses activités le 28 juin 2022. Les informations pour la période actuelle sont valables au 28 juin 2022 et les informations de la fin de période publiées sont valables à compter de cette date.

B) *Commission de gestion financière* – La Société de Gestion a conclu un contrat de gestion financière avec MFS au titre des services de gestion financière pour les compartiments. La commission de gestion financière est calculée quotidiennement et payée mensuellement aux taux annuels suivants au 31 janvier 2023, sur la base de la moyenne quotidienne de l'actif net de chaque catégorie d'actions, pour les compartiments ci-dessous :

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

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

(d) Le compartiment a cessé ses activités le 28 juin 2022. Les informations pour la période actuelle sont valables au 28 juin 2022 et les informations de la fin de période publiées sont valables à compter de cette date.

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

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

Des frais sont appliqués aux actions de la catégorie P au titre des services de gestion financière et de distribution, et sont réunis dans les frais de gestion annuels. Les frais de gestion annuels sont calculés quotidiennement et payés mensuellement aux taux annuels suivants au 31 janvier 2023, sur la base de la moyenne quotidienne de l'actif net de chaque catégorie d'actions, pour les compartiments ci-dessous :

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

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

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

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

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

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

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

(d) Le compartiment a cessé ses activités le 28 juin 2022. Les informations pour la période actuelle sont valables au 28 juin 2022 et les informations de la fin de période publiées sont valables à compter de cette date.

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

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

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

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

D) *Jetons de présence* – Le fonds ne rémunère pas directement ses Administrateurs qui sont des employés de la Société de Gestion, du Gestionnaire Financier ou ses filiales (en dehors des débours liés au fonds). À la date du présent rapport, tous les Administrateurs du fonds sont des employés de la Société de Gestion, de MFS Investment Management ou de ses filiales, sauf Thomas Bogart et James R. Julian Jr., dont la rémunération versée par les compartiments en montants cumulés s'élevait à 100 000 $ bruts par an durant la période comptable. Thomas Bogart et James R. Julian Jr. ont également été remboursés de leurs débours. Ce remboursement a été effectué par les compartiments. Ces frais sont inclus au poste « Divers » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023, les compartiments ont payé des frais de 6 994 dollars.

E) *Contrat de plafonnement des charges* – Chaque compartiment a conclu un contrat temporaire sur le plafonnement des charges par lequel MFS s'est engagée par écrit à assumer certaines des « Autres charges » du compartiment, à l'exclusion des impôts et taxes (autres que la taxe d'abonnement au Luxembourg) et des frais associés aux activités d'investissement du compartiment, tels que les charges d'intérêts, de telle sorte que lesdites charges ne dépassent pas les taux des actifs nets moyens quotidiens des catégories A, C, I, N, P, W et Z indiqués dans le tableau ci-après.

Les « Autres charges » comprennent, de manière générale, l'ensemble des charges directes d'un compartiment autres que les frais de gestion d'investissement, les commissions de distribution et les frais de service. Elles comprennent, entre autres, les commissions payées à la Société de gestion, au Dépositaire et à l'Agent de transfert, les frais juridiques et d'audit, les charges de couverture des catégories d'actions, certaines charges associées aux

activités d'investissement du compartiment, y compris les intérêts, et les charges liées au fonctionnement et à l'administration centrale du compartiment à Luxembourg. Elles ne comprennent cependant pas les commissions de courtage, les coûts de transaction ou de conversion de devises et les frais payés à l'agent de prêt de titres.

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

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

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

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

Compartiment – (suite)	Catégorie A	Catégorie C	Catégorie I	Catégorie N	Catégorie P	Catégorie S	Catégorie W	Catégorie Z
U.S. Government Bond Fund	0,08 %	0,08 %	0,05 %	0,08 %	—	1,00 %	0,08 %	—
U.S. Growth Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,10 %	—	—	0,10 %	0,05 %
U.S. Total Return Bond Fund	0,15 %	0,15 %	0,05 %	0,15 %	—	1,00 %	0,10 %	—
U.S. Value Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,25 %	0,25 %	1,00 %	0,20 %	—

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

(d) Le compartiment a cessé ses activités le 28 juin 2022. Les informations pour la période actuelle sont valables au 28 juin 2022 et les informations de la fin de période publiées sont valables à compter de cette date.

(e) WSH1 (EUR), WSH1 (CHF) et WS1 (USD) ont une commission de gestion financière de 0,05 %.

(f) ISB1 (EUR) a un autre taux plafond de dépenses de 0,10 %.

Les réductions au titre de ces contrats sont comptabilisées au poste « Charges remboursées par les parties liées » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Ces contrats de plafonnement des charges sont en vigueur jusqu'au 31 janvier 2024, date à laquelle ils pourraient être prolongés ou non. Toutes les opérations conclues entre le fonds et MFS l'ont été dans le cadre normal de l'activité et à des conditions commerciales normales. Le fonds n'a pas conclu d'opérations par l'intermédiaire d'un courtier ayant des liens avec lui et n'a effectué aucune opération hors du cadre normal de l'activité ou dans des conditions commerciales exceptionnelles.

Note 6 : Commissions de dépositaire

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

Note 7 : Partage de commissions

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

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

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

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

Les services de recherche obtenus par MFS Global Group par l'intermédiaire de crédits de commissions peuvent inclure : un accès aux directions d'entreprise ; des conférences sectorielles ; des missions de recherche sur le terrain pour visiter les directions d'entreprise et/ou les installations de

fabrication, de production ou de distribution ; des informations statistiques ou de recherche, et d'autres informations factuelles et services tels que des rapports de recherche en investissement ; des analyses ; un petit nombre de réseaux d'experts ; des rapports ou bases de données contenant des analyses d'entreprise, fondamentales, techniques et politiques ; des informations relatives à l'ESG ; des stratégies de modélisation de portefeuille ; et des services de recherche économique comme des publications, des services de représentation graphique et des avis d'économistes se rapportant aux informations macro-économiques, ainsi que des informations analytiques d'investissement au sujet de sociétés particulières.

En utilisant les services de courtage et de recherche éligibles acquis au moyen de crédits de commissions, le Groupe mondial MFS évite les charges supplémentaires qui seraient encourues s'il tentait de produire des informations comparables par l'intermédiaire de son propre personnel ou s'il achetait ces services au moyen de ses propres ressources. En conséquence, le montant payé en premier lieu par les clients au titre des transactions relatives à leur compte peut être supérieur à celui qu'ils auraient payé si le Groupe mondial MFS les avait amenés à payer les taux applicables à la seule exécution. Toutefois, dans la mesure où le Groupe mondial MFS a décidé de rembourser aux clients, de sa propre initiative et sur ses propres ressources, les crédits de commissions générés par le courtage client, il assume en définitive les dépenses supplémentaires qu'il encourrait s'il finançait les recherches externes sur ses propres ressources. Si le Groupe mondial MFS décidait de mettre fin à ce remboursement qu'il pratique de sa propre initiative, il pourrait être incité à choisir ou à recommander un courtier sur le fondement de son intérêt à obtenir des recherches externes plutôt que de l'intérêt du client à bénéficier de taux de commission plus faibles.

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

Note 8 : Fiscalité

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

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

Considérations fiscales spécifiques au Royaume-Uni – La Société a reçu le statut de « fonds déclarant » pour certains compartiments et catégories d'actions pour l'exercice clos le 31 janvier 2023. Vous trouverez de plus amples informations sur www.mfs.com.

Note 9 : Ligne de crédit

Chaque compartiment et les autres fonds gérés par MFS participent à une ligne de crédit engagée et non garantie, sous réserve d'une sous-limite de 250 millions USD, fournie par un consortium bancaire en application d'un contrat de crédit. Des emprunts peuvent être effectués pour faire face à des besoins de financement provisoires. Les intérêts sont facturés à chaque compartiment, en fonction de ses emprunts, généralement à un taux égal au plus élevé de 1) Daily Simple SOFR (Secured Overnight Financing Rate) plus 0,10 %, 2) le taux effectif des fonds fédéraux américains, ou 3) l'OBFR, majoré d'une marge convenue. Une commission d'engagement, basée sur la moyenne quotidienne de la partie non utilisée de la ligne de crédit engagée, est répartie entre les compartiments participants. La ligne de crédit expire le 14 mars 2024, sauf extension ou renouvellement. Par ailleurs, chaque compartiment et les autres fonds gérés par MFS ont établi un accord d'emprunt non engagé et non garanti de 200 millions USD avec le Dépositaire pour les besoins de financement provisoires. Les intérêts sont facturés à chaque compartiment participant, en fonction de ses emprunts, à des taux égaux aux taux de référence habituels majorés d'une marge convenue. Tous les frais d'intérêts sont comptabilisés en tant qu'« intérêts et charges assimilées » et toutes les commissions sont comptabilisées au poste « Divers » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Aucun des compartiments n'avait d'emprunts en cours au titre de ces accords au 31 janvier 2023. Le Global Strategic Equity Fund n'a pas participé à la ligne de crédit engagée au cours de l'exercice clos le 31 janvier 2023. Le compartiment a été ajouté à la ligne de crédit non garantie engagée le 16 mars 2023.

Note 10 : Contrats de change à terme ouverts

Au 31 janvier 2023, les compartiments étaient liés par les contrats à terme standardisés suivants. Chaque compartiment avait en caisse suffisamment de liquidités et/ou d'autres titres pour faire face à tous les engagements au titre de ces contrats dérivés.

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Diversified Income Fund							
Plus-value							
ACHAT	BRL	Goldman Sachs International	871 971	2/02/2023	166 474 $	171 773 $	5 299 $
ACHAT	BRL	Merrill Lynch International	633 387	2/02/2023	124 211	124 773	562
ACHAT	CLP	Barclays Bank PLC	28 870 180	6/03/2023	32 446	36 085	3 639
ACHAT	CLP	Morgan Stanley Capital Services Inc.	53 710 478	6/03/2023	57 367	67 134	9 767
ACHAT	CNH	BNP Paribas S.A.	229 344	21/04/2023	34 063	34 114	51
ACHAT	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	4 930	21/04/2023	5 353	5 386	33
ACHAT	EUR	UBS AG	22 329	21/04/2023	24 387	24 393	6
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	4 930	21/04/2023	5 396	5 386	10
VENTE	GBP	Deutsche Bank AG	3 167	21/04/2023	3 915	3 911	4
VENTE	MXN	HSBC Bank	817 744	21/04/2023	43 018	42 813	205
ACHAT	MYR	Barclays Bank PLC	347 965	22/02/2023	79 317	81 660	2 343
ACHAT	PHP	Goldman Sachs International	3 664 225	21/02/2023	66 240	67 062	822
VENTE	PHP	Goldman Sachs International	3 664 225	21/02/2023	67 199	67 062	137
ACHAT	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	1 991 267	7/03/2023 - 13/03/2023	59 727	60 551	824
VENTE	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	901 602	7/03/2023	27 633	27 407	226
Total							**23 928 $**
Moins-value							
VENTE	BRL	Goldman Sachs International	981 386	2/02/2023 - 4/04/2023	190 607 $	193 083 $	(2 476) $
VENTE	BRL	Merrill Lynch International	633 388	2/02/2023	117 222	124 773	(7 551)
VENTE	CLP	Barclays Bank PLC	53 486 000	6/03/2023	56 095	66 852	(10 757)
ACHAT	EUR	State Street Bank Corp.	22 823	21/04/2023	25 038	24 932	(106)
VENTE	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	395 359	21/04/2023	429 266	431 899	(2 633)
ACHAT	JPY	Merrill Lynch International	6 955 130	21/04/2023	55 136	54 016	(1 120)
ACHAT	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	1 147 344	7/03/2023	35 125	34 877	(248)
Total							**(24 891) $**
Emerging Markets Debt Fund							
Plus-value							
ACHAT	BRL	Banco Santander S.A.	372 000	2/02/2023	72 951 $	73 282 $	331 $
ACHAT	BRL	Goldman Sachs International	22 906 073	2/02/2023	4 480 246	4 512 356	32 110
ACHAT	BRL	JPMorgan Chase Bank N.A.	21 221 022	2/02/2023	4 139 896	4 180 411	40 515
ACHAT	CLP	Barclays Bank PLC	4 419 640 338	6/03/2023	4 861 671	5 524 205	662 534
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	128 682	21/04/2023	140 347	140 575	228
ACHAT	EUR	Citibank N.A.	245 671	21/04/2023	265 608	268 376	2 768
ACHAT	EUR	Morgan Stanley Capital Services Inc.	3 543 598	21/04/2023	3 863 948	3 871 102	7 154
VENTE	EUR	Morgan Stanley Capital Services Inc.	491 629	21/04/2023	537 997	537 066	931
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	295 230	21/04/2023	324 015	322 515	1 500
ACHAT	IDR	Goldman Sachs International	3 963 050 657	9/02/2023	249 704	264 331	14 627
ACHAT	MYR	Barclays Bank PLC	46 557 633	16/02/2023	10 420 096	10 922 191	502 095
ACHAT	PHP	Barclays Bank PLC	118 863 469	9/03/2023	2 143 229	2 175 057	31 828
ACHAT	PHP	Goldman Sachs International	59 089 817	9/03/2023	1 060 192	1 081 272	21 080
ACHAT	SGD	JPMorgan Chase Bank N.A.	4 342 277	21/04/2023	3 280 243	3 310 716	30 473
ACHAT	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	312 079 911	7/03/2023	9 127 939	9 486 482	358 543
Total							**1 706 717 $**

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Emerging Markets Debt Fund – (suite)							
Moins-value							
VENTE	BRL	Banco Santander S.A.	372 000	2/02/2023	68 498 $	73 282 $	(4 784) $
VENTE	BRL	Goldman Sachs International	32 574 706	2/02/2023 - 4/04/2023	6 280 091	6 395 416	(115 325)
VENTE	BRL	JPMorgan Chase Bank N.A.	21 221 022	2/02/2023	3 978 916	4 180 411	(201 495)
VENTE	EUR	HSBC Bank	91 701 170	21/04/2023	99 559 172	100 176 296	(617 124)
VENTE	EUR	Morgan Stanley Capital Services Inc.	524 588	21/04/2023	572 962	573 071	(109)
ACHAT	MXN	HSBC Bank	99 763 202	21/04/2023	5 248 126	5 223 087	(25 039)
VENTE	MYR	Barclays Bank PLC	22 774 083	16/02/2023	4 984 456	5 342 688	(358 232)
Total							**(1 322 108) $**
Emerging Markets Debt Local Currency Fund							
Plus-value							
ACHAT	BRL	Banco Santander S.A.	1 514 000	2/02/2023	296 904 $	298 249 $	1 345 $
ACHAT	BRL	Barclays Bank PLC	589 429	2/02/2023	107 536	116 114	8 578
ACHAT	BRL	Citibank N.A.	1 927 740	2/02/2023	365 481	379 753	14 272
ACHAT	BRL	Goldman Sachs International	1 951 810	2/02/2023 - 4/04/2023	381 344	382 963	1 619
ACHAT	BRL	JPMorgan Chase Bank N.A.	957 923	02/02/2023	177 150	188 705	11 555
ACHAT	CLP	Banco Santander S.A.	53 981 000	6/03/2023	65 065	67 472	2 407
ACHAT	CLP	Citibank N.A.	162 408 000	6/03/2023	172 912	202 997	30 085
ACHAT	CNH	BNP Paribas S.A.	2 895 507	21/04/2023	430 054	430 701	647
ACHAT	CNH	HSBC Bank	292 429	21/04/2023	43 482	43 498	16
ACHAT	CZK	Morgan Stanley Capital Services Inc.	6 893 159	21/04/2023	308 946	313 769	4 823
ACHAT	EUR	HSBC Bank	273 826	21/04/2023	297 288	299 134	1 846
ACHAT	HUF	Goldman Sachs International	44 914 751	21/04/2023	118 881	121 817	2 936
ACHAT	HUF	Morgan Stanley Capital Services Inc.	57 779 618	21/11/2023	133 102	149 572	16 470
ACHAT	IDR	Barclays Bank PLC	2 572 620 160	9/02/2023 - 24/02/2023	164 530	171 584	7 054
ACHAT	IDR	Goldman Sachs International	12 971 185 276	9/02/2023	817 289	865 164	47 875
ACHAT	IDR	JPMorgan Chase Bank N.A.	398 630 000	9/02/2023	25 476	26 588	1 112
ACHAT	IDR	Morgan Stanley Capital Services Inc.	667 167 037	9/02/2023	42 819	44 499	1 680
VENTE	KRW	Merrill Lynch International	976 325 486	2/02/2023 - 28/04/2023	794 479	793 908	571
ACHAT	MXN	Morgan Stanley Capital Services Inc.	661 522	21/04/2023	34 275	34 634	359
VENTE	MXN	JPMorgan Chase Bank N.A.	465 329	21/04/2023	24 413	24 362	51
ACHAT	MYR	Barclays Bank PLC	5 608 666	22/02/2023	1 236 635	1 316 224	79 589
VENTE	MYR	Barclays Bank PLC	201 626	22/02/2023	47 380	47 317	63
ACHAT	PEN	Barclays Bank PLC	104 203	3/02/2023	26 896	27 099	203
ACHAT	PEN	Goldman Sachs International	960 800	3/02/2023	249 108	249 860	752
VENTE	PEN	Goldman Sachs International	79 605	3/02/2023	20 765	20 702	63
ACHAT	PHP	Citibank N.A.	8 213 494	21/02/2023	144 299	150 321	6 022
ACHAT	PHP	Goldman Sachs International	7 135 972	21/02/2023	128 368	130 600	2 232
ACHAT	PLN	State Street Bank Corp.	68 812	21/04/2023	15 685	15 792	107
ACHAT	RON	BNP Paribas S.A.	151 608	21/04/2023	33 326	33 359	33
ACHAT	SGD	Merrill Lynch International	868 018	21/04/2023	658 178	661 810	3 632
ACHAT	THB	Barclays Bank PLC	2 800 385	21/02/2023	84 324	85 004	680
ACHAT	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	39 044 703	13/03/2023	1 179 523	1 187 566	8 043
VENTE	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	2 265 809	13/03/2023	68 984	68 916	68
ACHAT	TRY	HSBC Bank	3 589 181	24/04/2023	180 123	182 116	1 993
ACHAT	TWD	Barclays Bank PLC	15 483 493	3/02/2023	515 223	515 738	515

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Emerging Markets Debt Local Currency Fund – (suite)							
Plus-value – (suite)							
VENTE	TWD	Barclays Bank PLC	15 483 493	5/05/2023	521 734 $	520 576 $	1 158 $
VENTE	ZAR	HSBC Bank	1 599 560	21/04/2023	92 564	91 326	1 238
Total							**261 692 $**
Moins-value							
VENTE	AUD	Citibank N.A.	761 662	21/04/2023	532 214 $	539 226 $	(7 012) $
VENTE	BRL	Banco Santander S.A.	1 514 000	2/02/2023	287 537	298 249	(10 712)
VENTE	BRL	Barclays Bank PLC	589 429	2/02/2023	115 590	116 114	(524)
VENTE	BRL	Citibank N.A.	1 927 740	2/02/2023	374 779	379 753	(4 974)
VENTE	BRL	Goldman Sachs International	1 266 452	2/02/2023	242 602	249 483	(6 881)
VENTE	BRL	JPMorgan Chase Bank N.A.	957 923	2/02/2023	187 854	188 705	(851)
VENTE	CAD	State Street Bank Corp.	612 098	21/04/2023	453 562	460 332	(6 770)
VENTE	CLP	Barclays Bank PLC	380 780 999	6/03/2023	401 984	475 947	(73 963)
VENTE	COP	Goldman Sachs International	1 575 630 229	21/02/2023	333 679	336 167	(2 488)
VENTE	CZK	BNP Paribas S.A.	648 186	21/04/2023	29 160	29 505	(345)
VENTE	CZK	UBS AG	597 764	21/04/2023	27 065	27 210	(145)
VENTE	HUF	Goldman Sachs International	18 115 445	21/04/2023	48 198	49 132	(934)
VENTE	IDR	Barclays Bank PLC	877 585 414	9/02/2023	57 153	58 534	(1 381)
ACHAT	JPY	Merrill Lynch International	33 806 612	21/04/2023	268 000	262 555	(5 445)
ACHAT	KRW	Citibank N.A.	488 162 743	2/02/2023	396 622	396 300	(322)
ACHAT	KRW	Merrill Lynch International	488 162 743	2/02/2023	396 719	396 300	(419)
VENTE	KRW	Citibank N.A.	488 162 743	2/02/2023	342 551	396 300	(53 749)
ACHAT	MXN	HSBC Bank	1 553 506	21/04/2023	81 723	81 334	(389)
VENTE	MXN	HSBC Bank	3 491 000	21/04/2023	182 368	182 771	(403)
VENTE	MXN	Morgan Stanley Capital Services Inc.	327 545	21/04/2023	17 126	17 149	(23)
ACHAT	MYR	Barclays Bank PLC	130 099	22/02/2023	30 568	30 531	(37)
VENTE	MYR	Barclays Bank PLC	56 357	22/02/2023	12 809	13 226	(417)
ACHAT	PEN	JPMorgan Chase Bank N.A.	611 000	2/05/2023	157 881	157 816	(65)
VENTE	PEN	Barclays Bank PLC	886 814	3/02/2023	229 941	230 620	(679)
VENTE	PEN	Goldman Sachs International	868 061	2/05/2023	223 548	224 212	(664)
VENTE	PEN	Morgan Stanley Capital Services Inc.	98 584	3/02/2023	25 582	25 637	(55)
VENTE	RON	JPMorgan Chase Bank N.A.	137 447	21/04/2023	29 895	30 243	(348)
ACHAT	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	8 602 621	13/03/2023	263 005	261 653	(1 352)
VENTE	TRY	Morgan Stanley Capital Services Inc.	333 795	24/04/2023	16 742	16 937	(195)
VENTE	TWD	Citibank N.A.	748 310	3/02/2023	24 433	24 925	(492)
VENTE	TWD	Merrill Lynch International	19 630 692	3/02/2023 - 1/03/2023	622 602	654 307	(31 705)
ACHAT	ZAR	JPMorgan Chase Bank N.A.	453 432	21/04/2023	26 340	25 889	(451)
ACHAT	ZAR	Morgan Stanley Capital Services Inc.	1 785 044	21/04/2023	102 663	101 917	(746)
Total							**(214 936) $**
Euro Credit Fund							
Plus-value							
VENTE	GBP	Morgan Stanley Capital Services Inc.	731 122	21/04/2023	829 870 €	826 500 €	3 370 €
VENTE	GBP	State Street Bank Corp.	91 173	21/04/2023	103 173	103 066	107
VENTE	GBP	UBS AG	4 227 503	21/04/2023	4 779 969	4 778 997	972
ACHAT	USD	UBS AG	1 048 858	21/04/2023	960 073	960 122	49
VENTE	USD	HSBC Bank	6 555 361	21/04/2023	6 038 018	6 000 760	37 258
VENTE	USD	Morgan Stanley Capital Services Inc.	511 705	21/04/2023	468 544	468 414	130
Total							**41 886 €**

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Euro Credit Fund – (suite)							
Moins-value							
ACHAT	GBP	UBS AG	21/04/2023	21/04/2023	750 622 €	744 824 €	(5 798) €
Global Credit Fund							
Plus-value							
ACHAT	AUD	Citibank N.A.	791 022	21/04/2023	552 375 $	560 012 $	7 637 $
ACHAT	CAD	State Street Bank Corp.	942 098	21/04/2023	698 091	708 510	10 419
ACHAT	EUR	Citibank N.A.	809 937	21/04/2023	875 668	884 792	9 124
ACHAT	EUR	Merrill Lynch International	565 948	21/04/2023	618 029	618 253	224
ACHAT	EUR	State Street Bank Corp.	36 473	21/04/2023	39 815	39 844	29
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	24 754	21/04/2023	27 086	27 042	44
VENTE	GBP	Deutsche Bank AG	1 032 754	21/04/2023	1 276 871	1 275 381	1 490
VENTE	GBP	State Street Bank Corp.	65 624	21/04/2023	81 458	81 041	417
ACHAT	NZD	HSBC Bank	119 890	21/04/2023	76 841	77 524	683
Total							**30 067 $**
Moins-value							
ACHAT	CHF	State Street Bank Corp.	323 295	21/04/2023	356 303 $	356 089 $	(214) $
ACHAT	EUR	Deutsche Bank AG	249 398	21/04/2023	273 252	272 448	(804)
ACHAT	EUR	HSBC Bank	269 631	21/04/2023	295 058	294 551	(507)
VENTE	EUR	HSBC Bank	4 790 342	21/04/2023	5 200 607	5 233 071	(32 464)
VENTE	EUR	UBS AG	1 421 479	21/04/2023	1 541 000	1 552 854	(11 854)
ACHAT	GBP	State Street Bank Corp.	270 768	21/04/2023	335 607	334 380	(1 227)
VENTE	GBP	HSBC Bank	199 142	21/04/2023	245 036	245 927	(891)
ACHAT	JPY	Merrill Lynch International	74 552 390	21/04/2023	591 010	579 001	(12 009)
ACHAT	NOK	Deutsche Bank AG	374 256	21/04/2023	37 950	37 633	(317)
ACHAT	SEK	Deutsche Bank AG	281 782	21/04/2023	27 406	27 060	(346)
Total							**(60 633) $**
Global High Yield Fund							
Plus-value							
VENTE	GBP	Morgan Stanley Capital Services Inc.	3 559 643	21/04/2023	4 403 912 $	4 395 917 $	7 995 $
Moins-value							
ACHAT	EUR	Morgan Stanley Capital Services Inc.	574 366	21/04/2023	630 120 $	627 449 $	(2 671) $
VENTE	EUR	HSBC Bank	186 518	21/04/2023	203 437	203 756	(319)
VENTE	EUR	Morgan Stanley Capital Services Inc.	565 483	21/04/2023	616 202	617 745	(1 543)
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	37 668 426	21/04/2023	40 904 988	41 149 786	(244 798)
VENTE	EUR	UBS AG	533 778	21/04/2023	580 550	583 110	(2 560)
ACHAT	GBP	Morgan Stanley Capital Services Inc.	99 001	21/04/2023	122 470	122 260	(210)
Total							**(252 101) $**
Global Opportunistic Bond Fund							
Plus-value							
ACHAT	AUD	Citibank N.A.	1 212 171	21/04/2023	846 465 $	858 168 $	11 703 $
ACHAT	AUD	Deutsche Bank AG	2 434 154	21/04/2023	1 684 965	1 723 282	38 317
ACHAT	AUD	HSBC Bank	2 445 920	21/04/2023	1 706 664	1 731 612	24 948
ACHAT	AUD	State Street Bank Corp.	2 479 618	21/04/2023	1 745 495	1 755 469	9 974
ACHAT	BRL	Citibank N.A.	9 264 273	2/02/2023	1 816 773	1 825 005	8 232
ACHAT	BRL	Goldman Sachs International	14 646	2/02/2023	2 878	2 885	7
ACHAT	BRL	JPMorgan Chase Bank N.A.	9 249 626	2/02/2023	1 710 550	1 822 120	111 570

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Opportunistic Bond Fund – (suite)							
Plus-value – (suite)							
ACHAT	CAD	HSBC Bank	1 164 067	21/04/2023	870 279 $	875 443 $	5 164 $
ACHAT	CAD	Merrill Lynch International	2 713 708	21/04/2023	2 013 017	2 040 860	27 843
ACHAT	EUR	HSBC Bank	250 037	21/04/2023	270 901	273 146	2 245
ACHAT	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	17 420 752	21/04/2023	18 914 808	19 030 798	115 990
ACHAT	EUR	Morgan Stanley Capital Services Inc.	172 043	21/04/2023	186 748	187 944	1 196
ACHAT	EUR	State Street Bank Corp.	4 411 177	21/04/2023	4 791 163	4 818 862	27 699
VENTE	EUR	HSBC Bank	6 547 581	21/04/2023	7 173 460	7 152 716	20 744
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	57 529	21/04/2023	62 949	62 846	103
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	1 360 857	21/04/2023	1 674 714	1 680 566	5 852
VENTE	GBP	HSBC Bank	225 626	21/04/2023	278 654	278 633	21
VENTE	GBP	Morgan Stanley Capital Services Inc.	30 262 787	21/04/2023	37 437 220	37 372 490	64 730
VENTE	GBP	State Street Bank Corp.	1 350 430	21/04/2023	1 676 254	1 667 690	8 564
ACHAT	JPY	HSBC Bank	153 903 030	21/04/2023	1 194 373	1 195 268	895
VENTE	JPY	Deutsche Bank AG	1 478 716 418	21/04/2023	11 710 620	11 484 259	226 361
VENTE	JPY	HSBC Bank	75 972 032	21/04/2023	593 386	590 027	3 359
ACHAT	KRW	Barclays Bank PLC	4 442 126 129	2/02/2023	3 562 315	3 606 207	43 892
VENTE	KRW	Barclays Bank PLC	4 442 126 129	2/02/2023	3 609 137	3 606 207	2 930
VENTE	KRW	Merrill Lynch International	41 244 583 736	2/02/2023 - 28/04/2023	33 562 551	33 538 408	24 143
VENTE	MXN	HSBC Bank	4 425 690	21/04/2023	232 817	231 706	1 111
VENTE	NOK	Deutsche Bank AG	11 706 618	21/04/2023	1 187 055	1 177 142	9 913
ACHAT	NZD	HSBC Bank	359 000	21/04/2023	230 092	232 139	2 047
ACHAT	NZD	JPMorgan Chase Bank N.A.	7 993 489	21/04/2023	5 138 215	5 168 806	30 591
VENTE	SEK	Deutsche Bank AG	1 178 360	21/04/2023	114 609	113 160	1 449
ACHAT	SGD	HSBC Bank	457 799	21/04/2023	348 981	349 043	62
ACHAT	SGD	State Street Bank Corp.	8 962 602	21/04/2023	6 802 274	6 833 428	31 154
ACHAT	THB	Barclays Bank PLC	224 965 696	21/02/2023	6 436 831	6 828 723	391 892
ACHAT	TWD	Barclays Bank PLC	148 636 061	3/02/2023	4 945 962	4 950 905	4 943
VENTE	TWD	Barclays Bank PLC	148 636 061	5/05/2023	5 008 460	4 997 346	11 114
Total							**1 270 758 $**
Moins-value							
VENTE	AUD	Citibank N.A.	7 664 313	21/04/2023	5 355 464 $	5 426 022 $	(70 558) $
VENTE	AUD	State Street Bank Corp.	1 078 661	21/04/2023	754 524	763 648	(9 124)
VENTE	BRL	Citibank N.A.	9 264 273	2/02/2023	1 698 931	1 825 005	(126 074)
VENTE	BRL	Goldman Sachs International	14 646	2/02/2023	2 872	2 885	(13)
VENTE	BRL	JPMorgan Chase Bank N.A.	9 249 626	2/02/2023	1 813 901	1 822 120	(8 219)
VENTE	CAD	BNP Paribas S.A.	6 655 378	21/04/2023	4 976 511	5 005 216	(28 705)
VENTE	CAD	JPMorgan Chase Bank N.A.	4 645 530	21/04/2023	3 475 318	3 493 698	(18 380)
VENTE	CAD	Merrill Lynch International	62 039	21/04/2023	46 020	46 657	(637)
VENTE	CAD	State Street Bank Corp.	680 940	21/04/2023	508 754	512 105	(3 351)
VENTE	CLP	Goldman Sachs International	14 060 597	6/03/2023	14 705	17 575	(2 870)
VENTE	CNH	BNP Paribas S.A.	96 945 610	21/04/2023	14 398 790	14 420 453	(21 663)
VENTE	CZK	Goldman Sachs International	290 260	21/04/2023	13 016	13 212	(196)
ACHAT	EUR	HSBC Bank	892 777	21/04/2023	976 738	975 288	(1 450)
ACHAT	EUR	State Street Bank Corp.	1 594 949	21/04/2023	1 749 779	1 742 356	(7 423)
VENTE	EUR	BNP Paribas S.A.	1 600 953	21/04/2023	1 737 628	1 748 915	(11 287)
VENTE	EUR	Citibank N.A.	774 345	21/04/2023	845 604	845 911	(307)
VENTE	EUR	Deutsche Bank AG	1 697 011	21/04/2023	1 843 902	1 853 850	(9 948)

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Opportunistic Bond Fund – (suite)							
Moins-value – (suite)							
VENTE	EUR	HSBC Bank	4 103 848	21/04/2023	4 454 222 $	4 483 130 $	(28 908) $
VENTE	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	79 773 058	21/04/2023	86 614 365	87 145 775	(531 410)
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	1 260 308	21/04/2023	1 373 965	1 376 787	(2 822)
VENTE	EUR	UBS AG	932 879	21/04/2023	1 015 787	1 019 096	(3 309)
ACHAT	GBP	HSBC Bank	6 801 584	21/04/2023	8 429 477	8 399 496	(29 981)
ACHAT	GBP	Morgan Stanley Capital Services Inc.	3 332 204	21/04/2023	4 122 136	4 115 046	(7 090)
ACHAT	GBP	State Street Bank Corp.	252 242	21/04/2023	312 645	311 502	(1 143)
VENTE	GBP	HSBC Bank	199 142	21/04/2023	245 036	245 927	(891)
VENTE	GBP	Morgan Stanley Capital Services Inc.	239 434	21/04/2023	292 930	295 684	(2 754)
VENTE	GBP	State Street Bank Corp.	305 960	21/04/2023	374 922	377 840	(2 918)
ACHAT	JPY	Deutsche Bank AG	182 599 251	21/04/2023	1 446 086	1 418 133	(27 953)
ACHAT	JPY	Merrill Lynch International	226 228 438	21/04/2023	1 786 916	1 756 974	(29 942)
ACHAT	JPY	State Street Bank Corp.	610 365 191	21/04/2023	4 763 644	4 740 321	(23 323)
ACHAT	KRW	Barclays Bank PLC	21 401 222 486	2/02/2023	17 388 059	17 373 943	(14 116)
ACHAT	KRW	JPMorgan Chase Bank N.A.	1 155 212 000	2/02/2023	938 586	937 824	(762)
ACHAT	KRW	Merrill Lynch International	23 130 275 379	2/02/2023	18 796 964	18 777 622	(19 342)
ACHAT	KRW	Morgan Stanley Capital Services Inc.	643 386 950	13/03/2023	524 445	523 071	(1 374)
VENTE	KRW	Barclays Bank PLC	23 898 573 884	2/02/2023 - 13/03/2023	17 042 238	19 404 282	(2 362 044)
VENTE	KRW	Citibank N.A.	12 491 206 040	13/03/2023 - 12/04/2023	10 093 436	10 162 976	(69 540)
VENTE	KRW	JPMorgan Chase Bank N.A.	1 955 852 000	2/02/2023 - 12/04/2023	1 560 108	1 589 519	(29 411)
VENTE	KRW	Merrill Lynch International	2 507 983 511	2/02/2023	1 937 231	2 036 031	(98 800)
VENTE	NZD	HSBC Bank	8 328 995	21/04/2023	5 338 269	5 385 754	(47 485)
ACHAT	SEK	Deutsche Bank AG	1 299 000	21/04/2023	126 342	124 745	(1 597)
ACHAT	THB	Barclays Bank PLC	7 975 219	21/02/2023	243 234	242 084	(1 150)
VENTE	TWD	Merrill Lynch International	259 466 327	3/02/2023 - 1/03/2023	8 300 711	8 652 273	(351 562)
Total							**(4 009 832) $**
Global Total Return Fund							
Plus-value							
ACHAT	AUD	Citibank N.A.	6 579 153	21/04/2023	4 594 255 $	4 657 772 $	63 517 $
ACHAT	AUD	HSBC Bank	4 775 992	21/04/2023	3 332 494	3 381 208	48 714
ACHAT	AUD	State Street Bank Corp.	4 787 579	21/04/2023	3 370 154	3 389 411	19 257
ACHAT	CAD	HSBC Bank	2 287 312	21/04/2023	1 710 039	1 720 186	10 147
ACHAT	CAD	State Street Bank Corp.	11 324 285	21/04/2023	8 391 249	8 516 494	125 245
ACHAT	CLP	Goldman Sachs International	274 541 388	6/03/2023	287 123	343 155	56 032
ACHAT	CNH	BNP Paribas S.A.	115 131 136	21/04/2023	17 099 784	17 125 511	25 727
ACHAT	CNH	State Street Bank Corp.	4 491 957	21/04/2023	667 274	668 169	895
ACHAT	COP	Goldman Sachs International	1 621 457 072	21/02/2023	343 384	345 944	2 560
ACHAT	CZK	Morgan Stanley Capital Services Inc.	18 367 811	21/04/2023	823 231	836 083	12 852
ACHAT	DKK	Citibank N.A.	10 530 139	21/04/2023	1 546 359	1 547 230	871
ACHAT	EUR	Citibank N.A.	2 535 279	21/04/2023	2 741 032	2 769 592	28 560
ACHAT	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	31 191 887	21/04/2023	33 866 997	34 074 677	207 680
ACHAT	EUR	Merrill Lynch International	1 406 743	21/04/2023	1 536 286	1 536 756	470
ACHAT	EUR	Morgan Stanley Capital Services Inc.	1 485 718	21/04/2023	1 619 835	1 623 029	3 194
ACHAT	EUR	State Street Bank Corp.	1 241 738	21/04/2023	1 352 990	1 356 501	3 511
VENTE	EUR	HSBC Bank	4 993 138	21/04/2023	5 470 141	5 454 610	15 531
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	36 302	21/04/2023	39 722	39 657	65
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	2 736 776	21/04/2023	3 367 964	3 379 733	11 769

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Total Return Fund – (suite)							
Plus-value – (suite)							
VENTE	GBP	Deutsche Bank AG	19 877 500	21/04/2023	24 576 042 $	24 547 364 $	28 678 $
VENTE	GBP	State Street Bank Corp.	2 829 856	21/04/2023	3 512 625	3 494 680	17 945
ACHAT	HUF	Goldman Sachs International	174 569 000	21/04/2023	462 051	473 464	11 413
ACHAT	IDR	Citibank N.A.	43 905 632 180	9/02/2023	2 768 238	2 928 458	160 220
VENTE	ILS	Deutsche Bank AG	1 133 180	20/04/2023	333 566	329 423	4 143
ACHAT	JPY	HSBC Bank	199 687 068	21/04/2023	1 549 683	1 550 844	1 161
VENTE	JPY	HSBC Bank	104 318 201	21/04/2023	814 787	810 174	4 613
ACHAT	KRW	Barclays Bank PLC	3 087 649 395	2/02/2023	2 475 086	2 506 615	31 529
VENTE	KRW	Barclays Bank PLC	3 087 649 395	2/02/2023	2 508 652	2 506 615	2 037
VENTE	KRW	Merrill Lynch International	46 423 077 346	2/02/2023 - 28/04/2023	37 776 522	37 749 347	27 175
ACHAT	MXN	JPMorgan Chase Bank N.A.	24 376 140	15/03/2023	1 182 766	1 285 011	102 245
VENTE	NOK	Deutsche Bank AG	9 930 153	21/04/2023	1 006 921	998 512	8 409
ACHAT	NZD	HSBC Bank	345 574	21/04/2023	221 487	223 458	1 971
ACHAT	NZD	JPMorgan Chase Bank N.A.	10 275 067	21/04/2023	6 604 813	6 644 136	39 323
ACHAT	PLN	State Street Bank Corp.	5 202 955	21/04/2023	1 185 990	1 194 046	8 056
ACHAT	SGD	State Street Bank Corp.	10 696 614	21/04/2023	8 118 323	8 155 504	37 181
ACHAT	THB	Barclays Bank PLC	269 889 360	21/02/2023	7 803 322	8 192 358	389 036
ACHAT	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	72 496 000	17/04/2023	2 219 501	2 221 135	1 634
ACHAT	TWD	Barclays Bank PLC	105 018 000	3/02/2023	3 494 543	3 498 035	3 492
VENTE	TWD	Barclays Bank PLC	105 018 000	5/05/2023	3 538 700	3 530 848	7 852
Total							**1 524 710 $**
Moins-value							
VENTE	AUD	Citibank N.A.	2 292	21/04/2023	1 602 $	1 623 $	(21) $
VENTE	AUD	UBS AG	3 012 232	21/04/2023	2 106 932	2 132 537	(25 605)
VENTE	CAD	BNP Paribas S.A.	8 879 092	21/04/2023	6 639 276	6 677 572	(38 296)
VENTE	CAD	JPMorgan Chase Bank N.A.	4 484 390	21/04/2023	3 354 769	3 372 511	(17 742)
VENTE	CAD	Morgan Stanley Capital Services Inc.	784 510	21/04/2023	583 237	589 995	(6 758)
ACHAT	CHF	State Street Bank Corp.	3 035 674	21/04/2023	3 345 613	3 343 596	(2 017)
ACHAT	EUR	HSBC Bank	772 943	21/04/2023	845 833	844 379	(1 454)
ACHAT	EUR	State Street Bank Corp.	2 817 713	21/04/2023	3 091 243	3 078 129	(13 114)
VENTE	EUR	BNP Paribas S.A.	3 090 842	21/04/2023	3 354 708	3 376 501	(21 793)
VENTE	EUR	Deutsche Bank AG	3 029 025	21/04/2023	3 291 214	3 308 971	(17 757)
VENTE	EUR	HSBC Bank	1 574 173	21/04/2023	1 708 361	1 719 660	(11 299)
VENTE	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	15 438 174	21/04/2023	16 769 143	16 864 988	(95 845)
VENTE	EUR	UBS AG	2 305 166	21/04/2023	2 507 543	2 518 212	(10 669)
ACHAT	GBP	HSBC Bank	12 645 393	21/04/2023	15 671 944	15 616 203	(55 741)
ACHAT	GBP	State Street Bank Corp.	767 035	21/04/2023	950 711	947 236	(3 475)
VENTE	GBP	HSBC Bank	497 855	21/04/2023	612 591	614 817	(2 226)
ACHAT	ILS	Deutsche Bank AG	5 166 000	20/04/2023	1 518 221	1 501 792	(16 429)
ACHAT	JPY	Deutsche Bank AG	371 749 280	21/04/2023	2 926 765	2 887 142	(39 623)
ACHAT	JPY	Merrill Lynch International	625 847 974	21/04/2023	4 949 078	4 860 567	(88 511)
ACHAT	JPY	Morgan Stanley Capital Services Inc.	85 639 691	21/04/2023	676 245	665 110	(11 135)
ACHAT	JPY	State Street Bank Corp.	6 121 658 521	21/04/2023	48 366 995	47 543 064	(823 931)
ACHAT	KRW	Barclays Bank PLC	20 518 158 068	2/02/2023	16 670 587	16 657 053	(13 534)
ACHAT	KRW	Merrill Lynch International	28 992 568 673	2/02/2023	23 560 471	23 536 750	(23 721)
VENTE	KRW	Barclays Bank PLC	20 933 800 368	2/02/2023 - 13/03/2023	14 738 046	16 994 969	(2 256 923)

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Total Return Fund – (suite)							
Moins-value – (suite)							
VENTE	KRW	Citibank N.A.	20 030 917 427	13/03/2023 - 12/04/2023	16 158 746 $	16 296 198 $	(137 452) $
VENTE	KRW	Merrill Lynch International	5 781 030 000	2/02/2023	4 545 550	4 693 156	(147 606)
ACHAT	MXN	HSBC Bank	11 528 314	21/04/2023	606 456	603 563	(2 893)
ACHAT	NOK	Deutsche Bank AG	1 135 825	21/04/2023	115 173	114 211	(962)
VENTE	NZD	HSBC Bank	8 960 531	21/04/2023	5 743 037	5 794 122	(51 085)
ACHAT	SEK	Deutsche Bank AG	27 061 685	21/04/2023	2 632 049	2 598 768	(33 281)
VENTE	TWD	Merrill Lynch International	251 195 045	3/02/2023 - 1/03/2023	8 104 810	8 379 871	(275 061)
Total							**(4 245 959) $**
Prudent Capital Fund							
Moins-value							
VENTE	EUR	Goldman Sachs International	21 554 130	21/04/2023	23 404 767 $	23 546 187 $	(141 420) $
U.S. Corporate Bond Fund							
Plus-value							
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	56 393	21/04/2023	61 241 $	61 605 $	364 $
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	56 393	21/04/2023	61 723	61 605	118
Total							**482 $**

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

Au 31 janvier 2023, les compartiments étaient liés par les contrats de change à terme spécifiques à certaines catégories. Chaque compartiment avait en caisse suffisamment de liquidités et/ou d'autres titres pour faire face à tous les engagements existant au titre de ces contrats dérivés.

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Blended Research European Equity Fund								
Plus-value								
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	1 179	27/02/2023	1 339 €	1 335 €	4 €
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	914 221	27/02/2023	839 523	839 566	43
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	CH1 (USD)	93 571	27/02/2023	85 925	85 930	5
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	103 618	27/02/2023	95 152	95 156	4
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	299 555	27/02/2023	275 080	275 094	14
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	102 853	27/02/2023	94 449	94 454	5
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	15 774	27/02/2023	14 502	14 486	16
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	CH1 (USD)	1 489	27/02/2023	1 368	1 367	1
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	1 766	27/02/2023	1 624	1 622	2
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	4 765	27/02/2023	4 381	4 376	5
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	1 753	27/02/2023	1 612	1 610	2
Total								**101 €**
Moins-value								
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	64 068	27/02/2023	72 785 €	72 577 €	(208) €
Continental European Equity Fund								
Plus-value								
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	17 851	27/02/2023	20 281 €	20 222 €	59 €
Moins-value								
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	963 857	27/02/2023	1 094 981 €	1 091 853 €	(3 128) €

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Contrarian Value Fund								
Plus-value								
ACHAT	CHF	Brown Brothers Harriman	WSH1 (CHF)	1 242 438	27/02/2023	1 352 760 $	1 360 774 $	8 014 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	10 036	27/02/2023	10 918	10 928	10
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	1 064	27/02/2023	1 157	1 158	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	8 469	27/02/2023	9 215	9 222	7
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WSH1 (EUR)	20 278	27/02/2023	22 060	22 081	21
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	6 683	27/02/2023	7 307	7 277	30
Total								**8 083 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	797 240	27/02/2023	868 233 $	868 131 $	(102) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	66 218	27/02/2023	72 117	72 106	(11)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	124 575	27/02/2023	135 661	135 652	(9)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WSH1 (EUR)	1 288 918	27/02/2023	1 403 764	1 403 528	(236)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	414 760	27/02/2023	513 016	511 617	(1 399)
Total								**(1 757) $**
Diversified Income Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	25 022	27/02/2023	27 222 $	27 247 $	25 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	20 989	27/02/2023	22 835	22 856	21
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH4 (EUR)	1 084	27/02/2023	1 179	1 180	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	1 484	27/02/2023	1 614	1 616	2
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	952	27/02/2023	1 035	1 036	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	1 802	27/02/2023	1 961	1 963	2
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	94	27/02/2023	116	116	0
Total								**52 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	1 498 128	27/02/2023	1 631 579 $	1 631 341 $	(238) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	1 208 479	27/02/2023	1 316 024	1 315 937	(87)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH4 (EUR)	62 729	27/02/2023	68 312	68 307	(5)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	85 846	27/02/2023	93 485	93 479	(6)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	55 070	27/02/2023	59 971	59 967	(4)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	104 591	27/02/2023	113 898	113 891	(7)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	51 554	27/02/2023	63 768	63 593	(175)
Total								**(522) $**
Emerging Markets Debt Fund								
Plus-value								
ACHAT	CHF	Brown Brothers Harriman	IH1 (CHF)	2 511 950	27/02/2023	2 735 621 $	2 751 199 $	15 578 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	206 207	27/02/2023	224 246	224 543	297
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	1 744 348	27/02/2023	1 897 999	1 899 455	1 456
Total								**17 331 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	26 173 021	27/02/2023	28 502 970 $	28 500 325 $	(2 645) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	5 020 176	27/02/2023	5 467 276	5 466 570	(706)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	409 998 129	27/02/2023	446 489 007	446 455 141	(33 866)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH2 (EUR)	106 994 063	27/02/2023	116 515 679	116 507 970	(7 709)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	ISH1 (EUR)	492 886	27/02/2023	536 749	536 714	(35)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	ISH2 (EUR)	60 933	27/02/2023	66 355	66 351	(4)

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Emerging Markets Debt Fund – (suite)								
Moins-value – (suite)								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	195 147	27/02/2023	212 513 $	212 499 $	(14) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	218 280	27/02/2023	237 732	237 689	(43)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH2 (EUR)	3 187 446	27/02/2023	3 471 103	3 470 873	(230)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WSH1 (EUR)	9 946 480	27/02/2023	10 831 638	10 830 921	(717)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	39 344	27/02/2023	42 803	42 842	(39)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	7 482	27/02/2023	8 140	8 148	(8)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	618 589	27/02/2023	672 975	673 594	(619)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH2 (EUR)	162 020	27/02/2023	176 265	176 427	(162)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	ISH1 (EUR)	746	27/02/2023	812	813	(1)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	ISH2 (EUR)	92	27/02/2023	100	101	(1)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	295	27/02/2023	322	322	(0)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	322	27/02/2023	350	350	(0)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH2 (EUR)	4 827	27/02/2023	5 251	5 256	(5)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WSH1 (EUR)	15 062	27/02/2023	16 387	16 402	(15)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	ISH2 (GBP)	53 189	27/02/2023	65 790	65 611	(179)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	1 723 224	27/02/2023	2 131 461	2 125 638	(5 823)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH2 (GBP)	1 460 493	27/02/2023	1 806 469	1 801 554	(4 915)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WSH2 (GBP)	52 494	27/02/2023	64 930	64 753	(177)
Total								**(57 913) $**
Emerging Markets Debt Local Currency Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	395	27/02/2023	430 $	431 $	1 $
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	60 442	27/02/2023	65 820 $	65 816 $	(4) $
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	170 864	27/02/2023	211 343	210 765	(578)
Total								**(582) $**
Emerging Markets Equity Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	4 389	27/02/2023	4 776 $	4 780 $	4 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	4 456	27/02/2023	4 848	4 852	4
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	392	27/02/2023	485	484	1
Total								**9 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	61 025	27/02/2023	66 455 $	66 451 $	(4) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	61 541	27/02/2023	67 018	67 013	(5)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	266 445	27/02/2023	329 579	328 667	(912)
Total								**(921) $**
Emerging Markets Equity Research Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	537	27/02/2023	584 $	584 $	0 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	1 022	27/02/2023	1 112	1 113	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	1 021	27/02/2023	1 111	1 112	1
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	34	27/02/2023	42	41	1
Total								**3 $**

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Emerging Markets Equity Research Fund – (suite)								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	31 936	27/02/2023	34 779 $	34 776 $	(3) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	60 885	27/02/2023	66 303	66 299	(4)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	60 828	27/02/2023	66 241	66 236	(5)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	54 275	27/02/2023	67 133	66 950	(183)
Total								**(195) $**
European Core Equity Fund								
Plus-value								
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	3 652	27/02/2023	4 149 €	4 138 €	11 €
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	3 224 817	27/02/2023	2 961 330	2 961 482	152
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	CH1 (USD)	1 625 855	27/02/2023	1 493 013	1 493 089	76
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	738 288	27/02/2023	677 965	678 000	35
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	183 934	27/02/2023	168 906	168 915	9
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	54 706	27/02/2023	50 294	50 238	56
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	CH1 (USD)	26 340	27/02/2023	24 216	24 190	26
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	12 583	27/02/2023	11 569	11 556	13
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	2 691	27/02/2023	2 474	2 471	3
Total								**381 €**
Moins-value								
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	206 344	27/02/2023	234 415 €	233 746 €	(669) €
European Research Fund								
Plus-value								
ACHAT	BRL	Standard Chartered Bank	IH1R (EUR)	2 800 874	2/02/2023 - 2/03/2023	498 031 €	505 798 €	7 767 €
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	95 542	27/02/2023	108 529	108 230	299
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	35 718 346	27/02/2023	32 799 920	32 801 621	1 701
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	CH1 (USD)	3 912 626	27/02/2023	3 592 940	3 593 125	185
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	11 424 259	27/02/2023	10 490 828	10 491 365	537
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	8 634 270	27/02/2023	7 928 797	7 929 204	407
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	71 129 970	27/02/2023	65 318 217	65 321 565	3 348
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	652 032	27/02/2023	599 497	598 788	709
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	CH1 (USD)	66 486	27/02/2023	61 125	61 057	68
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	168 083	27/02/2023	154 528	154 358	170
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	147 098	27/02/2023	135 235	135 086	149
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	1 212 621	27/02/2023	1 114 830	1 113 599	1 231
Total								**16 571 €**
Moins-value								
VENTE	BRL	Standard Chartered Bank	IH1R (EUR)	1 400 437	2/02/2023	251 610 €	253 762 €	(2 152) €
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	5 526 486	27/02/2023	6 278 411	6 260 379	(18 032)
ACHAT	SGD	Brown Brothers Harriman	IH1 (SGD)	209 325 627	27/02/2023	146 537 401	146 394 962	(142 439)
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	14 925	27/02/2023	13 711	13 706	(5)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	59 670	27/02/2023	54 689	54 797	(108)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	74	27/02/2023	68	68	(0)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	1 041	27/02/2023	954	956	(2)
Total								**(162 738) €**

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
European Smaller Companies Fund								
Plus-value								
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	19 410 630	27/02/2023	17 824 663 €	17 825 576 €	913 €
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	CH1 (USD)	2 517 590	27/02/2023	2 311 887	2 312 006	119
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	880 706	27/02/2023	808 747	808 788	41
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	3 220 007	27/02/2023	2 956 912	2 957 064	152
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	613 043	27/02/2023	562 954	562 983	29
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	341 795	27/02/2023	314 215	313 885	330
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	CH1 (USD)	42 910	27/02/2023	39 450	39 406	44
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	14 267	27/02/2023	13 116	13 102	14
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	89 399	27/02/2023	82 227	82 098	129
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	9 905	27/02/2023	9 106	9 096	10
Total								**1 781 €**
Moins-value								
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	532	27/02/2023	489 €	488 €	(1) €
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	CH1 (USD)	131 144	27/02/2023	120 597	120 435	(162)
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	169 519	27/02/2023	155 885	155 676	(209)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	25 000	27/02/2023	22 913	22 958	(45)
Total								**(417) €**
European Value Fund								
Plus-value								
ACHAT	CHF	Brown Brothers Harriman	AH1 (CHF)	9 719 961	27/02/2023	9 719 370 €	9 776 416 €	57 046 €
ACHAT	CHF	Brown Brothers Harriman	WH1 (CHF)	3 084 994	27/02/2023	3 084 825	3 102 912	18 087
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	67 713	27/02/2023	76 929	76 705	224
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	271 508 620	27/02/2023	249 324 705	249 337 487	12 782
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	122 892 992	27/02/2023	112 851 883	112 857 669	5 786
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	12 622 877	27/02/2023	11 591 510	11 592 104	594
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	5 343 978	27/02/2023	4 913 091	4 907 594	5 497
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	2 315 191	27/02/2023	2 128 719	2 126 135	2 584
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	210 056	27/02/2023	193 116	192 903	213
Total								**102 813 €**
Moins-value								
VENTE	CHF	Brown Brothers Harriman	AH1 (CHF)	158 275	27/02/2023	158 255 €	159 194 €	(939) €
VENTE	CHF	Brown Brothers Harriman	WH1 (CHF)	50 188	27/02/2023	50 182	50 480	(298)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	3 187 075	27/02/2023	3 620 647	3 610 305	(10 342)
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	5 553	27/02/2023	5 101	5 099	(2)
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	199 843	27/02/2023	183 946	183 524	(422)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	200 522	27/02/2023	183 471	184 147	(676)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	63 923	27/02/2023	58 458	58 703	(245)
Total								**(12 924) €**
Global Concentrated Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	1 091	27/02/2023	1 187 $	1 188 $	1 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	99 320	27/02/2023	108 052	108 152	100
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	557	27/02/2023	690	687	3
Total								**104 $**

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Concentrated Fund – (suite)								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	66 105	27/02/2023	71 987 $	71 983 $	(4) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	5 957 867	27/02/2023	6 488 070	6 487 640	(430)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	300 552	27/02/2023	371 754	370 738	(1 016)
Total								**(1 450) $**
Global Credit Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	4 538	27/02/2023	4 938 $	4 941 $	3 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	887	27/02/2023	966	967	1
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	82	27/02/2023	101	101	0
Total								**4 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	118 578	27/02/2023	129 130 $	129 122 $	(8) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	51 357	27/02/2023	55 927	55 923	(4)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	51 522	27/02/2023	63 728	63 553	(175)
Total								**(187) $**
Global Equity Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	2 045 241	27/02/2023	2 224 285 $	2 227 105 $	2 820 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	3 599 884	27/02/2023	3 916 378	3 919 985	3 607
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	1 041	27/02/2023	1 132	1 133	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	85 686	27/02/2023	93 220	93 305	85
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	5 223	27/02/2023	6 455	6 442	13
Total								**6 526 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	76 465 528	27/02/2023	83 271 864 $	83 264 838 $	(7 026) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	218 636 764	27/02/2023	238 093 687	238 077 934	(15 753)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	62 965	27/02/2023	68 568	68 564	(4)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	6 715 091	27/02/2023	7 315 821	7 312 196	(3 625)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	4 226 014	27/02/2023	5 227 178	5 212 890	(14 288)
Total								**(40 696) $**
Global Equity Income Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	2 089	27/02/2023	2 273 $	2 275 $	2 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	2 291	27/02/2023	2 493	2 495	2
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	1 093	27/02/2023	1 189	1 190	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	1 131	27/02/2023	1 230	1 232	2
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	78	27/02/2023	96	96	0
Total								**7 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	120 893	27/02/2023	131 652 $	131 643 $	(9) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	132 565	27/02/2023	144 362	144 352	(10)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	63 220	27/02/2023	68 846	68 841	(5)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	65 446	27/02/2023	71 270	71 265	(5)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	48 855	27/02/2023	60 429	60 265	(164)
Total								**(193) $**

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global High Yield Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	16 239	27/02/2023	17 667 $	17 683 $	16 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	1 197	27/02/2023	1 302	1 303	1
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	45	27/02/2023	56	56	0
Total								**17 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	948 119	27/02/2023	1 032 494 $	1 032 426 $	(68) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	72 347	27/02/2023	78 786	78 781	(5)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	52 765	27/02/2023	65 265	65 086	(179)
Total								**(252) $**
Global Intrinsic Value Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	14 662	27/02/2023	15 951 $	15 965 $	14 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	101 017	27/02/2023	109 898	110 000	102
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	969	27/02/2023	1 054	1 055	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	2 589	27/02/2023	2 817	2 819	2
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	910	27/02/2023	993	991	2
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	64	27/02/2023	79	78	1
Total								**122 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	881 754	27/02/2023	960 223 $	960 160 $	(63) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	6 101 356	27/02/2023	6 644 328	6 643 888	(440)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	58 518	27/02/2023	63 726	63 722	(4)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	156 562	27/02/2023	170 495	170 483	(12)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	408	27/02/2023	444	444	(0)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	52 389	27/02/2023	64 800	64 623	(177)
Total								**(696) $**
Global New Discovery Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	1 016	27/02/2023	1 106 $	1 107 $	1 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	11 495	27/02/2023	12 506	12 517	11
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	1 146	27/02/2023	1 247	1 248	1
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	39	27/02/2023	49	48	1
Total								**14 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	61 250	27/02/2023	66 701 $	66 697 $	(4) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	565 903	27/02/2023	616 264	616 223	(41)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	69 159	27/02/2023	75 313	75 308	(5)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	54 610	27/02/2023	67 547	67 362	(185)
Total								**(235) $**

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Opportunistic Bond Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	363 997	27/02/2023	396 127 $	396 364 $	237 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	9 751	27/02/2023	10 608	10 618	10
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	267 368	27/02/2023	290 874	291 142	268
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH2 (EUR)	6 847	27/02/2023	7 449	7 456	7
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	7 833	27/02/2023	8 522	8 529	7
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	7 567	27/02/2023	8 232	8 240	8
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	231	27/02/2023	251	251	0
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	IH1 (GBP)	128 105	27/02/2023	158 501	158 020	481
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	IH2 (GBP)	26 177	27/02/2023	32 377	32 290	87
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	374	27/02/2023	463	462	1
ACHAT	JPY	Brown Brothers Harriman	IH1 (JPY)	7 830 098	27/02/2023	60 304	60 359	55
Total								**1 161 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	9 216 243	27/02/2023	10 036 428 $	10 035 751 $	(677) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	664 035	27/02/2023	723 362	723 081	(281)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	20 189 306	27/02/2023	21 985 993	21 984 538	(1 455)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH2 (EUR)	396 171	27/02/2023	431 427	431 398	(29)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	453 192	27/02/2023	493 523	493 490	(33)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	694 512	27/02/2023	756 318	756 268	(50)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	IH1 (GBP)	12 160 727	27/02/2023	15 041 664	15 000 548	(41 116)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	IH2 (GBP)	9 553 495	27/02/2023	11 816 814	11 784 464	(32 350)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	283 333	27/02/2023	350 456	349 498	(958)
Total								**(76 949) $**
Global Research Focused Fund								
Plus-value								
ACHAT	JPY	Brown Brothers Harriman	IH1 (JPY)	316 141 712	27/02/2023	2 434 856 $	2 437 022 $	2 166 $
Moins-value								
ACHAT	JPY	Brown Brothers Harriman	IH1 (JPY)	16 686 514	27/02/2023	128 898 $	128 630 $	(268) $
VENTE	JPY	Brown Brothers Harriman	IH1 (JPY)	3 273 691	27/02/2023	25 192	25 235	(43)
Total								**(311) $**
Global Strategic Equity Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	956	27/02/2023	1 040 $	1 041 $	1 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	965	27/02/2023	1 049	1 050	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	964	27/02/2023	1 049	1 050	1
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	90	27/02/2023	111	111	0
Total								**3 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	58 159	27/02/2023	63 335 $	63 331 $	(4) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	58 266	27/02/2023	63 451	63 447	(4)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	58 231	27/02/2023	63 414	63 409	(5)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	52 115	27/02/2023	64 461	64 285	(176)
Total								**(189) $**

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Total Return Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	278 472	27/02/2023	302 954 $	303 233 $	279 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	37 604	27/02/2023	40 910	40 948	38
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH4 (EUR)	1 663	27/02/2023	1 809	1 811	2
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	54 681	27/02/2023	59 488	59 543	55
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	1 566	27/02/2023	1 704	1 705	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	79 842	27/02/2023	86 861	86 941	80
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	3 343	27/02/2023	3 655	3 640	15
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	3 910	27/02/2023	4 266	4 257	9
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	2 680	27/02/2023	3 312	3 306	6
Total								**485 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	15 902 807	27/02/2023	17 318 206 $	17 316 884 $	(1 322) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH2 (EUR)	2 264 442	27/02/2023	2 465 959	2 465 796	(163)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH4 (EUR)	96 214	27/02/2023	104 777	104 770	(7)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	5 721 013	27/02/2023	6 230 145	6 229 726	(419)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	94 782	27/02/2023	103 217	103 210	(7)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	4 819 098	27/02/2023	5 247 959	5 247 612	(347)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	17 314	27/02/2023	18 821	18 854	(33)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	861 195	27/02/2023	937 436	937 773	(337)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	1 708 755	27/02/2023	2 113 634	2 109 828	(3 806)
Total								**(6 441) $**
Inflation-Adjusted Bond Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	206 073	27/02/2023	224 168 $	224 397 $	229 $
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	11 706 558	27/02/2023	12 748 359 $	12 747 505 $	(854) $
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	7 868	27/02/2023	8 565	8 568	(3)
Total								**(857) $**
Managed Wealth Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	918	27/02/2023	998 $	999 $	1 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	961	27/02/2023	1 046	1 047	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	2 004	27/02/2023	2 180	2 182	2
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	942	27/02/2023	1 025	1 026	1
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	79	27/02/2023	98	98	0
Total								**5 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	53 098	27/02/2023	57 823 $	57 819 $	(4) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	55 630	27/02/2023	60 582	60 578	(4)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	115 937	27/02/2023	126 254	126 246	(8)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	54 496	27/02/2023	59 346	59 342	(4)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	49 650	27/02/2023	61 412	61 244	(168)
Total								**(188) $**

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Prudent Capital Fund								
Plus-value								
ACHAT	BRL	Standard Chartered Bank	IH1R (USD)	118 982 637	2/02/2023 - 2/03/2023	22 812 338 $	23 383 877 $	571 539 $
ACHAT	CHF	Brown Brothers Harriman	AH1 (CHF)	296 995	27/02/2023	323 440	325 282	1 842
ACHAT	CHF	Brown Brothers Harriman	WH1 (CHF)	1 677 508	27/02/2023	1 826 878	1 837 281	10 403
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	2 896 181	27/02/2023	3 150 756	3 153 709	2 953
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH4 (EUR)	50 210	27/02/2023	54 625	54 675	50
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	2 976 427	27/02/2023	3 238 124	3 241 090	2 966
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	278 194	27/02/2023	302 653	302 931	278
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	672 653	27/02/2023	731 791	732 465	674
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	422 951	27/02/2023	462 160	460 560	1 600
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	52 736	27/02/2023	57 665	57 425	240
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	91 371	27/02/2023	99 740	99 496	244
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	2 731	27/02/2023	3 375	3 369	6
ACHAT	JPY	Brown Brothers Harriman	ZH1 (JPY)	895 259 094	27/02/2023	6 894 936	6 901 228	6 292
Total								**599 087 $**
Moins-value								
VENTE	BRL	Standard Chartered Bank	IH1R (USD)	63 149 773	2/02/2023	12 357 082 $	12 440 118 $	(83 036) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	171 117 364	27/02/2023	186 345 440	186 333 111	(12 329)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH4 (EUR)	2 886 620	27/02/2023	3 143 506	3 143 298	(208)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	176 496 937	27/02/2023	192 206 916	192 191 036	(15 880)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	16 080 854	27/02/2023	17 511 921	17 510 763	(1 158)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	40 398 246	27/02/2023	43 993 366	43 990 455	(2 911)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	726 510	27/02/2023	790 827	791 111	(284)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	25 060	27/02/2023	27 225	27 288	(63)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	22 683	27/02/2023	24 691	24 700	(9)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	122 442	27/02/2023	133 281	133 329	(48)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	5 258 897	27/02/2023	6 504 756	6 486 975	(17 781)
Total								**(133 707) $**
Prudent Wealth Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	3 256 897	27/02/2023	3 543 237 $	3 546 501 $	3 264 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	3 996 634	27/02/2023	4 348 089	4 352 014	3 925
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	381 097	27/02/2023	414 603	414 985	382
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	1 887 432	27/02/2023	2 060 059	2 055 263	4 796
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	6 182	27/02/2023	6 760	6 732	28
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	28 388	27/02/2023	31 027	30 913	114
Total								**12 509 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	285 522 327	27/02/2023	310 931 530 $	310 910 957 $	(20 573) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	359 861 261	27/02/2023	391 886 044	391 860 106	(25 938)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	33 819 630	27/02/2023	36 829 306	36 826 869	(2 437)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	566 252	27/02/2023	615 675	616 603	(928)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	59 561	27/02/2023	64 709	64 857	(148)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	24 060	27/02/2023	26 139	26 199	(60)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	4 873 958	27/02/2023	6 028 560	6 012 144	(16 416)
Total								**(66 500) $**

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
U.S. Concentrated Growth Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	734	27/02/2023	799 $	799 $	0 $
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	118 942	27/02/2023	129 527 $	129 520 $	(7) $
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	479 471	27/02/2023	593 059	591 438	(1 621)
Total								**(1 628) $**
U.S. Corporate Bond Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	25 657	27/02/2023	27 912 $	27 938 $	26 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	59 749	27/02/2023	65 002	65 062	60
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	24 665	27/02/2023	26 834	26 859	25
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	508	27/02/2023	555	553	2
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	3 468	27/02/2023	4 286	4 278	8
Total								**121 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	1 480 312	27/02/2023	1 612 048 $	1 611 941 $	(107) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	3 090 539	27/02/2023	3 365 577	3 365 350	(227)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	3 751 445	27/02/2023	4 089 494	4 085 023	(4 471)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	12 055	27/02/2023	13 122	13 127	(5)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	2 174 605	27/02/2023	2 689 779	2 682 427	(7 352)
Total								**(12 162) $**
U.S. Government Bond Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	1 854 527	27/02/2023	2 016 955 $	2 019 431 $	2 476 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH2 (EUR)	452 368	27/02/2023	492 140	492 593	453
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	7 380	27/02/2023	8 052	8 036	16
Total								**2 945 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	50 372 576	27/02/2023	54 855 968 $	54 851 703 $	(4 265) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH2 (EUR)	26 330 942	27/02/2023	28 674 184	28 672 287	(1 897)
Total								**(6 162) $**
U.S. Growth Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	945	27/02/2023	1 028 $	1 030 $	2 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	840	27/02/2023	914	915	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	1 132	27/02/2023	1 231	1 232	1
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	98	27/02/2023	121	121	0
Total								**4 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	56 984	27/02/2023	62 055 $	62 051 $	(4) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	50 669	27/02/2023	55 178	55 174	(4)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	68 219	27/02/2023	74 290	74 285	(5)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	48 496	27/02/2023	59 985	59 821	(164)
Total								**(177) $**

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
U.S. Total Return Bond Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	9 559	27/02/2023	10 400 $	10 409 $	9 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	870 170	27/02/2023	946 673	947 545	872
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	746	27/02/2023	811	812	1
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	78	27/02/2023	96	96	0
Total								**882 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	553 224	27/02/2023	602 457 $	602 417 $	(40) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	38 401 457	27/02/2023	41 818 880	41 816 113	(2 767)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	43 132	27/02/2023	46 970	46 967	(3)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	48 841	27/02/2023	60 412	60 247	(165)
Total								**(2 975) $**
U.S. Value Fund								
Plus-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	413 673	27/02/2023	449 925 $	450 457 $	532 $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	121 822	27/02/2023	132 533	132 655	122
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	908	27/02/2023	987	988	1
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	388 422	27/02/2023	422 571	422 961	390
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	382 585	27/02/2023	417 433	416 605	828
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	30 000	27/02/2023	32 804	32 668	136
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	67 708	27/02/2023	83 905	83 520	385
Total								**2 394 $**
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	19 257 420	27/02/2023	20 971 194 $	20 969 789 $	(1 405) $
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	11 732 245	27/02/2023	12 776 340	12 775 476	(864)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	53 003	27/02/2023	57 720	57 716	(4)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	22 790 028	27/02/2023	24 818 158	24 816 516	(1 642)
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	100 000	27/02/2023	108 853	108 892	(39)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	2 101 134	27/02/2023	2 598 903	2 591 799	(7 104)
Total								**(11 058) $**

Note 12 : Accords de mise en pension

Détails des accords de mise en pension en circulation au 31 janvier 2023 :

Compartiment	Contrepartie	Date d'échéance	Taux d'intérêt	Devise	Valeur de marché	Garantie
Asia Ex-Japan Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	24 000	24 602
Contrarian Value Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	587 000	599 294
Diversified Income Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	260 000	265 697
Emerging Markets Debt Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	4 913 000	5 013 798
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	105 000	107 263
Emerging Markets Equity Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	75 000	76 757
Emerging Markets Equity Research Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	5 000	5 904
Global Concentrated Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	335 000	342 454
Global Credit Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	99 000	101 358
Global Equity Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	778 000	794 138
Global Equity Income Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	4 000	4 920
Global High Yield Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	318 000	324 741
Global Intrinsic Value Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	78 000	79 709
Global New Discovery Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	7 000	7 873
Global Opportunistic Bond Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	539 000	550 091
Global Research Focused Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	30 000	31 490
Global Strategic Equity Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	67 000	68 884
Global Total Return Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	2 225 000	2 270 232
Inflation-Adjusted Bond Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	18 000	18 697
Limited Maturity Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	1 469 000	1 499 711
Managed Wealth Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	201 000	205 669
Prudent Capital Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	2 817 000	2 874 447
Prudent Wealth Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	6 885 000	7 025 222
U.S. Concentrated Growth Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	83 000	85 613
U.S. Corporate Bond Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	827 000	844 326
U.S. Government Bond Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	772 000	788 234
U.S. Total Return Bond Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	100 000	102 343
U.S. Value Fund	BofA Securities, Inc.	1/02/2023	4,26 %	USD	728 000	742 967

Au 31 janvier 2023, pour les accords de mise en pension avec Merrill Lynch, Pierce et Fenner & Smith, Inc. qui sont détenus par le Dépositaire, des garanties d'une valeur de marché de 24 856 434 USD ont été reçues. Les garanties reçues consistaient en des emprunts de haute qualité de l'État américain et d'organismes fédéraux américains.

Note 13 : Contrats à terme standardisés ouverts

Au 31 janvier 2023, les compartiments étaient liés par les contrats à terme standardisés suivants. Chaque compartiment avait en caisse suffisamment de liquidités et/ou d'autres titres pour faire face à tous les engagements au titre de ces contrats dérivés.

Description	Devise	Contrepartie	Expiration	Notionnel	Contrats	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Diversified Income Fund						
Obligation du Trésor américain (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	500 000	5	16 778 $
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	1 200 000	12	13 426
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	1 200 000	6	624
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	1 500 000	15	17 049
Obligation du Trésor américain Ultra (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	800 000	8	45 877
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	1 800 000	18	(35 065)
Total						**58 689 $**

Description	Devise	Contrepartie	Expiration	Notionnel	Contrats	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Emerging Markets Debt Fund						
Euro-Bund à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	25 000 000	250	1 214 342 $
Euro-OAT à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	2 200 000	22	109 732
Obligation du Trésor américain (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	7 800 000	78	257 197
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	28 100 000	281	417 771
Obligation du Trésor américain Ultra (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	10 300 000	103	607 885
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	12 000 000	120	195 012
Total						**2 801 939 $**
Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
Euro-Bund à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	200 000	2	3 909 $
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	300 000	3	3 653
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	500 000	5	8 566
Total						**16 128 $**
Euro Credit Fund						
Euro-Bobl à 5 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	3 000 000	30	12 015 €
Euro-Bund à 10 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	1 200 000	12	(30 270)
Euro-Buxl à 30 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	300 000	3	50 200
Euro-Schatz à 2 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	1 500 000	15	(6 435)
Gilt longue échéance 10 ans (court)	GBP	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	1 800 000	18	6 169
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	2 600 000	26	(28 940)
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	2 000 000	20	(7 668)
Total						**(4 929) €**
Global Credit Fund						
Euro-Bobl à 5 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	4 000 000	40	29 263 $
Euro-Bund à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	300 000	3	(1 344)
Euro-Buxl à 30 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	300 000	3	(11 932)
Gilt longue échéance 10 ans (court)	GBP	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	500 000	5	1 710
Obligation du Trésor américain (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	2 200 000	22	(13 143)
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	1 700 000	17	(4 177)
Obligation du Trésor américain Ultra (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	400 000	4	(3 331)
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	4 300 000	43	17 984
Total						**15 030 $**
Global High Yield Fund						
Obligation du Trésor américain (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	600 000	6	20 134 $
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	3 000 000	30	(43 726)
Obligation du Trésor américain Ultra (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	100 000	1	6 067
Total						**(17 525) $**
Global Opportunistic Bond Fund						
Obligation australienne à 10 ans (court)	AUD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	4 100 000	41	42 492 $
Obligation du Trésor canadien à 10 ans (long)	CAD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	15 800 000	158	161 572
Obligation du Trésor canadien à 5 ans (long)	CAD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	14 500 000	145	(50 114)
Euro-Bobl à 5 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	39 200 000	392	575 430
Euro-BTP à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	12 700 000	127	359 785
Euro-BTP court terme (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	10 900 000	109	3 761
Euro-Bund à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	500 000	5	(477)

Description	Devise	Contrepartie	Expiration	Notionnel	Contrats	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Opportunistic Bond Fund – (suite)						
Euro-Buxl à 30 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	2 200 000	22	(383 669) $
Euro-Schatz à 2 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	25 800 000	258	220 180
Gilt longue échéance à 10 ans (long)	GBP	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	3 600 000	36	4 044
Obligation du Trésor américain (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	3 800 000	38	(10 703)
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	4 500 000	45	(78 165)
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	14 800 000	74	(6 462)
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	5 000 000	50	(5 142)
Obligation du Trésor américain Ultra (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	300 000	3	9 115
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	14 500 000	145	(115 440)
Total						**726 207 $**
Global Total Return Fund						
Obligation du Trésor canadien à 10 ans (long)	CAD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	9 100 000	91	82 623 $
Obligation du Trésor canadien à 5 ans (long)	CAD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	30 600 000	306	(8 375)
Euro-Bobl à 5 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	45 600 000	456	638 815
Euro-BTP à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	11 100 000	111	330 175
Euro-BTP Court terme (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	15 600 000	156	13 197
Euro-Bund à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	4 000 000	40	(8 809)
Euro-Buxl à 30 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	8 000 000	80	(1 399 377)
Euro-Schatz à 2 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	18 700 000	187	138 842
Gilt longue échéance à 10 ans (long)	GBP	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	5 300 000	53	(31 604)
Obligation du Trésor américain (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	3 900 000	39	(23 300)
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	16 800 000	168	220 000
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	1 000 000	5	(1 189)
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	31 400 000	314	(333 633)
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	34 700 000	347	(270 297)
Total						**(652 932) $**
Inflation-Adjusted Bond Fund						
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	4 900 000	49	(19 522) $
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	9 900 000	99	(29 607)
Total						**(49 129) $**
Limited Maturity Fund						
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	19 000 000	95	68 246 $
Managed Wealth Fund						
Indice Mini MSCI EAFE (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	2 300	46	(291 928) $
Indice Russell 1000 Growth (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	2 000	40	(106 640)
Indice Russell 1000 Value (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	3 000	60	(171 142)
Total						**(569 710) $**
Prudent Capital Fund						
Indice Mini MSCI EAFE (court)	USD	Goldman Sachs International	Mars 2023	31 350	627	(3 900 279) $
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	Goldman Sachs International	Mars 2023	23 400	468	(2 162 445)
Total						**(6 062 724) $**

Description	Devise	Contrepartie	Expiration	Notionnel	Contrats	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Prudent Wealth Fund						
Indice Mini MSCI EAFE (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	29 100	582	(3 620 354) $
Indice S&P 500 E-Mini (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	21 750	435	(2 009 966)
Total						**(5 630 320) $**
U.S. Corporate Bond Fund						
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	30 200 000	151	71 989 $
Obligation du Trésor américain Ultra (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	11 700 000	117	709 805
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	41 900 000	419	(732 783)
Total						**49 011 $**
U.S. Government Bond Fund						
Obligation du Trésor américain (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	5 100 000	51	171 281 $
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	15 600 000	156	148 255
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	22 000 000	110	(21 821)
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	3 900 000	39	3 823
Obligation du Trésor américain Ultra (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	8 300 000	83	464 967
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	4 000 000	40	25 683
Total						**792 188 $**
U.S. Total Return Bond Fund						
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	15 600 000	78	56 034 $
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	9 600 000	96	115 161
Obligation du Trésor américain Ultra (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	14 100 000	141	618 144
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2023	9 600 000	96	(71 954)
Total						**717 385 $**

Les Bilans reflètent la marge de variation quotidienne nette éventuelle au 31 janvier 2023 sur les contrats à terme standardisés ouverts, laquelle pourrait différer de la plus-value/(moins- value) nette non réalisée indiquée ci-avant. Au 31 janvier 2023, chaque compartiment avait en caisse suffisamment de liquidités et/ou d'autres titres pour faire face à tous ses engagements au titre de ces contrats dérivés.

Note 14 : Contrats de swap

Au 31 janvier 2023, les compartiments étaient liés par les contrats de swap en circulation suivants. Chaque compartiment avait en caisse suffisamment de liquidités et/ou d'autres titres pour faire face à tous les engagements existant au titre de ces contrats dérivés.

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Emerging Markets Debt Fund						
Contrats de swap non compensés						
Swaps sur défaillance de crédit						
Moins-value						
20/12/2024	USD	6 313 000 (a)	Barclays Bank PLC	(1)	1,00 % / trimestre	(82 152) $

(1) Le compartiment, en tant qu'acheteur de la protection, recevra un montant notionnel en cas de survenance d'un événement de crédit déterminé de la part de la Corée du Sud, 2,75 %, 19/01/2027.
(a) Les primes nettes non amorties reçues par le fonds se sont élevées à 77 422 USD.

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
Contrats de swap non compensés						
Swaps de taux d'intérêt						
Plus-value						
7/07/2027	MYR	1 984 000	JPMorgan Chase	3,65 % / trimestre	KLIBOR 3 mois / trimestre	2 835 $

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Contrats de swap compensés						
Swaps de taux d'intérêt						
Plus-value						
25/01/2028	CLP	272 394 000	compensation centralisée	5,405 % / semestre	CLOIS quotidien /jour	3 756 $
13/04/2032	USD	165 000	compensation centralisée	3,116 % / à l'échéance	USA-CPI-U /à l'échéance	4 983
12/05/2032	USD	260 000	compensation centralisée	2,921 % / à l'échéance	USA-CPI-U /à l'échéance	4 414
15/03/2033	USD	175 000 (a)	compensation centralisée	3,75 %/an	SOFR quotidien /jour	8 416
Total						**21 569 $**
Moins-value						
2/01/2025	BRL	2 159 000	compensation centralisée	12,585 % / à l'échéance	BZDIOVRA quotidien /jour	(1 491) $
2/01/2025	BRL	4 361 000	compensation centralisée	12,72 % / à l'échéance	BZDIOVRA quotidien /jour	(1 153)
28/03/2025	MXN	2 621 000	compensation centralisée	6,24 % / 28 jours	28 jour TIIE /28 jours	(9 219)
9/04/2025	MXN	9 553 000	compensation centralisée	6,27 % / 28 jours	28 jour TIIE /28 jours	(33 415)
11/04/2025	MXN	3 665 000	compensation centralisée	5,98 % / 28 jours	28 jour TIIE /28 jours	(13 942)
Total						**(59 220) $**

(a) Les primes nettes non amorties versées par le compartiment se sont élevées à 5 376 $

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Euro Credit Fund						
Contrats de swap compensés						
Swaps sur défaillance de crédit						
Moins-value						
20/12/2027	EUR	13 120 000 (a)	compensation centralisée	(1)	1,00 % / trimestre	(120 551) €
20/12/2027	EUR	4 740 000 (b)	compensation centralisée	(2)	5,00 % / trimestre	(158 601)
Total						**(279 152) €**

(1) Le compartiment, en tant qu'acheteur de la protection, recevra un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini, en fonction d'une obligation de référence spécifiée dans l'indice iTraxx Europe Series 38.

(2) Le compartiment, en tant qu'acheteur de la protection, recevra un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini, en fonction d'une obligation de référence spécifiée dans l'indice iTraxx Europe Crossover Series 38.

(a) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 86 112 USD.

(b) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 120 496 USD.

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Global Credit Fund						
Contrats de swap compensés						
Depreciation						
Moins-value						
20/12/2027	EUR	13 310 000 (a)	compensation centralisée	(1)	1,00 % / trimestre	(133 065) $
20/12/2027	EUR	4 570 000 (b)	compensation centralisée	(2)	5,00 % / trimestre	(166 239)
Total						**(299 304) $**

(1) Le compartiment, en tant qu'acheteur de la protection, recevra un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini, en fonction d'une obligation de référence spécifiée dans l'indice iTraxx Europe Crossover Series 38.

(2) Le compartiment, en tant qu'acheteur de la protection, recevra un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini, en fonction d'une obligation de référence spécifiée dans l'indice iTraxx Europe Crossover Series 38.

(a) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 92 284 USD.

(b) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 124 017 USD.

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Global Opportunistic Bond Fund						
Contrats de swap non compensés						
Swaps sur défaillance de crédit						
Moins-value						
20/12/2027	EUR	27 980 000 (a)	compensation centralisée	(1)	1,00 %/trimestre	(279 726) $
20/12/2027	EUR	9 700 000 (b)	compensation centralisée	(2)	5,00 %/trimestre	(352 849)
Total						**(632 575) $**

(1) Le compartiment, en tant qu'acheteur de la protection, recevra un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini, en fonction d'une obligation de référence spécifiée dans l'indice iTraxx Europe Series 38.
(2) Le compartiment, en tant qu'acheteur de la protection, recevra un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini, en fonction d'une obligation de référence spécifiée dans l'indice iTraxx Europe Crossover Series 38.
(a) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 193 990 USD.
(b) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 263 327 USD.

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Global Total Return Fund						
Contrats de swap non compensés						
Swaps sur défaillance de crédit						
Moins-value						
20/12/2027	EUR	90 480 000 (a)	compensation centralisée	(1)	1,00 % / trimestre	(904 562) $

(1) Le compartiment, en tant qu'acheteur de la protection, recevra un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini, en fonction d'une obligation de référence spécifiée dans l'indice iTraxx Europe Series 38.
(a) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 677 036 USD.

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Limited Maturity Fund						
Contrats de swap compensés						
Swaps de taux d'intérêt						
Plus-value						
17/10/2025	USD	19 900 000	compensation centralisée	4,20 % / an	SOFR quotidien /an	163 383 $
Moins-value						
6/12/2025	USD	65 100 000 (a)	compensation centralisée	3,82 % / an	SOFR quotidien /an	(33 754) $

(a) Les primes nettes non amorties versées par le compartiment se sont élevées à 9 609 $.

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

BZDIOVRA	Taux de dépôt interbancaire brésilien
CLOIS	Sinacofi Chile Interbank Rate Average
KLIBOR	Taux interbancaire offert kaélois
SOFR	Secured Overnight Financing Rate
TIIE	Interbank Equilibrium Interest Rate
USA-CPI-U	Indice des prix à la consommation pour tous les consommateurs urbains

Note 15 : Frais de transaction

Pour l'exercice clos le 31 janvier 2023, les compartiments ont engagé des frais de transaction, qui ont été définis comme des commissions de courtage (pouvant comprendre des coûts liés à la recherche, voir la Note 7) au titre de l'achat ou de la vente de valeurs mobilières, d'instruments du marché monétaire, d'instruments dérivés ou d'autres actifs éligibles et comme des frais facturés par le Dépositaire pour l'exécution des transactions des compartiments. Les commissions de courtage sont portées au poste « Coût identifié » des Tableaux des investissements ou au poste « Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change » dans les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Le remboursement de la recherche par MFS, le cas échéant, est comptabilisé au poste « Autre » dans les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Les frais facturés par le Dépositaire sont portés au poste « Commission de dépositaire » dans les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net.

Compartiment	Frais de transaction
Asia Ex-Japan Fund	95 091 $
Blended Research European Equity Fund	26 454 €
Continental European Equity Fund	27 132 €
Contrarian Value Fund	122 480 $
Diversified Income Fund	61 328 $
Emerging Markets Debt Fund	85 119 $
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	29 314 $
Emerging Markets Equity Fund	155 660 $
Emerging Markets Equity Research Fund	15 113 $
Euro Credit Fund	13 684 €
European Core Equity Fund	47 003 €
European Research Fund	723 060 €
European Smaller Companies Fund	122 573 €
European Value Fund	1 383 378 €
Global Concentrated Fund	47 615 $
Global Credit Fund	15 729 $
Global Equity Fund	91 298 $
Global Equity Income Fund	36 662 $
Global High Yield Fund	12 349 $
Global Intrinsic Value Fund	48 209 $
Global New Discovery Fund	12 127 $
Global Opportunistic Bond Fund	130 108 $
Global Research Focused Fund	15 266 $
Global Strategic Equity Fund (b)	4 141 $
Global Total Return Fund	214 096 $
Inflation-Adjusted Bond Fund	11 058 $
Japan Equity Fund	20 571 847 ¥
Latin American Equity Fund	42 377 $
Limited Maturity Fund	4 649 $
Managed Wealth Fund	32 014 $
Prudent Capital Fund	453 905 $
Prudent Wealth Fund	439 979 $
U.K. Equity Fund	9 470£
U.S. Concentrated Growth Fund	29 856 $
U.S. Corporate Bond Fund	34 801 $
U.S. Government Bond Fund	32 109 $
U.S. Growth Fund	7 698 $
U.S. Total Return Bond Fund	32 803 $
U.S. Value Fund	101 846 $

(b) Le compartiment a commencé ses activités le 18 mai 2022.
(d) Le compartiment a cessé ses activités le 28 juin 2022. Les informations pour la période actuelle sont valables au 28 juin 2022 et les informations de la fin de période publiées sont valables à compter de cette date.

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

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

	Exigences légales et réglementaires luxembourgeoises	Principes comptables généralement admis aux États-Unis
Titres à revenu fixe	La prime sur les titres à revenu fixe ne doit pas nécessairement être amortie quotidiennement sous forme de revenu. La décote sur les certificats de coupon ne doit pas nécessairement s'accumuler quotidiennement sous forme de revenu.	La prime sur les titres à revenu fixe est amortie quotidiennement sous forme de revenu. La décote sur les certificats de coupon s'accumule quotidiennement en tant que revenu.

Compartiment	Total des revenus de placements nets en application des prescriptions légales et réglementaires luxembourgeoises	Ajustement net au titre de l'accroissement de la décote et de l'amortissement de la prime sur certains titres à revenu fixe	Total des revenus de placements nets en application des principes comptables généralement admis aux États-Unis
Diversified Income Fund	2 433 145 $	(158 563) $	2 274 582 $
Emerging Markets Debt Fund	107 135 708 $	(3 456 452) $	103 679 256 $
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	1 172 579 $	(78 111) $	1 094 468 $
Euro Credit Fund	1 546 666 €	(189 773) €	1 356 893 €
Global Credit Fund	2 390 081 $	(290 201) $	2 099 880 $
Global High Yield Fund	10 620 938 $	(821 314) $	9 799 624 $
Global Opportunistic Bond Fund	9 668 410 $	(821 302) $	8 847 108 $
Global Total Return Fund	15 853 793 $	(1 455 875) $	14 397 918 $
Inflation-Adjusted Bond Fund	15 887 618 $	(3 980 518) $	11 907 100 $
Limited Maturity Fund	15 102 145 $	(2 615 328) $	12 486 817 $
Prudent Capital Fund	22 186 899 $	(9 193 707) $	12 993 192 $
Prudent Wealth Fund	1 930 583 $	(6 463 764) $	(4 533 181) $
U.S. Corporate Bond Fund	10 231 714 $	(837 039) $	9 394 675 $
U.S. Government Bond Fund	5 901 612 $	(566 070) $	5 335 542 $
U.S. Total Return Bond Fund	13 484 479 $	(713 480) $	12 770 999 $

Compartiment	Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les instruments dérivés et les conversions de devises en application des exigences légales et réglementaires luxembourgeoises	Ajustement net au titre de l'accroissement de la décote et de l'amortissement de la prime sur certains titres à revenu fixe	Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les instruments dérivés et les conversions de devises en application des principes comptables généralement admis aux États-Unis
Diversified Income Fund	(2 717 835) $	150 608 $	(2 567 227) $
Emerging Markets Debt Fund	(241 268 507) $	5 717 859 $	(235 550 648) $
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	(3 834 553) $	148 083 $	(3 686 470) $
Euro Credit Fund	(9 386 398) €	292 442 €	(9 093 956) €
Global Credit Fund	(8 365 564) $	159 333 $	(8 206 231) $
Global High Yield Fund	(10 422 850) $	716 114 $	(9 706 736) $
Global Opportunistic Bond Fund	(50 134 169) $	1 543 626 $	(48 590 543) $
Global Total Return Fund	(3 701 668) $	1 474 603 $	(2 227 065) $
Inflation-Adjusted Bond Fund	(15 951 669) $	3 445 283 $	(12 506 386) $
Limited Maturity Fund	(16 798 195) $	1 586 659 $	(15 211 536) $
Prudent Capital Fund	(70 520 270) $	18 077 891 $	(52 442 379) $
Prudent Wealth Fund	70 859 615 $	16 080 202 $	86 939 817 $
U.S. Corporate Bond Fund	(24 138 236) $	1 138 708 $	(22 999 528) $
U.S. Government Bond Fund	(6 712 332) $	244 966 $	(6 467 366) $
U.S. Total Return Bond Fund	(28 236 245) $	1 061 182 $	(27 175 063) $

Compartiment	Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les instruments dérivés et les conversions de devises en application des exigences légales et réglementaires luxembourgeoises	Ajustement net au titre de l'accroissement de la décote et de l'amortissement de la prime sur certains titres à revenu fixe	Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les instruments dérivés et les conversions de devises en application des principes comptables généralement admis aux États-Unis
Diversified Income Fund	(9 229 065) $	7 955 $	(9 221 110) $
Emerging Markets Debt Fund	(167 814 603) $	(2 261 407) $	(170 076 010) $
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	865 624 $	69 972 $	795 652 $
Euro Credit Fund	(2 005 738) €	(102 669) €	(2 108 407) €
Global Credit Fund	(5 696 870) $	130 868 $	(5 566 002) $
Global High Yield Fund	(18 267 491) $	105 200 $	(18 162 291) $
Global Opportunistic Bond Fund	(8 978 126) $	(722 324) $	(9 700 450) $
Global Total Return Fund	(127 971 043) $	(18 728) $	(127 989 771) $
Inflation-Adjusted Bond Fund	(22 075 439) $	535 235 $	(21 540 204) $
Limited Maturity Fund	(24 920 104) $	1 028 669 $	(23 891 435) $
Prudent Capital Fund	(436 464 243) $	(8 884 184) $	(445 348 427) $
Prudent Wealth Fund	(676 756 258) $	(9 616 438) $	(686 372 696) $
U.S. Corporate Bond Fund	(27 594 845) $	(301 669) $	(27 896 514) $
U.S. Government Bond Fund	(20 537 893) $	321 104 $	(20 216 789) $
U.S. Total Return Bond Fund	(35 834 085) $	(347 702) $	(36 181 787) $

Note 17 : Conflit entre la Russie et l'Ukraine

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

Note 18 : Événements relatifs aux catégories d'actions

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Fund ont commencé leurs activités le 18 mai 2022 :

Contrarian Value Fund	A1 (EUR), W1 (EUR)

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Fund ont commencé leurs activités le 9 juin 2022 :

Japan Equity Fund	I1 (JPY)

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Fund ont commencé leurs activités le 26 juillet 2022 :

Contrarian Value Fund WS1 (USD)	WSH1 (CHF), WSH1 (EUR)
European Research Fund	ISB1 (EUR)

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Fund ont commencé leurs activités le 13 septembre 2022 :

Inflation Adjusted Bond Fund	IH1 (EUR)

Note 19 : Événements postérieurs

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

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

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Fund ont commencé leurs activités le 31 mars 2023 :

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

ADDENDA

FRAIS SUR ENCOURS (révisés)

Pour les douze mois clos le 31 janvier 2023 :

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

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

POLITIQUE DE RÉMUNÉRATION (non révisée)

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

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

À la date de la clôture de l'exercice de la Société, le personnel identifié de la Société de Gestion qui a effectué des activités relatives à la Société était composé de 65 membres, y compris les Gestionnaires indépendants de la Société de Gestion et certains de leurs représentants. Le montant total de la rémunération payée par la Société de Gestion et ses représentants au personnel identifié relatif à la Société au cours de l'exercice de la Société s'élevait à 35 118 255 €, dont 1 982 560 € de rémunération fixe et 33 135 695 € de rémunération variable. Des informations sur la rémunération versée au cours de l'exercice au personnel identifié sont disponibles sur demande au siège social de la Société de Gestion sur présentation d'une raison valable d'obtention de telles informations.

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

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

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

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

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

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

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

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

Au 31 janvier 2023, les compartiments avaient engagé les montants suivants d'actifs dans chaque type d'OFT en pourcentage de l'actif net des compartiments :

Compartiment	**Valeur de marché des Accords de mise en pension**	**% de l'actif net**
Règlement/Compensation pour chaque type d'OFT :	**Bilatéral**	
Asia Ex-Japan Fund	24 000 $	0,05 %
Contrarian Value Fund	587 000 $	0,22 %
Diversified Income Fund	260 000 $	0,29 %
Emerging Markets Debt Fund	4 913 000 $	0,22 %
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	105 000 $	0,39 %
Emerging Markets Equity Fund	75 000 $	0,09 %
Emerging Markets Equity Research Fund	5 000 $	0,17 %
Global Concentrated Fund	335 000 $	0,05 %
Global Credit Fund	99 000 $	0,12 %
Global Equity Fund	778 000 $	0,02 %

Compartiment	Valeur de marché des Accords de mise en pension	% de l'actif net
Règlement/Compensation pour chaque type d'OFT :	**Bilatéral**	
Global Equity Income Fund	4 000 $	0,08 %
Global High Yield Fund	318 000 $	0,13 %
Global Intrinsic Value Fund	78 000 $	0,08 %
Global New Discovery Fund	7 000 $	0,12 %
Global Opportunistic Bond Fund	539 000 $	0,15 %
Global Research Focused Fund	30 000 $	0,02 %
Global Strategic Equity Fund	67 000 $	2,77 %
Global Total Return Fund	2 225 000 $	0,13 %
Inflation-Adjusted Bond Fund	18 000 $	0,01 %
Limited Maturity Fund	1 469 000 $	0,17 %
Managed Wealth Fund	201 000 $	1,04 %
Prudent Capital Fund	2 817 000 $	0,07 %
Prudent Wealth Fund	6 885 000 $	0,19 %
U.S. Concentrated Growth Fund	83 000 $	0,02 %
U.S. Corporate Bond Fund	827 000 $	0,21 %
U.S. Government Bond Fund	772 000 $	0,22 %
U.S. Total Return Bond Fund	100 000 $	0,02 %
U.S. Value Fund	728 000 $	0,03 %

Au 31 janvier 2023, les dix (nombre maximum) principaux émetteurs de garanties pour l'ensemble des OFT utilisés par les compartiments étaient les suivants :

	Garantie des titres prêtés			
Émetteur de la garantie :	**États-Unis**			
Compartiment	**Type**	**Devise**	**Note (Moody's)**	**Valeur**
Asia Ex-Japan Fund	Obligations	USD	Aaa	24 602 $
Contrarian Value Fund	Obligations	USD	Aaa	599 294 $
Diversified Income Fund	Obligations	USD	Aaa	265 697 $
Emerging Markets Debt Fund	Obligations	USD	Aaa	5 013 798 $
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Obligations	USD	Aaa	107 263 $
Emerging Markets Equity Fund	Obligations	USD	Aaa	76 757 $
Emerging Markets Equity Research Fund	Obligations	USD	Aaa	5 904 $
Global Concentrated Fund	Obligations	USD	Aaa	342 454 $
Global Credit Fund	Obligations	USD	Aaa	101 358 $
Global Equity Fund	Obligations	USD	Aaa	794 138 $
Global Equity Income Fund	Obligations	USD	Aaa	4 920 $
Global High Yield Fund	Obligations	USD	Aaa	324 741 $
Global Intrinsic Value Fund	Obligations	USD	Aaa	79 709 $
Global New Discovery Fund	Obligations	USD	Aaa	7 873 $
Global Opportunistic Bond Fund	Obligations	USD	Aaa	550 091 $
Global Research Focused Fund	Obligations	USD	Aaa	31 490 $
Global Strategic Equity Fund	Obligations	USD	Aaa	68 884 $
Global Total Return Fund	Obligations	USD	Aaa	2 270 232 $
Inflation-Adjusted Bond Fund	Obligations	USD	Aaa	18 697 $
Limited Maturity Fund	Obligations	USD	Aaa	1 499 711 $
Managed Wealth Fund	Obligations	USD	Aaa	205 669 $
Prudent Capital Fund	Obligations	USD	Aaa	2 874 447 $
Prudent Wealth Fund	Obligations	USD	Aaa	7 025 222 $

	Garantie des titres prêtés			
Émetteur de la garantie :	**États-Unis**			
Compartiment	**Type**	**Devise**	**Note (Moody's)**	**Valeur**
U.S. Concentrated Growth Fund	Obligations	USD	Aaa	85 613 $
U.S. Corporate Bond Fund	Obligations	USD	Aaa	844 326 $
U.S. Government Bond Fund	Obligations	USD	Aaa	788 234 $
U.S. Total Return Bond Fund	Obligations	USD	Aaa	102 343 $
U.S. Value Fund	Obligations	USD	Aaa	742 967 $

Au 31 janvier 2023, les dix (nombre maximum) principales contreparties de chaque type d'OFT étaient les suivantes :

OFT :	**Accords de mise en pension**
Contrepartie :	**BofA Securities, Inc.**
Pays d'établissement :	**États-Unis**
Compartiment	
Asia Ex-Japan Fund	24 000 $
Contrarian Value Fund	587 000 $
Diversified Income Fund	260 000 $
Emerging Markets Debt Fund	4 913 000 $
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	105 000 $
Emerging Markets Equity Fund	75 000 $
Emerging Markets Equity Research Fund	5 000 $
Global Concentrated Fund	335 000 $
Global Credit Fund	99 000 $
Global Equity Fund	778 000 $
Global Equity Income Fund	4 000 $
Global High Yield Fund	318 000 $
Global Intrinsic Value Fund	78 000 $
Global New Discovery Fund	7 000 $
Global Opportunistic Bond Fund	539 000 $
Global Research Focused Fund	30 000 $
Global Strategic Equity Fund	67 000 $
Global Total Return Fund	2 225 000 $
Inflation-Adjusted Bond Fund	18 000 $
Limited Maturity Fund	1 469 000 $
Managed Wealth Fund	201 000 $
Prudent Capital Fund	2 817 000 $
Prudent Wealth Fund	6 885 000 $
U.S. Concentrated Growth Fund	83 000 $
U.S. Corporate Bond Fund	827 000 $
U.S. Government Bond Fund	772 000 $
U.S. Total Return Bond Fund	100 000 $
U.S. Value Fund	728 000 $

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

OFT :	Accords de mise en pension					
Compartiment	1 jour à 1 semaine	1 semaine à 1 mois	1 à 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Échéance ouverte
Asia Ex-Japan Fund	— $	— $	— $	— $	24 602 $	— $
Contrarian Value Fund	— $	— $	— $	— $	599 294 $	— $
Diversified Income Fund	— $	— $	— $	— $	265 697 $	— $
Emerging Markets Debt Fund	— $	— $	— $	— $	5 013 798 $	— $
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	— $	— $	— $	— $	107 263 $	— $
Emerging Markets Equity Fund	— $	— $	— $	— $	76 757 $	— $
Emerging Markets Equity Research Fund	— $	— $	— $	— $	5 904 $	— $
Global Concentrated Fund	— $	— $	— $	— $	342 454 $	— $
Global Credit Fund	— $	— $	— $	— $	101 358 $	— $
Global Equity Fund	— $	— $	— $	— $	794 138 $	— $
Global Equity Income Fund	— $	— $	— $	— $	4 920 $	— $
Global High Yield Fund	— $	— $	— $	— $	324 741 $	— $
Global Intrinsic Value Fund	— $	— $	— $	— $	79 709 $	— $
Global New Discovery Fund	— $	— $	— $	— $	7 873 $	— $
Global Opportunistic Bond Fund	— $	— $	— $	— $	550 091 $	— $
Global Research Focused Fund	— $	— $	— $	— $	31 490 $	— $
Global Strategic Equity Fund	— $	— $	— $	— $	68 884 $	— $
Global Total Return Fund	— $	— $	— $	— $	2 270 232 $	— $
Inflation-Adjusted Bond Fund	— $	— $	— $	— $	18 697 $	— $
Limited Maturity Fund	— $	— $	— $	— $	1 499 711 $	— $
Managed Wealth Fund	— $	— $	— $	— $	205 669 $	— $
Prudent Capital Fund	— $	— $	— $	— $	2 874 447 $	— $
Prudent Wealth Fund	— $	— $	— $	— $	7 025 222 $	— $
U.S. Concentrated Growth Fund	— $	— $	— $	— $	85 613 $	— $
U.S. Corporate Bond Fund	— $	— $	— $	— $	844 326 $	— $
U.S. Government Bond Fund	— $	— $	— $	— $	788 234 $	— $
U.S. Total Return Bond Fund	— $	— $	— $	— $	102 343 $	— $
U.S. Value Fund	— $	— $	— $	— $	742 967 $	— $

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

OFT :	Accords de mise en pension						
Compartiment	Moins de 1 jour	1 jour à 1 semaine	1 semaine à 1 mois	1 à 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Échéance ouverte
Asia Ex-Japan Fund	— $	24 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Contrarian Value Fund	— $	587 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Diversified Income Fund	— $	260 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Emerging Markets Debt Fund	— $	4 913 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	— $	105 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Emerging Markets Equity Fund	— $	75 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Emerging Markets Equity Research Fund	— $	5 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Global Concentrated Fund	— $	335 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Global Credit Fund	— $	99 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Global Equity Fund	— $	778 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Global Equity Income Fund	— $	4 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Global High Yield Fund	— $	318 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Global Intrinsic Value Fund	— $	78 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Global New Discovery Fund	— $	7 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Global Opportunistic Bond Fund	— $	539 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Global Research Focused Fund	— $	30 000 $	— $	— $	— $	— $	— $

OFT :	Accords de mise en pension						
Compartiment	Moins de 1 jour	1 jour à 1 semaine	1 semaine à 1 mois	1 à 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Échéance ouverte
Global Strategic Equity Fund	— $	67 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Global Total Return Fund	— $	2 225 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Inflation-Adjusted Bond Fund	— $	18 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Limited Maturity Fund	— $	1 469 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Managed Wealth Fund	— $	201 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Prudent Capital Fund	— $	2 817 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
Prudent Wealth Fund	— $	6 885 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
U.S. Concentrated Growth Fund	— $	83 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
U.S. Corporate Bond Fund	— $	827 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
U.S. Government Bond Fund	— $	772 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
U.S. Total Return Bond Fund	— $	100 000 $	— $	— $	— $	— $	— $
U.S. Value Fund	— $	728 000 $	— $	— $	— $	— $	— $

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

Les compartiments ne sont pas autorisés à vendre, réinvestir ou donner en gage la garantie reçue sous la forme de titres. Dans la mesure où les compartiments reçoivent des liquidités en garantie, ladite garantie en liquidités ne serait placée en dépôt qu'auprès d'établissements de crédit autorisés en vertu du droit luxembourgeois, et, le cas échéant, ne peut être réinvestie que dans des obligations d'État de haute qualité, des opérations de vente-rachat (pourvu que les transactions soient soumises à une supervision prudentielle par des établissements de crédit et que le compartiment soit en mesure de rappeler à tout moment le montant intégral des liquidités comptabilisées) ou des fonds du marché monétaire à court terme autorisés en vertu du droit luxembourgeois afin d'atténuer le risque de pertes lié au réinvestissement. Les compartiments n'ont pas reçu de garantie en numéraire pour des OFT ou des swaps de rendement total au 31 janvier 2023.

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

		Dépositaire
		State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Compartiment	Nombre de Dépositaires	Valeur de la garantie des accords de mise en pension
Asia Ex-Japan Fund	1	24 602 $
Contrarian Value Fund	1	599 294 $
Diversified Income Fund	1	265 697 $
Emerging Markets Debt Fund	1	5 013 798 $
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	1	107 263 $
Emerging Markets Equity Fund	1	76 757 $
Emerging Markets Equity Research Fund	1	5 904 $
Global Concentrated Fund	1	342 454 $
Global Credit Fund	1	101 358 $
Global Equity Fund	1	794 138 $
Global Equity Income Fund	1	4 920 $
Global High Yield Fund	1	324 741 $
Global Intrinsic Value Fund	1	79 709 $
Global New Discovery Fund	1	7 873 $
Global Opportunistic Bond Fund	1	550 091 $
Global Research Focused Fund	1	31 490 $
Global Strategic Equity Fund	1	68 884 $
Global Total Return Fund	1	2 270 232 $
Inflation-Adjusted Bond Fund	1	18 697 $
Limited Maturity Fund	1	1 499 711 $
Managed Wealth Fund	1	205 669 $
Prudent Capital Fund	1	2 874 447 $
Prudent Wealth Fund	1	7 025 222 $

		Dépositaire
		State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Compartiment	Nombre de Dépositaires	Valeur de la garantie des accords de mise en pension
U.S. Concentrated Growth Fund	1	85 613 $
U.S. Corporate Bond Fund	1	844 326 $
U.S. Government Bond Fund	1	788 234 $
U.S. Total Return Bond Fund	1	102 343 $
U.S. Value Fund	1	742 967 $

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

Au 31 janvier 2023, les compartiments n'ont pas donné en gage de garanties en lien avec les OFT ou les swaps de rendement total.

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

Pour de plus amples informations concernant les revenus perçus et les frais encourus pour les accords de mise en pension, veuillez vous reporter à la Note 2. Pour les prêts de titres, veuillez vous reporter à la Note 4. Au 31 janvier 2023, les compartiments ne détenaient aucun swap de rendement total.

Règlement européen sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (« SFDR ») (non audité)

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

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

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

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

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

RAPPORT DU RÉVISEUR D'ENTREPRISES

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

B.P. 780
L-2017 Luxembourg

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

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

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

Opinion
Nous avons procédé au contrôle des états financiers de MFS Meridian Funds (le « Fonds ») et de chacun de ses compartiments, lesquels comprennent les Bilans et les Tableaux des investissements au 31 janvier 2023, les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net pour l'exercice clos à cette date, ainsi que les Notes aux états financiers, qui comprennent une synthèse des règles et méthodes comptables importantes.

À notre avis, les états financiers ci-joints donnent une image sincère et fidèle de la situation financière du Fonds et de chacun de ses compartiments au 31 janvier 2023, ainsi que de leur résultat d'exploitation et des variations de leur actif net au cours de l'exercice clos à cette date, conformément aux exigences légales et réglementaires luxembourgeoises relatives à l'établissement et à la présentation des états financiers.

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

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

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

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

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

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

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

RAPPORT DU RÉVISEUR D'ENTREPRISES

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

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

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

Ernst & Young
Société anonyme
Cabinet de révision agréé

Kerry Nichol
Luxembourg, 4 mai 2023

RAPPORT DU RÉVISEUR D'ENTREPRISES

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

B.P. 780
L-2017 Luxembourg

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

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

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

Opinion
Nous avons procédé au contrôle des états financiers de MFS Meridian Funds (le « Fonds »), lesquels comprennent les Bilans et les Tableaux des investissements au 31 janvier 2023, les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net pour l'exercice clos à cette date, ainsi que les Notes aux états financiers (collectivement, les « états financiers »).

À notre avis, les états financiers ci-joints renvoient une image fidèle, à tous égards importants, de la situation financière de MFS Meridian Funds au 31 janvier 2023, de son résultat d'exploitation et des variations de son actif net pour l'exercice clos à cette date, conformément aux exigences légales et réglementaires luxembourgeoises.

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

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

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

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

En procédant à un audit conformément aux GAAS, nous :

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

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

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

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

Luxembourg

4 mai 2023

ADMINISTRATEURS ET ADMINISTRATION

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

CONSEIL D'ADMINISTRATION
Lina M. Medeiros *(Présidence)*
Directrice de bureau
MFS Investment Management Company (Lux) S.à r.l.

Amrit Kanwal
Directeur financier
Massachusetts Financial Services Company

James R. Julian, Jr.
Directeur Général
University of Massachusetts Foundation
Administrateur indépendant

Malcolm W. MacNaught
Administrateur Délégué Senior
Massachusetts Financial Services Company

Thomas A. Bogart
Gestionnaire indépendant

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

GESTIONNAIRE FINANCIER
Massachusetts Financial Services Company
111 Huntington Avenue
Boston, Massachusetts, 02199-7618, États-Unis

DÉPOSITAIRE, ADMINISTRATION,
TENEUR DE REGISTRE ET AGENT DE TRANSFERT
State Street Bank International GmbH,
Luxembourg Branch
49, Avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

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

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

PRINCIPAUX AGENTS LOCAUX

Autriche . . . . . Raiffeisen Bank International AG, Am Stadtpark 9, A-1030 Vienne, Autriche.
Tél. : +43-1-71-707-1730

Belgique . . . . . CACEIS Belgium SA/NV, Avenue du Port/Havenlaan, 86C b 320, B-1000 Bruxelles.
Tél. : +32 2 209 2600

Danemark . . . . . Nordea Danmark, Filial af Nordea Bank Abp, Finland, Issuer Services, Securities Services,
Hermes Hus, Helgeshøj Allé 33, Hoje Taastrup, DK-2630 Taastrup, Danemark.
Tél. : +45-33-33-33-33

France . . . . . State Street Bank International GmbH, Paris Branch, Cœur Défense A, 100, Esplanade
du général de Gaulle, 92931 Paris la Défense Cedex, France.
Tél. : +33 1 44 45 44 16

Allemagne . . . . . Marcard Stein & Co., Ballindamm 36, 20095 Hambourg, Allemagne.
Tél. : +49-40-32-099-224

Hong Kong . . . . . State Street Trust (HK) Limited, 68th Floor, Two International Finance Centre,
8 Finance Street, Central, Hong Kong. Tél. : +852 2840 5388

Irlande . . . . . Bridge Consulting Limited, Ferry House, 48-53 Mount Street Lower, Dublin 2,
D02 PT98, Irlande.
Tél. : +353 (0)1-566-9800

Italie . . . . . AllFunds Bank S.A., via Bocchetto, 6 - 20123 Milan.
Tél. : +39 02 3211 7001
BNP Paribas Securities Services, Milan Branch, via Ansperto no. 5, 20123 Milan, Italie
CACEIS Bank, succursale italienne, siège social : 89-91 rue Gabriel Peri - 92120
Montrouge, France Tél. : +39 02 721 74 411 et siège opérationnel : Piazza Cavour 2,
20121, Milan, Italie. Tél. : +39 02 721 74 423
Société Générale Securities Services, S.p.A., via Benigno Crespi, 19/A-MAC 2, 20159,
Milan, Italie. Tél. : Tél. : +39-02-9178-4588
State Street Bank International GmbH - Succursale Italia, Via Ferrante Aporti, 10, 20125
Milan, Italie. Tél. : +39-02-3211-7001/7002, Fax : +39 02 3211 7935

Luxembourg . . . . . State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch, 49, avenue J.F. Kennedy, L-1855
Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg. Tél. : +352-46-40-10-600

Pays-Bas . . . . . CACEIS Bank, Netherlands Branch, Gustav Mahlerlaan 310-B, 1082 ME Amsterdam,
Pays-Bas. Tél. : +31-20-530-8300

Suède . . . . . Securities Services, Skandinaviska Enskilda Banken AB, Global Funds, RA 6, Rissneleden 110,
SE-106 40 Stockholm, Suède. Tél. : +46-8763-6906/5960

Suisse . . . . . Représentant : Carnegie Fund Services S.A., 11, rue du Général-Dufour, 1204 Genève,
Suisse. Tél. : +41-22-705-1178
Service de paiement : Banque Cantonale de Genève, 17, quai de l'Ile, 1204 Genève,
Tél. : +41-22-317-2727

Royaume-Uni . . . . . Correspondant centralisateur : MFS International (U.K.) Ltd., One Carter Lane, Londres EC4V 5ER,
Royaume-Uni. Tél. : +44 (0) 20 7429 7200

Taïwan . . . . . Agent Principal : PineBridge Investments Management Taiwan Limited, 10th Floor,
144 Min Chuan East Road. Section 2 Taipei, Taïwan 10436. Tél : +886-2-2516-7883

Le prospectus et les feuilles d'information de base pour la Suisse, les statuts, les rapports annuel et semestriel de MFS Meridian Funds, en français, ainsi que la liste des achats et des ventes effectués par le fonds durant l'exercice comptable, peuvent être obtenus, sur simple demande et gratuitement, au siège du représentant en Suisse : Carnegie Fund Services S.A., 11, rue du Général Dufour, 1204 Genève, Suisse.

©2023 MFS Investment Management

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce Règlement ne comprend pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Blended Research European Equity Fund **(« MFS Blended Research European Equity Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : 54930067ZHQOV0SGFJ15

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

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

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

Au 31 janvier 2023, 87,33 % des titres de participation du portefeuille du MFS Blended Research European Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 87,01 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,63 % de l'actif du MFS Blended Research European Equity Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 22 novembre 2022 au 31 janvier 2023.

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

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

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

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

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

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

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

Critère climatique	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	87,33	87,01
31 octobre 2022	87,33	86,71

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

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

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS savent faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à différentes étapes du processus d'investissement et des activités d'engagement.

De plus, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 30 novembre 2022 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Nestle SA	Biens de consommation courante	4,81	Suisse
Roche Holding AG	Soins de santé	4,03	Suisse
Novo Nordisk AS	Soins de santé	3,08	Danemark
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	3,04	France
ASML Holding NV	Technologies de l'information	2,91	Pays-Bas
British American Tobacco PLC	Biens de consommation courante	2,24	Royaume-Uni
UBS Group AG	Finance	2,08	Suisse
Schneider Electric SE	Industrie	2,03	France
Rio Tinto PLC	Matériaux	2,03	Royaume-Uni
Zurich Insurance Group AG	Finance	2,01	Suisse
Iberdrola SA	Services publics	1,86	Espagne
BNP Paribas SA	Finance	1,85	France
Cie Financière Richemont SA	Biens de consommation discrétionnaire	1,83	Suisse
Eni SpA	Énergie	1,66	Italie
Bayer AG	Soins de santé	1,64	Allemagne

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

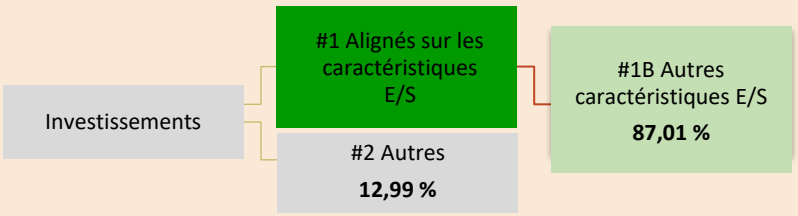
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

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

Le MFS Blended Research European Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs répondant à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition, et qui seront donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Blended Research European Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 99,63 % de l'actif total du portefeuille du MFS Blended Research European Equity Fund ; les investissements restants (0,37 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 87,33 % des titres de participation du portefeuille du MFS Blended Research European Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 87,01 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 12,99 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Finance	15,38
Soins de santé	15,21
Biens de consommation courante	13,52
Industrie	13,23
Biens de consommation discrétionnaire	10,78
Technologies de l'information	7,88
Matériaux	6,46
Énergie	5,59
Services publics	4,63
Services de communication	4,45
Immobilier	1,75
Liquidités et instruments assimilés	1,12

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

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

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

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

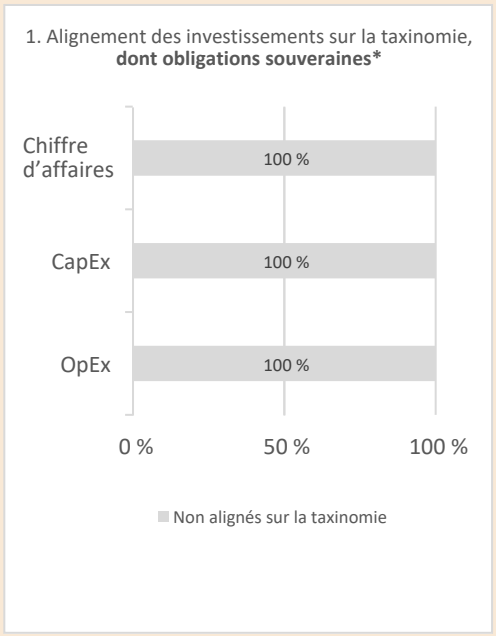
☐ Oui :

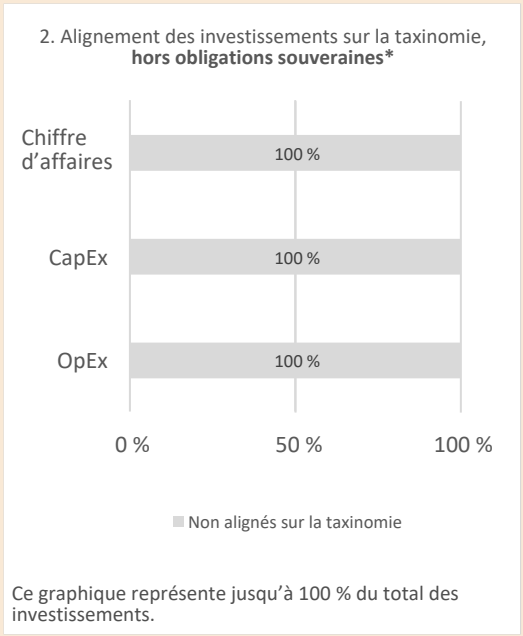
☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

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

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

**** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.***

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif

auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Blended Research European Equity Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Continental European Equity Fund
(« MFS Continental European Equity Fund »)
Identifiant d'entité juridique : GY33BV78RICKYR2RFZ08

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

À compter du 31 décembre 2021, le MFS Continental European Equity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Continental European Equity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs de titres de participation qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 92,67 % des titres de participation du portefeuille du MFS Continental European Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 90,17 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 97,29 % de l'actif du MFS Continental European Equity Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	80,26	78,10
30 novembre 2021	75,14	73,56

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	77,42	75,33
30 novembre 2021	72,70	71,19

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

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	92,67	90,17
30 novembre 2021	90,79	88,88

- ***… et par rapport aux périodes précédentes ?***

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS savent faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à différentes étapes du processus d'investissement et des activités d'engagement. De plus, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier.

Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Nestle SA	Biens de consommation courante	7,47	Suisse
Roche Holding AG	Soins de santé	6,52	Suisse
Novartis AG	Soins de santé	5,54	Suisse
Schneider Electric SE	Industrie	5,02	France
SAP SE	Technologies de l'information	4,94	Allemagne
Linde PLC	Matériaux	4,70	États-Unis
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	4,42	France
Capgemini SE	Technologies de l'information	4,36	France
Essilor Luxottica SA	Soins de santé	3,40	France
Pernod Ricard SA	Biens de consommation courante	3,26	France
Bayer AG	Soins de santé	2,93	Allemagne
Swedish Match AB	Biens de consommation courante	2,67	Suède
UBS Group AG	Finance	2,54	Suisse
QIAGEN NV	Soins de santé	2,36	Allemagne
Deutsche Boerse AG	Finance	2,17	Allemagne

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des périodes s'achevant les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

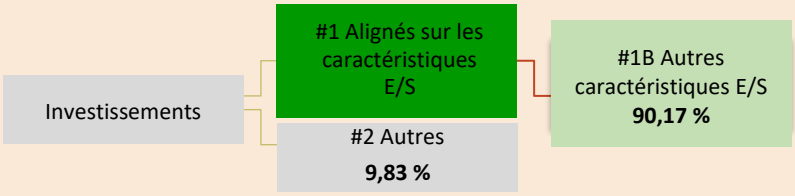
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Continental European Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs répondant à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition, et qui seront donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Continental European Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 97,29 % de l'actif total du portefeuille du MFS Continental European Equity Fund ; les investissements restants (2,71 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 92,67 % des titres de participation du portefeuille du MFS Continental European Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 90,17 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 9,83 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Soins de santé	19,43
Biens de consommation courante	17,03
Technologies de l'information	13,69
Industrie	12,76
Finance	11,40
Biens de consommation discrétionnaire	11,06
Matériaux	7,52
Liquidités et instruments assimilés	2,59
Énergie	1,97
Services de communication	1,92
Services publics	0,62

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

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

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

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

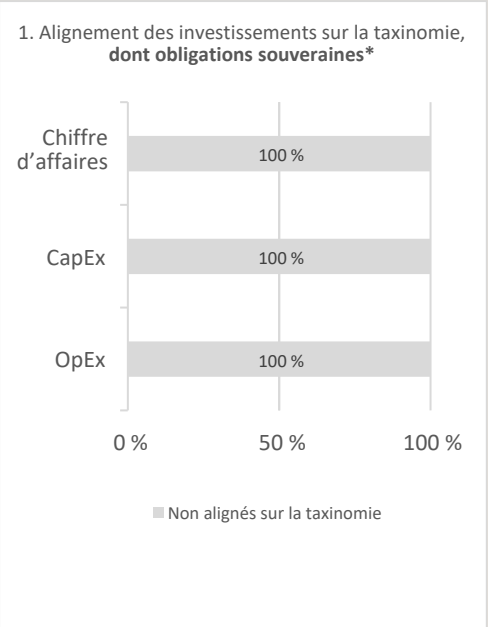
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

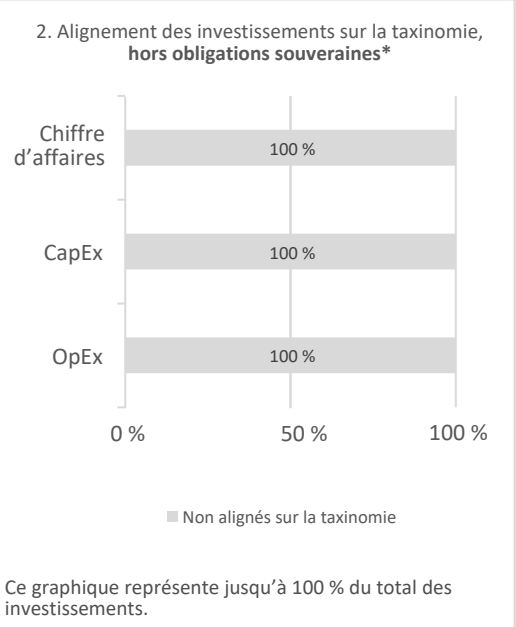
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

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

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

**** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.***

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Continental European Equity Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Continental European Equity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 6 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Danone SA, Flutter Entertainment PLC et Prysmian SpA. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque climatique, le risque physique, le risque de transition, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : UBS Group AG.

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.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/co ntent/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Contrarian Value Fund **(« MFS Contrarian Value Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : 549300MK0DQR28Y1H769

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Contrarian Value Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Contrarian Value Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 94,01 % des titres de participation du portefeuille du MFS Contrarian Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 88,70 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 94,36 % de l'actif du MFS Contrarian Value Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	60,45	57,04
30 novembre 2021	63,88	60,44

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	72,79	68,68
30 novembre 2021	56,70	53,62

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

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	94,01	88,70
30 novembre 2021	81,29	76,91

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

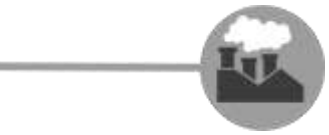
Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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



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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS savent faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à différentes étapes du processus d'investissement et des activités d'engagement. De plus, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences

négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Next PLC	Biens de consommation discrétionnaire	4,61	Royaume-Uni
Trelleborg AB	Industrie	3,86	Suède
Danone SA	Biens de consommation courante	3,81	France
Airbus SE	Industrie	3,69	France
Weir Group PLC	Industrie	3,47	Royaume-Uni
Autoliv Inc	Biens de consommation discrétionnaire	3,35	États-Unis
CSX Corp	Industrie	3,32	États-Unis
Sage Group PLC/The	Technologies de l'information	3,31	Royaume-Uni
CRH PLC	Matériaux	3,06	Irlande
ArcelorMittal	Matériaux	2,99	France
BAE Systems PLC	Industrie	2,90	Royaume-Uni
Booking Holdings Inc	Biens de consommation discrétionnaire	2,85	États-Unis
Ryanair Holdings PLC ADR	Industrie	2,75	Irlande
Bank of Ireland Group PLC	Finance	2,65	Irlande
Electronic Arts Inc	Services de communication	2,59	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

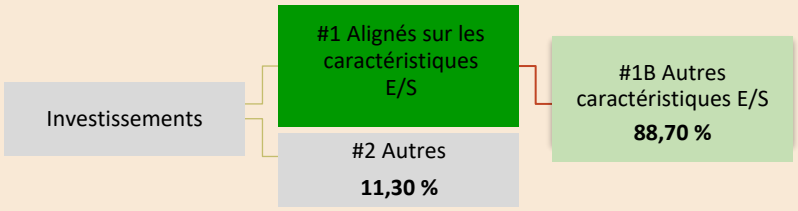
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

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

Le MFS Contrarian Value Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Contrarian Value Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 94,36 % de l'actif total du portefeuille du MFS Contrarian Value Fund ; les investissements restants (5,64 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 94,01 % des titres de participation du portefeuille du MFS Contrarian Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 88,70 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 11,30 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Industrie	26,86
Finance	19,00
Biens de consommation discrétionnaire	13,62
Matériaux	8,40
Technologies de l'information	6,37
Services de communication	6,84
Liquidités et instruments assimilés	5,96
Biens de consommation courante	4,87
Services publics	3,32
Soins de santé	1,86
Énergie	1,52
Immobilier	1,38

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

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

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

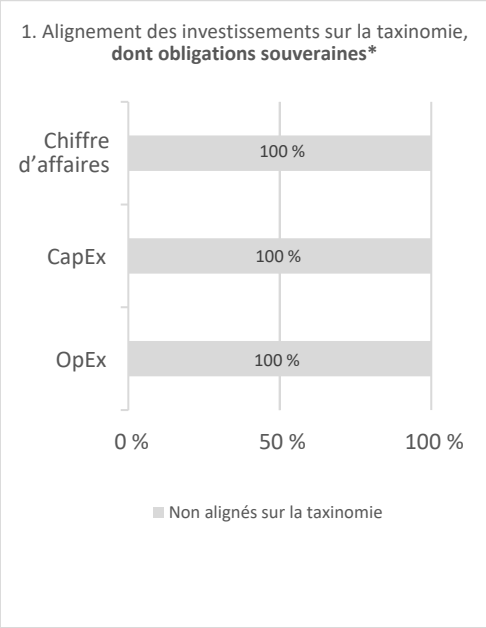
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

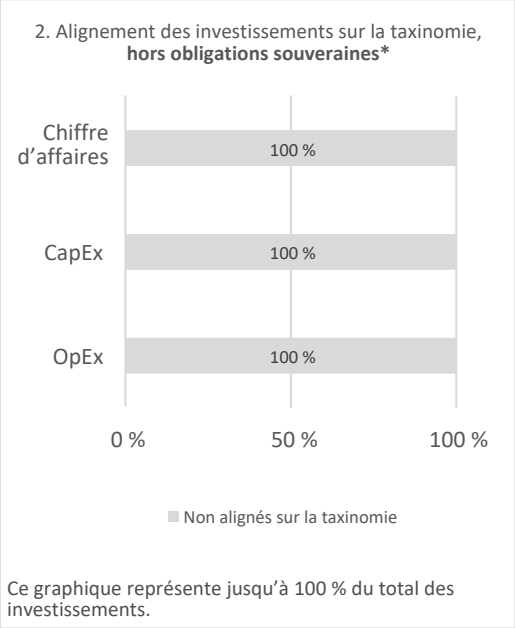
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

✖ Non. Le MFS Contrarian Value Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Contrarian Value Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Contrarian Value Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins dix initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Anglo American Plc, ArcelorMittal, Citigroup, Danone SA, Ryanair Holdings PLC et Weir Group Plc. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque climatique, le risque de transition, le risque physique, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : UBS Group AG, London Stock Exchange Group plc, NatWest Group plc et National Grid plc ; les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et ont voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Booking Holdings Inc.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Diversified Income Fund **(« MFS Diversified Income Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : 549300Y5OY3WDN3PCL65

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Depuis le 30 novembre 2022, le MFS Diversified Income Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Diversified Income Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation et au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille (selon le cas) dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des quatre critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023 : 66,56 % des titres de participation du portefeuille du MFS Diversified Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 20,57 % de l'actif total ; 61,13 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Diversified Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 24,25 % de l'actif total. Les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 30,91 % et 39,67 % de l'actif du MFS Diversified Income Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 30 novembre 2022 au 31 janvier 2023.

Critère climatique 1 – mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation et de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de participation et de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	**% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	49,86	15,41
31 octobre 2022	60,65	18,71

Critère climatique 1	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	54,02	21,43
31 octobre 2022	54,28	22,30

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

Critère climatique 2	**% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	55,09	17,03
31 octobre 2022	54,57	16,83

Critère climatique 2	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	16,31	6,47
30 novembre 2022	17,19	7,19

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

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

Critère climatique 3	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2022	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	2,14	0,85
30 novembre 2022	2,33	0,96

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	66,56	20,57
30 novembre 2022	71,60	22,08

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

Critères climatiques	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	61,13	24,25
30 novembre 2022	62,39	25,63

- ***… et par rapport aux périodes précédentes ?***

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

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

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
ProLogis, REIT	Immobilier	1,53	États-Unis
Equinix Inc, REIT	Immobilier	1,17	États-Unis
Merck & Co Inc	Soins de santé	1,00	États-Unis
Extra Space Storage Inc, REIT	Immobilier	0,97	États-Unis
Simon Property Group Inc, REIT	Immobilier	0,87	États-Unis
Roche Holding AG	Soins de santé	0,81	Suisse
Johnson & Johnson	Soins de santé	0,75	États-Unis
AvalonBay Communities Inc, REIT	Immobilier	0,73	États-Unis

Equity LifeStyle Properties Inc, REIT	Immobilier	0,70	États-Unis
Texas Instruments Inc	Technologies de l'information	0,69	États-Unis
Sun Communities Inc, REIT	Immobilier	0,68	États-Unis
General Mills Inc	Biens de consommation courante	0,68	États-Unis
Rio Tinto PLC	Matériaux	0,65	Royaume-Uni
National Retail Properties Inc, REIT	Immobilier	0,63	États-Unis
Brixmor Property Group Inc, REIT	Immobilier	0,62	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 30 novembre 2022 au 31 janvier 2023.

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

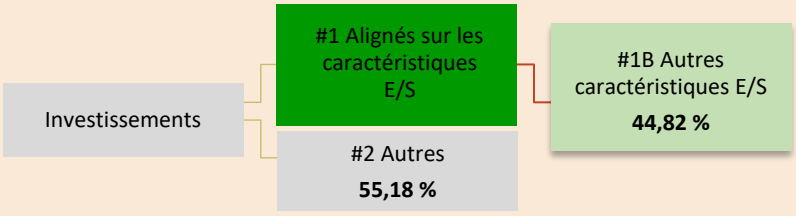
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Diversified Income Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation et 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Diversified Income Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 30,91 % et 39,67 % de l'actif total du portefeuille du MFS Diversified Income Fund ; les investissements restants (29,42 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 66,56 % des titres de participation du portefeuille du MFS Diversified Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 20,57 % de l'actif total du portefeuille ; 61,13 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Diversified Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 24,25 % de l'actif total du portefeuille ; 44,82 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 55,18 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Créances d'entreprises	33,21
Dette des marchés émergents	15,69
Immobilier	14,41
Emprunts d'État américains	6,72
Titres adossés à des créances hypothécaires	6,10
Soins de santé	4,61
Liquidités et instruments assimilés	4,08
Biens de consommation courante	3,83
Finance	3,39
Technologies de l'information	2,17
Industrie	1,43
Matériaux	1,39
Services de communication	1,19
Services publics	0,94
Biens de consommation discrétionnaire	0,77
Énergie	0,73
Obligations titrisées (CDO)	0,51
Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales	0,38
Obligations municipales	0,27
Obligations convertibles	0,14
Hors marché américain	0,08
Titres adossés à des actifs	0,02
Autre	-1,62
Options sur indices	-0,46

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

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

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

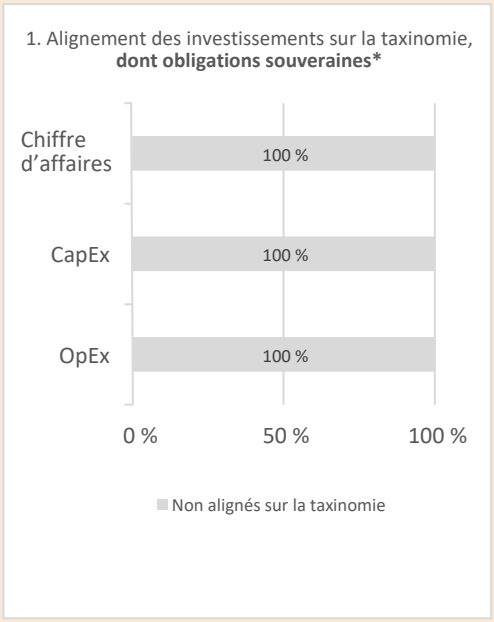
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

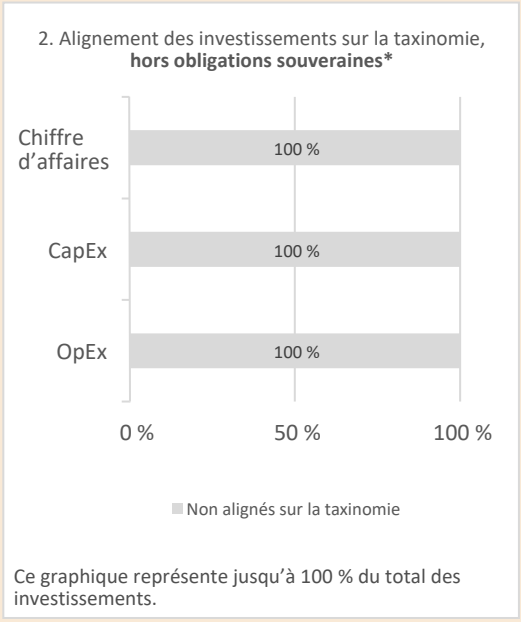
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS Diversified Income Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de liquidités et d'instruments assimilés.

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du MFS Diversified Income Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Diversified Income Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 5 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Cable One Inc, Cimpress, Danaher Corp, Duke Energy et Xcel energy. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque climatique, l'analyse de scénarios climatiques, le risque de transition climatique, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Microsoft Inc. et National Australia Bank Limited.

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.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Euro Credit Fund **(« MFS Euro Credit Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : 549300DZGNNNNMSY602

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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 d'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** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Euro Credit Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Euro Credit Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 79,06 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Euro Credit Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 57,34 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 72,53 % de l'actif du MFS Euro Credit Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	57,53	41,73
30 novembre 2021	56,13	48,72

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

Critère climatique 2	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	49,91	36,20
30 novembre 2021	44,04	38,23

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

Critère climatique 3	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	8,18	5,93
30 novembre 2021	6,92	6,0

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

Critères climatiques	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	79,06	57,34
30 novembre 2022	76,48	66,39

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

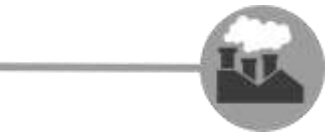
Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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



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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

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

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Itraxx Eur Ser, option de vente, 15 février 22	Produit dérivé	2,32 %	Allemagne
Galp Energia SGPS SA, 2 % 15 janvier 26	Entreprise	1,63 %	Portugal
Islandsbanki HF, 25 mars 25	Entreprise	1,58 %	Islande
Royal Bank of Canada, 10 septembre 25	Entreprise	1,57 %	Canada
Euronet Worldwide Inc, 22 mai 26	Entreprise	1,35 %	États-Unis
Wabtec Transportation BV, 3 décembre 27	Entreprise	1,25 %	États-Unis
Euro Schatz, contrat à terme standardisé à 2 ans, 8 juin 22	Entreprise	1,16 %	Allemagne
Euro Bund, contrat à terme standardisé à 10 ans, 8 juin 22	Entreprise	1,09 %	Allemagne
Province de l'Alberta, Canada, 18 avril 25	Gouvernement	1,07 %	Canada
Euroclear Bank SA, REGS, 0,125 %, 7 juillet 25	Entreprise	1,06 %	Belgique
Aviva PLC, FRB, 3 juillet 44	Entreprise	1,05 %	Royaume-Uni
Prosus NV, 3 août 08	Entreprise	1,02 %	Chine
Belfius Bank SA, 2 septembre 25	Entreprise	0,91 %	Belgique
Province de l'Ontario, Canada, 17 avril 25	Gouvernement	0,88 %	Canada
Crédit Agricole SA, 20 avril 28	Entreprise	0,79 %	France

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

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

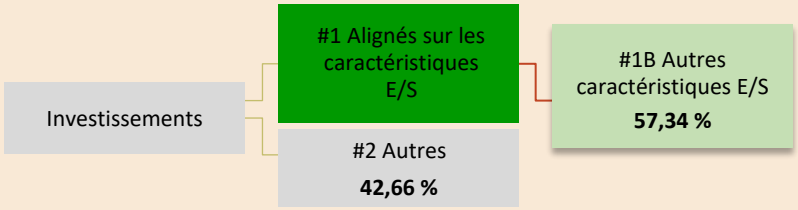
L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Le MFS Euro Credit Fund vise à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Euro Credit Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 72,53 % de l'actif total du portefeuille du MFS Euro Credit Fund ; les investissements restants (28,47 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés. Au 31 janvier 2023, 79,06 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille MFS Euro Credit Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 57,34 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ;

42,66 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Sociétés privées – établissements financiers	38,98
Sociétés privées – industrie	37,45
Gouvernement – agences gouvernementales	8,00
Sociétés privées – services publics	4,79
Liquidités	4,16
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	2,30
Gouvernement – organismes supranationaux liés à un gouvernement	2,24
Titrisation – titres couverts	1,57
Trésor – bons du Trésor	1,55
Titrisation – titres adossés à des actifs	0,80
Gouvernement – titres souverains liés à un État	0,55
Produits dérivés de gré à gré	0,13
Produits dérivés - négociés en bourse	-1,45

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

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

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

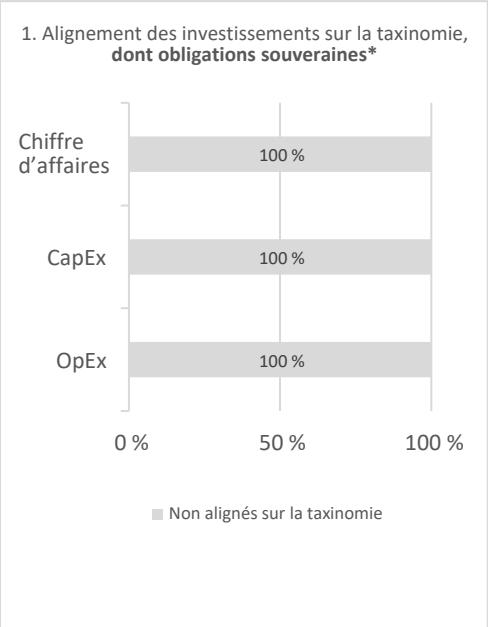
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

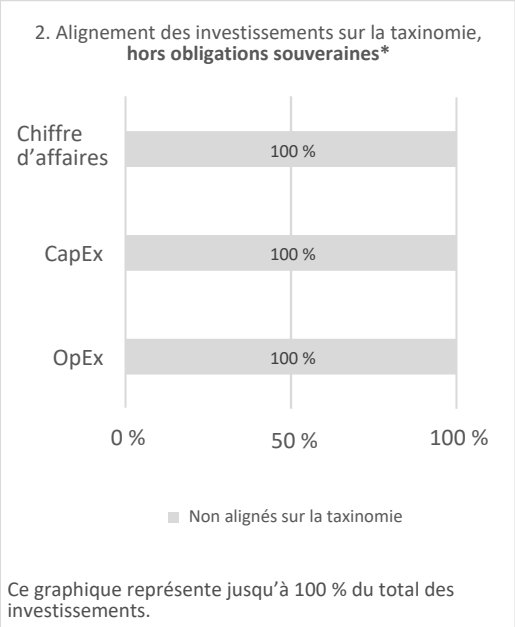
☐ Oui :

☐ Dans les ☐ Dans l'énergie

☒ Non. Le MFS Euro Credit Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la

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.*





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Euro Credit Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements - MFS Euro Credit Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 17 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Anglo American PLC, Boston Scientific Corp, CEZ AS, Danaher Corp, Duke Energy

Corp, Enel SpA, Engie SA, Glencore PLC, Macquarie Group PLC, Toronto Dominion Bank et Xcel Energy. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque climatique, le risque de transition climatique, le risque physique lié au changement climatique, l'analyse de scénarios climatiques, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi).

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – European Core Equity Fund (**« MFS European Core Equity Fund »**)
Identifiant d'entité juridique : 6Y75067IIDSWFOENA317

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

À compter du 31 décembre 2021, le MFS European Core Equity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS European Core Equity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 85,52 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Core Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 84,52 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,82 % de l'actif du MFS European Core Equity Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	65,35	64,58
30 novembre 2021	66,92	66,17

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	71,72	70,88
30 novembre 2021	68,0	67,26

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

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	85,52	84,52
30 novembre 2021	87,20	86,22

et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS savent faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à différentes étapes du processus d'investissement et des activités d'engagement. De plus, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences

négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Roche Holding AG	Soins de santé	4,20	Suisse
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	3,61	France
Linde PLC	Matériaux	3,60	États-Unis
Schneider Electric SE	Industrie	3,25	France
Merck KGaA	Soins de santé	3,24	Allemagne
Pernod Ricard SA	Biens de consommation courante	3,16	France
Diageo PLC	Biens de consommation courante	3,09	Royaume-Uni
Nestle SA	Biens de consommation courante	2,89	Suisse
Heineken Holding NV	Biens de consommation courante	2,39	Pays-Bas
Bayer AG	Soins de santé	2,11	Allemagne
Cie Financière Richemont SA	Biens de consommation discrétionnaire	2,04	Suisse
Danone SA	Biens de consommation courante	2,02	France
Vonovia SE	Immobilier	2,01	Allemagne
Reckitt Benckiser Group PLC	Biens de consommation courante	2,01	Royaume-Uni
Novo Nordisk AS	Soins de santé	1,94	Danemark

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

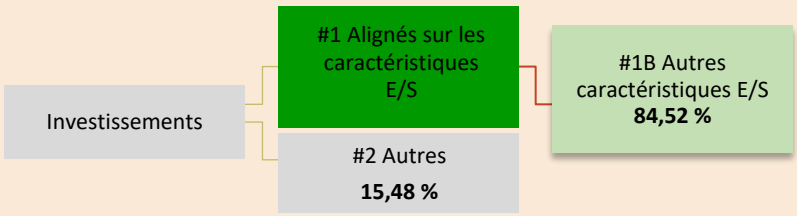
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS European Core Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs répondant à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition, et qui seront donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS European Core Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 98,82 % de l'actif total du portefeuille du MFS European Core Equity Fund ; les investissements restants du portefeuille comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 85,52 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Core Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 84,52 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 15,48 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Biens de consommation courante	18,71
Industrie	16,03
Biens de consommation discrétionnaire	15,51
Finance	14,34
Soins de santé	14,31
Matériaux	10,34
Immobilier	4,03
Services de communication	3,72
Technologies de l'information	2,40
Liquidités et instruments assimilés	0,60
Warrants sur actions	0,05
Autre	-0,03

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

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

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

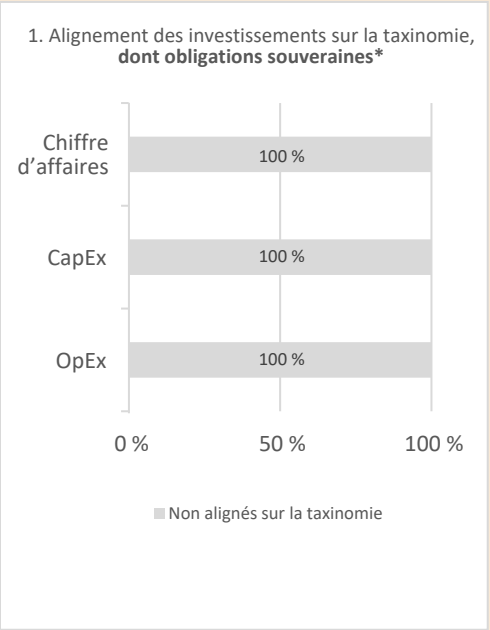
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

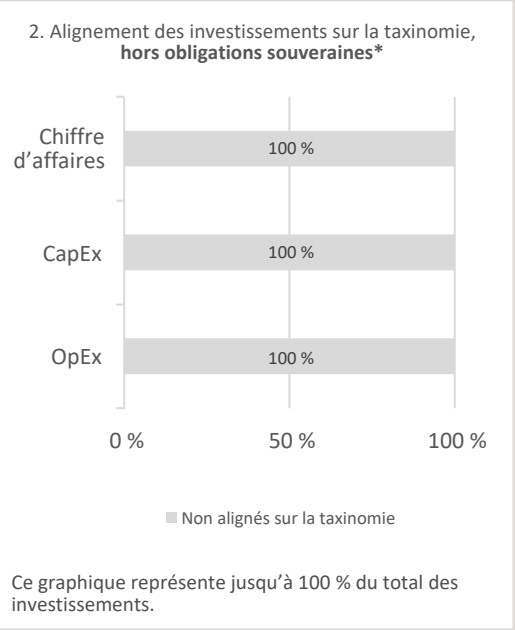
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

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

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

**** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.***

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS European Core Equity Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS European Core Equity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 11 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Check Point Software Technologies Ltd, Danone SA, Flutter Entertainment PLC, LEG Immobilien SE, Rolls-Royce Holdings PLC, Ryanair Holdings PLC ADR et Whitbread PLC. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque climatique, le risque de transition climatique, le risque physique lié au changement climatique, l'analyse de scénarios climatiques, ainsi que les initiatives « zéro émission

nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Aena SME SA, UBS Group AG et London Stock Exchange Group Plc.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – European Research Fund (« **MFS European Research Fund** »)
Identifiant d'entité juridique : S9K235E4P9KO3JXU6G54

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ Oui	☒ No
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS European Research Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS European Research Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 87,20 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Research Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 85,84 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,43 % de l'actif du MFS European Research Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	65,87	64,84
30 novembre 2021	60,91	60,43

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	66,02	64,98
30 novembre 2021	68,20	67,71

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

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	87,20	85,84
30 novembre 2021	86,71	86,03

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

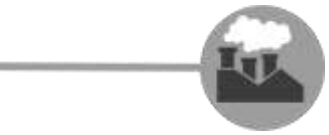
Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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



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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS savent faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à différentes étapes du processus d'investissement et des activités d'engagement. De plus, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences

négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Nestle SA	Biens de consommation courante	5,03	Suisse
Roche Holding AG	Soins de santé	3,81	Suisse
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	3,63	France
Linde PLC	Matériaux	2,80	États-Unis
British American Tobacco PLC	Biens de consommation courante	2,66	Royaume-Uni
Schneider Electric SE	Industrie	2,64	France
Diageo PLC	Biens de consommation courante	2,61	Royaume-Uni
ASML Holding NV	Technologies de l'information	2,60	Pays-Bas
Wolters Kluwer NV	Industrie	2,05	Pays-Bas
Iberdrola SA	Services publics	1,97	Espagne
BNP Paribas SA	Finance	1,95	France
Cellnex Telecom SA	Services de communication	1,85	Espagne
London Stock Exchange Group PLC	Finance	1,78	Royaume-Uni
Euronext NV	Finance	1,68	France
UBS Group AG	Finance	1,65	Suisse

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

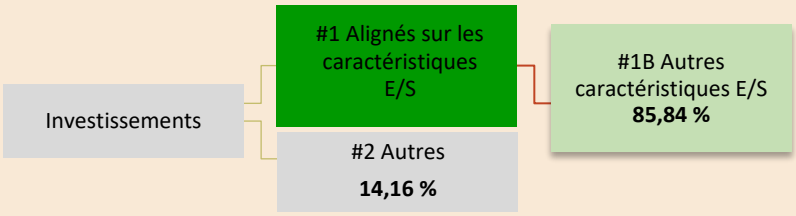
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS European Research Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS European Research Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 98,43 % de l'actif total du portefeuille du MFS European Research Fund ; les investissements restants (1,57 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 87,20 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Research Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 85,84 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 14,16 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Finance	18,29
Biens de consommation courante	14,05
Biens de consommation discrétionnaire	12,21
Industrie	12,20
Soins de santé	11,55
Matériaux	7,74
Énergie	5,97
Technologies de l'information	5,29
Services publics	5,12
Services de communication	4,93
Liquidités et instruments assimilés	1,50
Immobilier	1,14
Warrants sur actions	0,05
Autre	-0,04

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

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

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

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

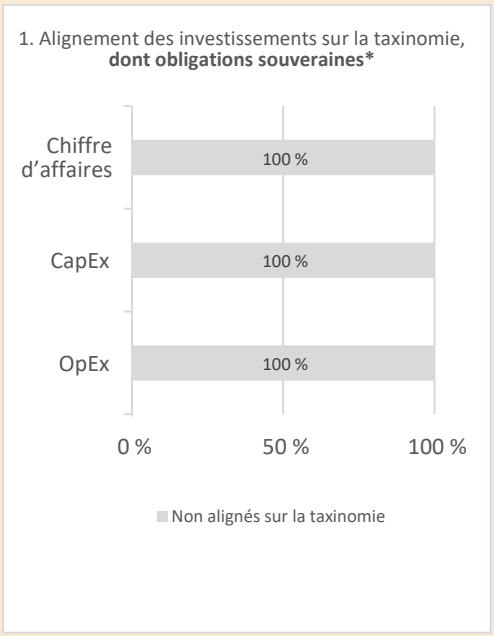
Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

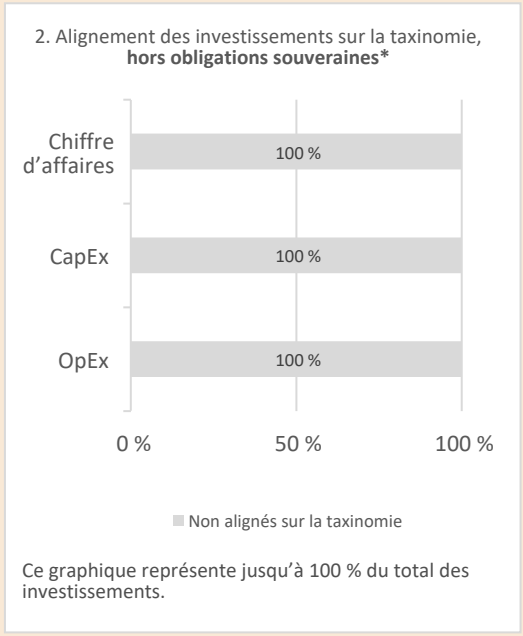
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

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

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS European Research Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS European Research Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 19 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Danone SA, Eni SpA, Flutter Entertainment PLC, Glencore PLC, Iberdola SA, Rolls-Royce Holdings PLC, Ryanair Holdings PLC ADR, Tesco PLC, Weir Group PLC et Whitbread PLC. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque climatique, le risque de transition climatique, le risque physique lié au changement climatique, l'analyse de scénarios climatiques, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : UBS Group AG, London Stock Exchange Group Plc, Glencore plc, NatWest Group plc et National Grid plc.

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.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – European Smaller Companies Fund **(« MFS European Smaller Companies Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : V0CTT9HXYER2M74L6515

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

À compter du 31 décembre 2021, le MFS European Smaller Companies Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS European Smaller Companies Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 75,56 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Smaller Companies Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 69,91 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 92,52 % de l'actif du MFS European Smaller Companies Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	49,08	45,41
30 novembre 2021	52,85	50,03

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	57,31	53,03
30 novembre 2021	46,70	44,20

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

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	75,56	69,91
30 novembre 2021	69,43	65,72

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS savent faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à différentes étapes du processus d'investissement et des activités d'engagement. De plus, la mesure dans

laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Symrise AG	Matériaux	3,79	Allemagne
Cranswick PLC	Biens de consommation courante	3,76	Royaume-Uni
Croda International PLC	Matériaux	2,62	Royaume-Uni
Breedon Group PLC	Matériaux	2,57	Royaume-Uni
Forterra PLC	Matériaux	2,53	Royaume-Uni
Gerresheimer AG	Soins de santé	2,31	Allemagne
Cembre SpA	Industrie	2,14	Italie
LEG Immobilien SE	Immobilier	1,95	Allemagne
Galp Energia SGPS SA	Énergie	1,93	Portugal
Essentra PLC	Matériaux	1,84	Royaume-Uni
Mayr Melnhof Karton AG	Matériaux	1,82	Autriche
GEA Group AG	Industrie	1,77	Allemagne
Cellnex Telecom SA	Services de communication	1,75	Espagne
Italgas SpA	Services publics	1,75	Italie
Vetropack Holding AG	Matériaux	1,70	Suisse

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

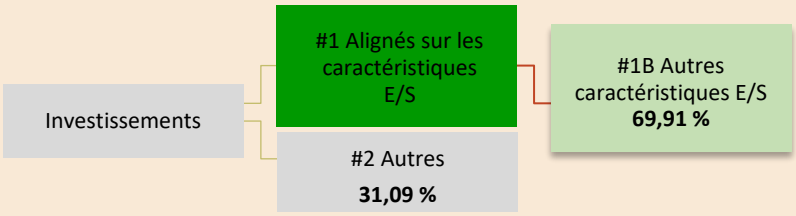
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS European Smaller Companies Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs répondant à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition, et qui seront donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS European Smaller Companies Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 92,52 % de l'actif total du portefeuille du MFS European Smaller Companies Fund ; les investissements restants (7,48 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 75,56 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Smaller Companies Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 69,91 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 31,09 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Matériaux	22,52
Industrie	20,38
Biens de consommation courante	13,13
Biens de consommation discrétionnaire	8,51
Soins de santé	8,47
Services de communication	7,27
Immobilier	4,77
Technologies de l'information	4,37
Finance	3,62
Liquidités et instruments assimilés	3,28
Énergie	1,93
Services publics	1,75

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

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

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

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

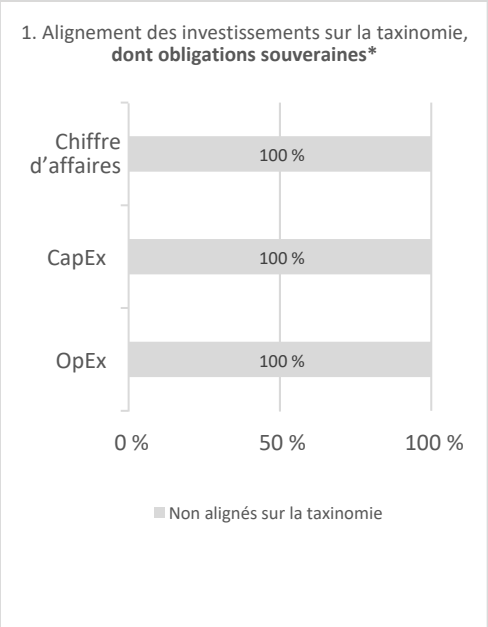
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

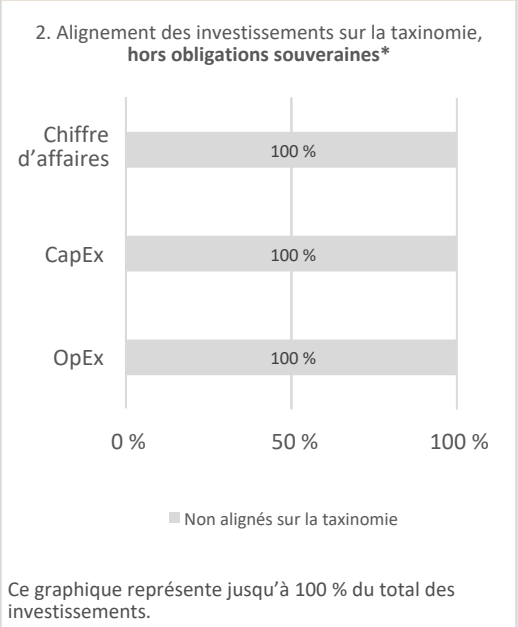
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS European Smaller Companies Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS European Smaller Companies Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS European Smaller Companies Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 4 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Flutter Entertainment PLC, Forterra PLC, Greggs PLC et LEG Immobillien SE. Parmi les sujets abordés, citons le risque lié au changement climatique et les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi).

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – European Value Fund **(« MFS European Value Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : FOW0N0ZBCI2YVLH77334

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS European Value Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS European Value Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 93,32 % des titres de participation du portefeuille MFS European Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 90,62 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 97,11 % de l'actif du MFS European Value Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	66,20	64,28
30 novembre 2021	67,00	66,07

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	81,02	78,68
30 novembre 2021	72,60	71,63

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

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
1 janvier 2023	93,32	90,62
30 novembre 2021	87,30	86,09

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS savent faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à différentes étapes du processus d'investissement et des activités d'engagement. De plus, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences

négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 30 novembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Nestle SA	Biens de consommation courante	5,19	Suisse
Iberdrola SA	Services publics	3,27	Espagne
Roche Holding AG	Soins de santé	3,10	Suisse
Schneider Electric SE	Industrie	3,01	France
Diageo PLC	Biens de consommation courante	2,75	Royaume-Uni
Amadeus IT Group SA	Technologies de l'information	2,64	Espagne
Zurich Insurance Group AG	Finance	2,52	Suisse
Legrand SA	Industrie	2,41	France
Symrise AG	Matériaux	2,33	Allemagne
Pernod Ricard SA	Biens de consommation courante	2,28	France
Cie Financière Richemont SA	Biens de consommation discrétionnaire	2,15	Suisse
Deutsche Boerse AG	Finance	2,09	Allemagne
Safran SA	Industrie	2,08	France
UBS Group AG	Finance	1,95	Suisse
Flutter Entertainment PLC	Biens de consommation discrétionnaire	1,91	Irlande

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

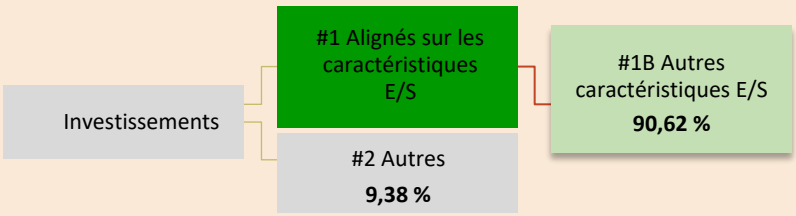
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS European Value Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS European Value Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 97,11 % de l'actif total du portefeuille du MFS European Value Fund ; les investissements restants (2,89 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 93,32 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 90,62 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 9,38 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Industrie	20,26
Biens de consommation courante	17,82
Finance	16,33
Biens de consommation discrétionnaire	9,46
Technologies de l'information	9,30
Soins de santé	8,67
Matériaux	6,45
Services publics	4,85
Immobilier	2,69
Services de communication	2,46
Liquidités et instruments assimilés	1,69
Warrants sur actions	0,08
Autre	-0,07

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

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

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

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

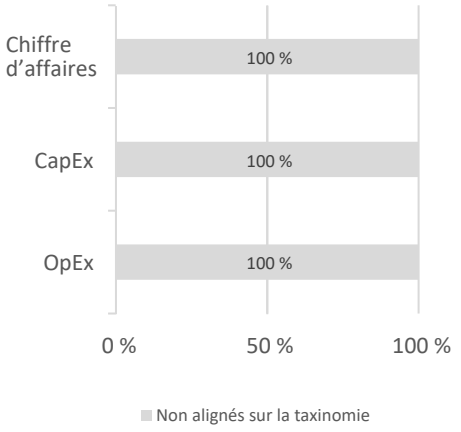
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

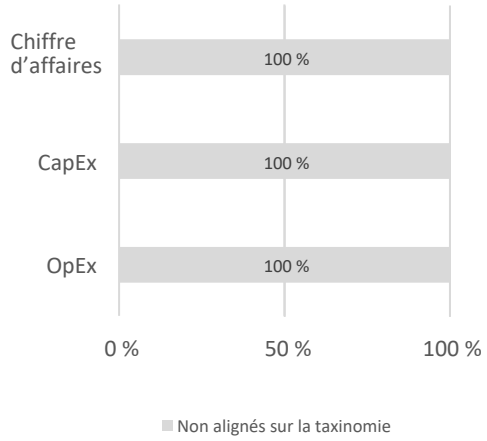
☒ Non. Le MFS European Value Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les 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.*

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS European Value Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration – MFS European Value Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 11 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Anglo American PLC, Flutter Entertainment PLC, Heineken NV, Iberdola, LEG Immobilien, RWE AG, Ryanair Holdings PLC ADR et Weir Group PLC. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque climatique, le risque de transition climatique, le risque physique lié au changement climatique, l'analyse de scénarios climatiques, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique de l'émetteur suivant : UBS Group AG.

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.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlem ent (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Concentrated Fund **(« MFS Global Concentrated Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : BMRY0ZKI2EE3QEBKPG73

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Global Concentrated Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Concentrated Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 82,50 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Concentrated Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 81,19 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,40 % de l'actif du MFS Global Concentrated Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	69,12	68,02
30 novembre 2021	73,91	70,03

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	64,39	63,37
30 novembre 2021	67,20	66,38

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

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	82,50	81,19
30 novembre 2021	96,46	95,31

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

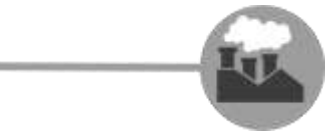
Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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



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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS savent faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à différentes étapes du processus d'investissement et des activités d'engagement. De plus, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il

est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Thermo Fisher Scientific Inc	Soins de santé	6,30	États-Unis
Visa Inc	Technologies de l'information	6,01	États-Unis
Accenture PLC	Technologies de l'information	5,11	États-Unis
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	5,10	France
Medtronic PLC	Soins de santé	4,95	États-Unis
Canadian National Railway Co	Industrie	4,66	Canada
Roche Holding AG	Soins de santé	4,39	Suisse
Goldman Sachs Group Inc	Finance	4,14	États-Unis
Schneider Electric SE	Industrie	4,12	France
Diageo PLC	Biens de consommation courante	4,00	Royaume-Uni
Linde PLC	Matériaux	3,94	États-Unis
Boston Scientific Corp	Soins de santé	3,80	États-Unis
Honeywell International Inc	Industrie	3,74	États-Unis
Nestle SA	Biens de consommation courante	3,64	Suisse
Cie Financière Richemont SA	Biens de consommation discrétionnaire	3,63	Suisse

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

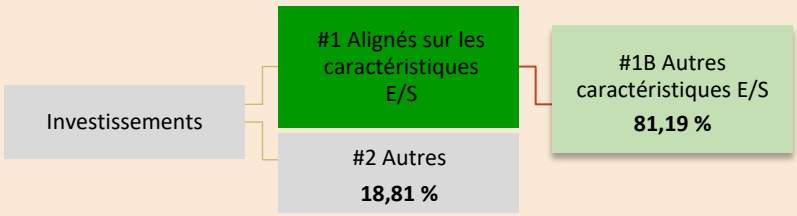
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Concentrated Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Concentrated Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 98,40 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Concentrated Fund ; les investissements restants (1,60 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 82,50 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Concentrated Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 81,19 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 18,81 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Soins de santé	22,19
Industrie	21,01
Technologies de l'information	14,24
Biens de consommation courante	14,14
Services de communication	8,86
Biens de consommation discrétionnaire	8,74
Matériaux	5,82
Finance	4,14
Liquidités et instruments assimilés	0,80
Warrants sur actions	0,15
Autre	-0,08

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022 et 30 septembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

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

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

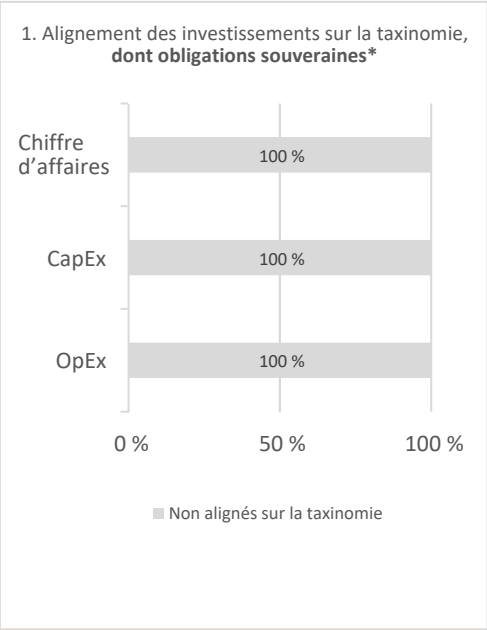
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

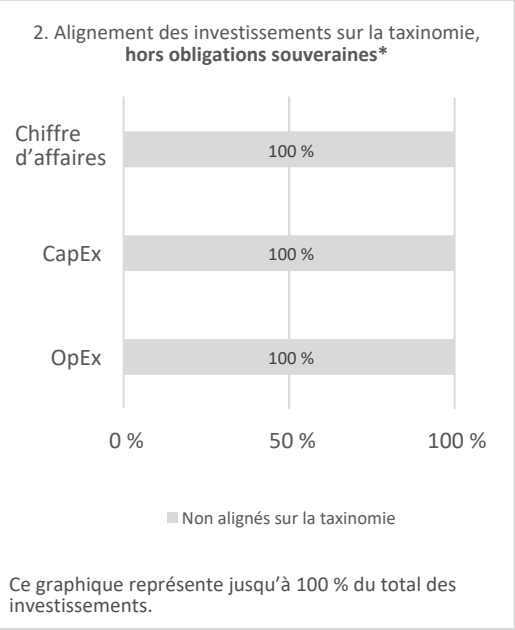
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

✖ Non. Le MFS Global Concentrated Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Global Concentrated Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Concentrated Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 5 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Accenture PLC, Boston Scientific Corp et Danone SA. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque climatique, le risque de transition climatique, le risque physique lié au changement climatique, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique de l'émetteur suivant : Canadian National Railway Company. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Honeywell International, Charter Communications, Inc et United Parcel Service, Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE la proposition d'actionnaires liée au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Comcast Corp.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Credit Fund **(« MFS Global Credit Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : N3QJ8XUW2UNVZ3ZBYQ23

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Global Credit Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Credit Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 71,82 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Credit Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 57,83 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 80,52 % de l'actif du MFS Global Credit Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	58,44	47,06
30 novembre 2021	58,93	48,71

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

Critère climatique 2	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	33,49	26,97
30 novembre 2021	34,71	28,69

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

Critère climatique 3	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	5,45	4,39
30 novembre 2021	4,62	3,82

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

Critères climatiques	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	71,82	57,83
30 novembre 2022	75,40	62,32

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

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

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Itraxx Eur Ser, option de vente, 15 février 22	Produit dérivé	2,48 %	Allemagne
Obligation internationale du gouvernement du Mexique, 24 mai 31	Gouvernement	1,07 %	Mexique
AerCap Ireland Capital DAC, 21 juillet 27	Entreprise	1,05 %	Irlande
JPMorgan Chase & Co, FRB, 22 avril 51	Entreprise	0,96 %	États-Unis
Bank of America Corp, FRB, 22 avril 32	Entreprise	0,93 %	États-Unis
Constellation Brands Inc, 2,25 %, 1er août 31	Entreprise	0,90 %	États-Unis
Morgan Stanley, FRB, 4 mai 27	Entreprise	0,80 %	États-Unis
China Construction Bank Corp, 4 août 25	Gouvernement	0,79 %	Chine
Itraxx Eur Ser, option de vente, 16 novembre 22	Produit dérivé	0,58 %	Allemagne
VICI Properties LP, 15 février 30	Entreprise	0,56 %	États-Unis
Wabtec Transportation Netherlands BV, 3 décembre 27	Entreprise	0,51 %	États-Unis
Mécanisme européen de stabilité, 15 octobre 31	Gouvernement	0,49 %	Organisme supranational
UBS AG RegS, 5,125 % 15 mai 24	Entreprise	0,48 %	États-Unis
JPMorgan Chase & Co, 1,47 %, 22 septembre 27	Entreprise	0,40 %	États-Unis
NXP BV 3,4 % 1er mai 30	Entreprise	0,40 %	Chine

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

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

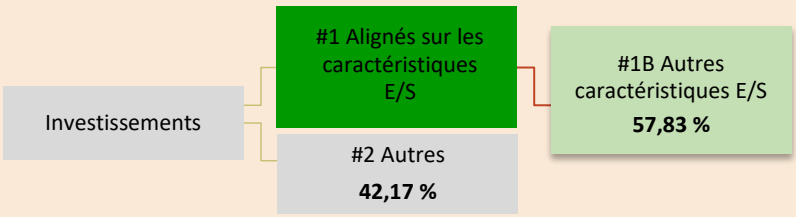
L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Le MFS Global Credit Fund vise à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Credit Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 80,52 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Credit Fund ; les investissements restants du portefeuille comprenaient des titres de créance non émis par des sociétés, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 71,82 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Credit Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 57,83 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 42,17 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à

des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Sociétés privées – industrie	43,22
Sociétés privées – établissements financiers	34,27
Gouvernement – agences gouvernementales	9,05
Sociétés privées – services publics	6,59
Liquidités	2,92
Gouvernement – titres souverains liés à un État	2,19
Produits dérivés – négociés en bourse	1,11
Gouvernement – organismes supranationaux liés à un gouvernement	1,07
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	0,73
Titrisation – titres adossés à des actifs	0,65
Obligations municipales – santé	0,18
Obligations municipales – éducation	0,18

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

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

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

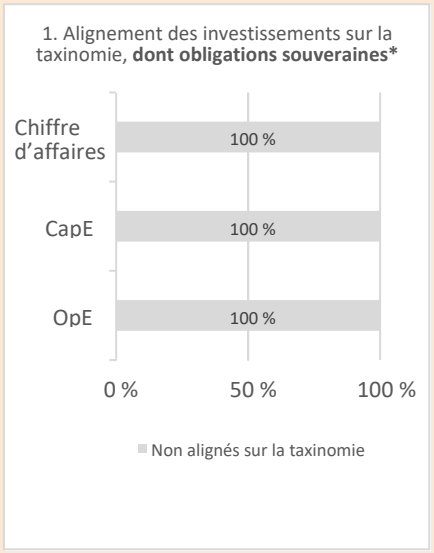
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

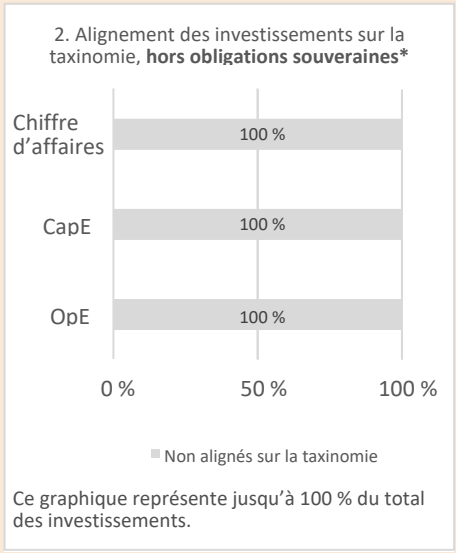
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS Global Credit Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Global Credit Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements - MFS Global Credit Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 17 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : American Electric Power Co Inc, Anglo American PLC, Boston Scientific Corp, CEZ AS, Constellation Brands Inc, Enbridge Inc, Enel SpA, Engie SA, Glencore PLC, Macquarie Group Ltd, Toronto Dominion Bank, Vulcan Materials Co et Xcel Energy. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi).

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Equity Fund **(« MFS Global Equity Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : YAHWU2BYOY7SCHWC8I94

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Global Equity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Equity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 80,79 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 80,10 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,14 % de l'actif du MFS Global Equity Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	63,97	63,42
30 novembre 2021	69,34	68,94

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	65,39	64,83
30 novembre 2021	60,40	60,04

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

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	80,79	80,10
30 novembre 2021	86,59	86,09

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

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

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

du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 30 novembre 2021 au 31 janvier2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Thermo Fisher Scientific Inc	Soins de santé	3,22	États-Unis
Visa Inc	Technologies de l'information	3,04	États-Unis
Schneider Electric SE	Industrie	2,77	France
Roche Holding AG	Soins de santé	2,76	Suisse
Linde PLC	Matériaux	2,59	États-Unis
Medtronic PLC	Soins de santé	2,55	États-Unis
Accenture PLC	Technologies de l'information	2,54	États-Unis
Nestle SA	Biens de consommation courante	2,46	Suisse
Comcast Corp	Services de communication	2,46	États-Unis
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	2,33	France
Diageo PLC	Biens de consommation courante	2,24	Royaume-Uni
Honeywell International Inc	Industrie	2,13	États-Unis
Canadian Pacific Railway Ltd	Industrie	2,12	Canada
Goldman Sachs Group Inc	Finance	1,85	États-Unis
Canadian National Railway Co	Industrie	1,81	Canada

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

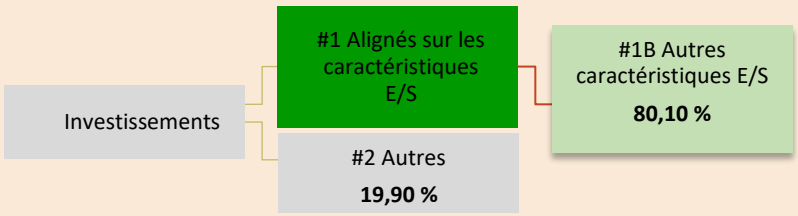
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

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

Le MFS Global Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 99,14 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Equity Fund ; les investissements restants (0,86 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 80,79 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 80,10 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 19,90 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Soins de santé	19,83
Industrie	18,56
Technologies de l'information	14,64
Biens de consommation courante	13,43
Finance	11,24
Biens de consommation discrétionnaire	7,88
Services de communication	6,95
Matériaux	6,51
Liquidités et instruments assimilés	0,94
Warrants sur actions	0,05
Autre	-0,03

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

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

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

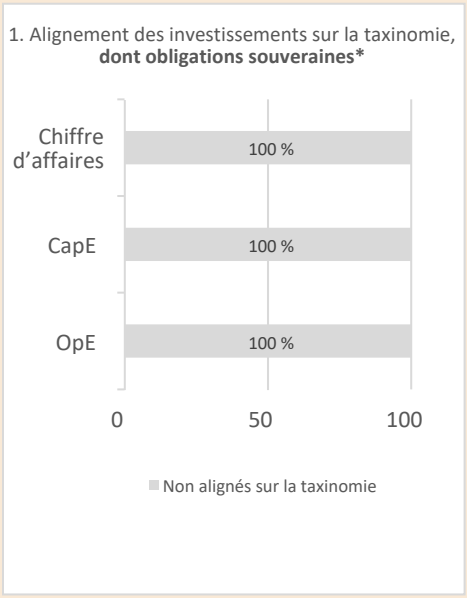
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

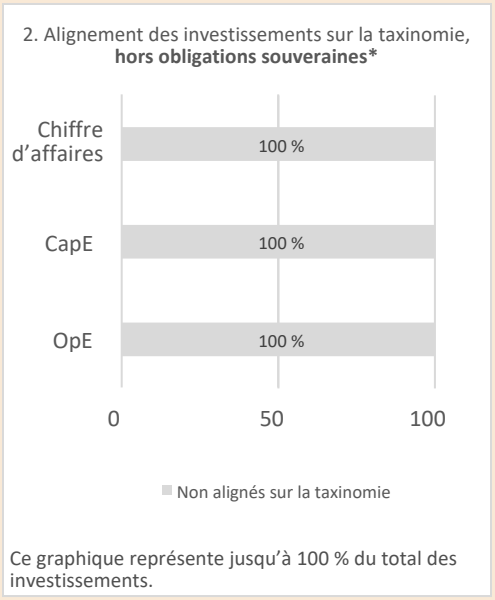
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

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

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Global Equity Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Equity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 15 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Accenture PLC, Boston Scientific Corp, Check Point Software Technologies Ltd, Colgate-Palmolive, Danone SA, Heineken NV, Hoya Corp, PPG Industries Inc, Rolls-Royce Holdings PLC, Union Pacific Corp et Whitbread PLC. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, l'analyse de scénarios climatiques, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Aena S.M.E. SA, UBS Group, Canadian Pacific Railway, London Stock Exchange Group plc et Canadian National Railway Company. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat des

émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Honeywell International et United Parcel Service, Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE la proposition d'actionnaires liée au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Comcast Corp.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Equity Income Fund (**« MFS Global Equity Income Fund »**)
Identifiant d'entité juridique : 22210022D2KOHO5J2W88

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Depuis le 30 novembre 2022, le MFS Global Equity Income Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Equity Income Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 75,20 % des titres de participation du portefeuille MFS Global Equity Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 74,26 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,74 % de l'actif du MFS Global Equity Income Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 30 novembre 2022 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	59,03	58,29
31 octobre 2022	64,82	63,83

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	58,78	58,04
31 octobre 2022	58,20	57,31

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

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

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	75,20	74,26
31 octobre 2022	79,82	78,61

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

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

d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 30 novembre 2022 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Merck & Co Inc	Soins de santé	5,00	États-Unis
Roche Holding AG	Soins de santé	4,00	Suisse
Johnson & Johnson	Soins de santé	3,66	États-Unis
General Mills Inc	Biens de consommation courante	3,37	États-Unis
Texas Instruments Inc	Technologies de l'information	3,23	États-Unis
Rio Tinto PLC	Matériaux	3,21	Royaume-Uni
DBS Group Holdings Ltd	Finance	3,03	Singapour
KDDI Corp	Services de communication	2,56	Japon
Kimberly-Clark Corp	Biens de consommation courante	2,54	États-Unis
Manulife Financial Corp	Finance	2,53	Canada
General Dynamics Corp	Industrie	2,45	États-Unis
McKesson Corp	Soins de santé	2,19	États-Unis
British American Tobacco PLC	Biens de consommation courante	2,13	Royaume-Uni
J M Smucker Co	Biens de consommation courante	2,01	États-Unis
Colgate-Palmolive Co	Biens de consommation courante	1,94	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

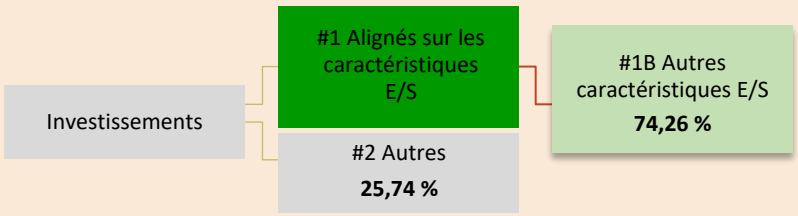
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Equity Income Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Equity Income Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 98,74 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Equity Income Fund ; les investissements restants (1,26 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 75,20 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Equity Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 74,26 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 25,74 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Soins de santé	20,56
Biens de consommation courante	18,87
Finance	16,74
Technologies de l'information	10,22
Industrie	6,61
Matériaux	6,59
Services de communication	5,38
Biens de consommation discrétionnaire	3,40
Énergie	2,95
Immobilier	2,08
Liquidités et instruments assimilés	1,46
Obligations convertibles	0,48

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

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

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

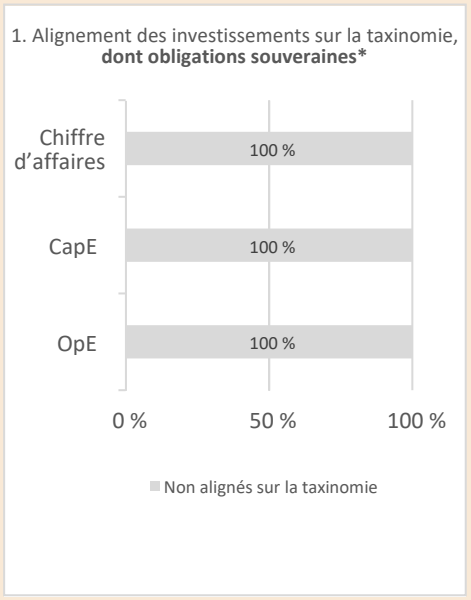
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

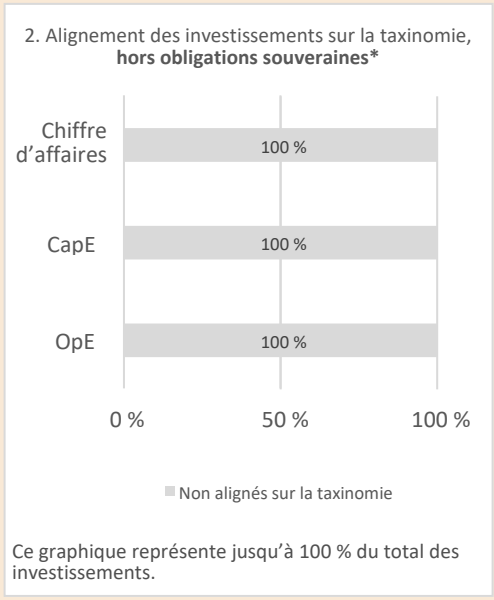
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

✖ Non. Le MFS Global Equity Income Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Global Equity Income Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Vote par procuration - MFS Global Equity Income Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants : Microsoft et National Australia Bank Limited.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Intrinsic Value Fund **(« MFS Global Intrinsic Value Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : 549300HBJQZCFOH6EK74

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Global Intrinsic Value Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Intrinsic Value Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 71,95 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Intrinsic Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 70,41 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 97,86 % de l'actif du MFS Global Intrinsic Value Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	56,77	55,56
30 novembre 2021	58,16	57,63

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	52,65	51,52
30 novembre 2021	44,4	44,0

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

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	71,95	70,41
30 novembre 2021	69,90	69,26

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences

négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Colgate-Palmolive Co	Biens de consommation courante	2,57	États-Unis
Cadence Design Systems Inc	Technologies de l'information	2,46	États-Unis
Synopsys Inc	Technologies de l'information	2,21	États-Unis
Nestle SA	Biens de consommation courante	2,16	Suisse
Aon PLC	Finance	1,85	États-Unis
Microsoft Corp	Technologies de l'information	1,82	États-Unis
Costco Wholesale Corp	Biens de consommation courante	1,80	États-Unis
Analog Devices Inc	Technologies de l'information	1,78	États-Unis
Franco-Nevada Corp	Matériaux	1,76	Canada
ANSYS Inc	Technologies de l'information	1,62	États-Unis
Charles Schwab Corp	Finance	1,59	États-Unis
Schneider Electric SE	Industrie	1,45	France
Givaudan SA	Matériaux	1,43	Suisse
Watts Water Technologies Inc	Industrie	1,43	États-Unis
Agilent Technologies Inc	Soins de santé	1,41	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

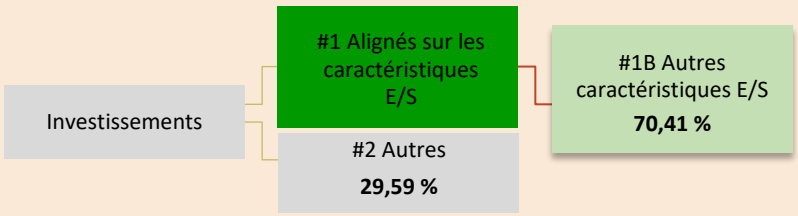
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Intrinsic Value Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Intrinsic Value Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 97,86 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Intrinsic Value Fund ; les investissements restants (2,16 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 71,95 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Intrinsic Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 70,41 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 29,59 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Technologies de l'information	24,25
Industrie	23,69
Biens de consommation courante	15,89
Matériaux	11,44
Finance	9,54
Soins de santé	6,08
Biens de consommation discrétionnaire	3,55
Liquidités et instruments assimilés	1,98
Services de communication	1,36
Énergie	1,28
Immobilier	0,94

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

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

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

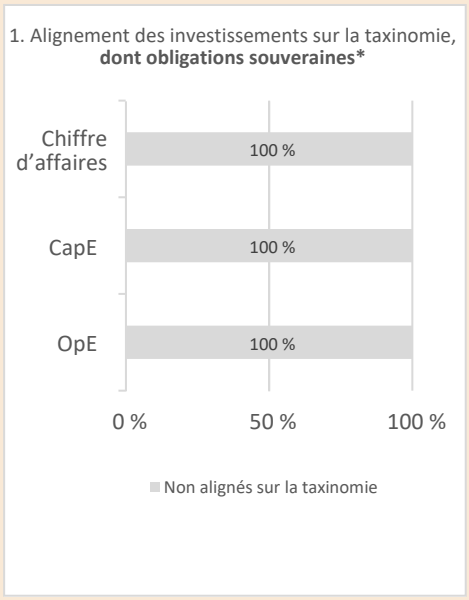
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

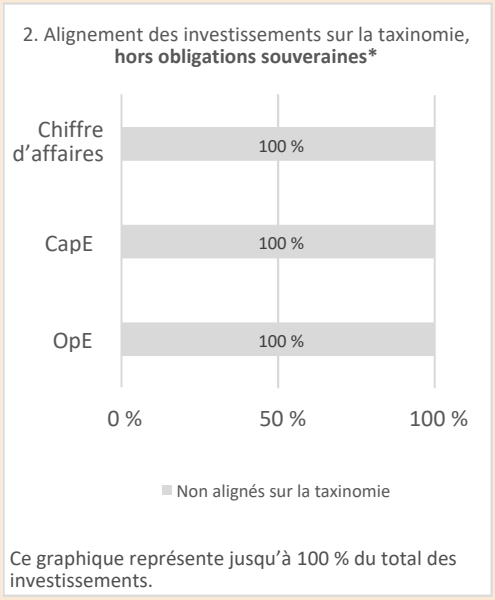
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

✖ Non. Le MFS Global Intrinsic Value Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Global Intrinsic Value Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Intrinsic Value Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 13 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Accenture PLC, Agilent Technologies Inc, Colgate-Palmolive Co, Danaher Corp, Epiroc AB, Glencore PLC, LEG Immobilien SE, Ryanair Holdings et Vulcan Materials Co. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque climatique, le risque de transition, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » /Science Based Targets (SBTi). Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Alphabet, Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE la proposition d'actionnaires liée au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Amazon.com Inc. et Microsoft.

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.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Opportunistic Bond Fund **(« MFS Global Opportunistic Bond Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : 222100ONK1WLJJOXDR98

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Global Opportunistic Bond Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Opportunistic Bond Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 66,44 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Opportunistic Bond Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 23,08 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 34,74 % de l'actif du MFS Global Opportunistic Bond Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	49,55	17,22
30 novembre 2021	52,05	20,89

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

Critère climatique 2	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	30,11	10,46
30 novembre 2021	23,18	9,30

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

Critère climatique 3	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	8,33	2,89
30 novembre 2021	5,89	2,36

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

Critères climatiques	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	66,44	23,08
30 novembre 2022	65,04	26,10

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

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

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Obligation d'État chinoise, 11 mars 26	Gouvernement	4,16 %	Chine
Obligation du Trésor coréen, 10 juin 29	Gouvernement	2,83 %	Corée du Sud
Swap de taux d'intérêt (IRS) en GBP à 5 ans, receveur, 15 juin 27	Gouvernement	2,29 %	États-Unis
Obligation d'État néo-zélandaise, 15 mai 28	Gouvernement	2,03 %	Nouvelle-Zélande
Obligation du Trésor américain, 15 août 40	Gouvernement	1,90 %	États-Unis
Obligation du Trésor coréen, 10 juin 30	Gouvernement	1,69 %	Corée du Sud
Contrat à terme standardisé à 30 ans sur obligation du Trésor américain, 21 septembre 22	Gouvernement	1,59 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 10 ans sur obligation canadienne, 19 décembre 22	Gouvernement	1,55 %	Canada
Contrat à terme standardisé à 30 ans sur obligation du Trésor américain, 21 juin 22	Gouvernement	1,38 %	États-Unis
Obligation d'État japonaise à 30 ans, 20 juin 44	Gouvernement	1,32 %	Japon
Contrat à terme standardisé à 10 ans sur obligation du Trésor américain, 21 septembre 22	Gouvernement	1,30 %	États-Unis
Obligation d'État chinoise, 21 novembre 29	Gouvernement	1,29 %	Chine
Itraxx Eur Ser, option de vente, 15 février 22	Produit dérivé	1,20 %	Allemagne
Gilt britannique, 22 juillet 27	Gouvernement	1,19 %	Royaume-Uni
Contrat à terme standardisé à 10 ans sur obligation canadienne, 22 mars 23	Gouvernement	1,02 %	Canada

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

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

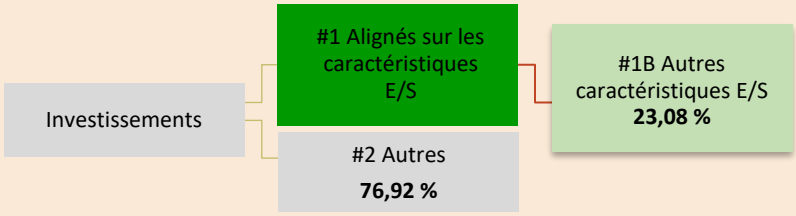
Le MFS Global Opportunistic Bond Fund vise à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Opportunistic Bond Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 34,74 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Opportunistic Bond Fund ; les investissements restants (65,26 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 66,44 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Opportunistic Bond Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 23,08 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 76,92 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré

comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Bons du Trésor	36,51
Sociétés privées – industrie	20,15
Sociétés privées – établissements financiers	10,97
Titrisation – obligations de prêts garantis	7,22
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires avec flux identiques	5,21
Gouvernement – agences gouvernementales	4,62
Liquidités	4,11
Gouvernement – titres souverains liés à un État	3,28
Sociétés privées – services publics	3,09
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	1,24
Produits dérivés – de gré à gré	0,83
Titrisation – titres adossés à des actifs	0,82
Gouvernement – organismes supranationaux liés à un gouvernement	0,78
Obligations municipales – éducation	0,56
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires commerciales	0,44
Obligations municipales – logement	0,27
Titrisation – obligation hypothécaire garantie	0,21
Obligations municipales – santé	0,06
Produits dérivés – négociés en bourse	-26,05

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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

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

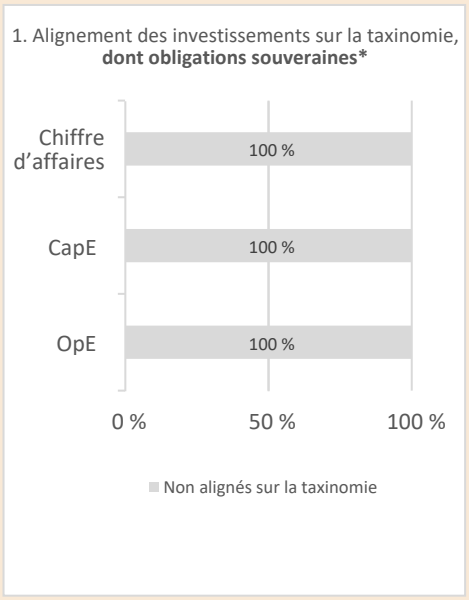
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

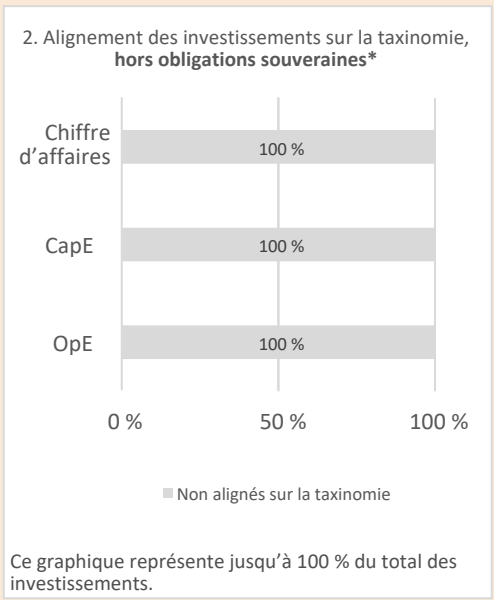
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS Global Opportunistic Bond Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de créance d'entreprises du MFS Global Opportunistic Bond Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du

climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements - MFS Global Opportunistic Bond Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 29 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Albion Financing, American Electric Power, Anglo American, Boston Scientific Corp, CEZ AS, Constellation Brands Inc, Danaher Corp, Duke Energy, Enbridge, Enel SpA, Engie SA, Eni SpA, Glencore, Macquarie, Millicom International Cellular, Petroleos Mexicanos, Q-Park Holding, Sasol, Toronto-Dominion, Vulcan Materials, Warner Music Corp et Xcel Energy. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, l'analyse de scénarios climatiques, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi).

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Research Focused Fund (« **MFS Global Research Focused Fund** »)
Identifiant d'entité juridique : 0XNVI8L269TT6JC97X03

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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 d'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** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Global Research Focused Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Research Focused Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 83,30 % des titres de participation du portefeuille MFS Global Research Focused Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 82,85 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,46 % de l'actif du MFS Global Research Focused Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	69,98	69,60
30 novembre 2021	52,16	51,67

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	57,58	57,27
30 novembre 2021	45,50	45,07

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

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	83,30	82,85
30 novembre 2021	73,45	72,76

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

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

portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 30 novembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Microsoft Corp	Technologies de l'information	6,25	États-Unis
Roche Holding AG	Soins de santé	3,60	Suisse
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	3,58	États-Unis
Southern Co	Services publics	3,19	États-Unis
Honeywell International Inc	Industrie	3,05	États-Unis
Mondelez International Inc	Biens de consommation courante	2,83	États-Unis
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	2,82	France
Linde PLC	Matériaux	2,68	États-Unis
Danaher Corp	Soins de santé	2,64	États-Unis
Amazon.com Inc	Biens de consommation discrétionnaire	2,60	États-Unis
Medtronic PLC	Soins de santé	2,57	États-Unis
Aon PLC	Finance	2,39	États-Unis
ConocoPhillips	Énergie	2,35	États-Unis
Charles Schwab Corp	Finance	2,32	États-Unis
Visa Inc	Technologies de l'information	2,27	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

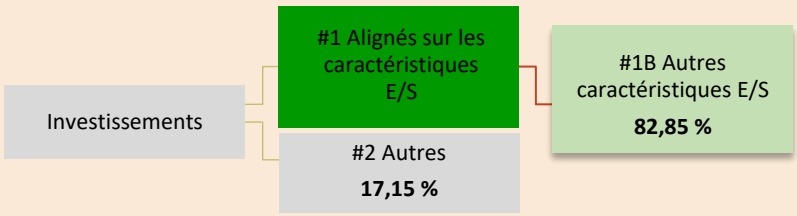
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

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

Le MFS Global Research Focused Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Research Focused Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 99,46 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Research Focused Fund ; les investissements restants (0,54 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et des instruments assimilés ; 83,30 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Research Focused Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 82,85 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 17,15 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Technologie	24,96
Services financiers	17,17
Biens d'équipement	16,32
Soins de santé	12,76
Biens de consommation cyclique	10,84
Énergie	8,23
Biens de consommation courante	6,11
Télécoms / télévision par câble	2,67
Liquidités et instruments assimilés	0,94

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

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

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

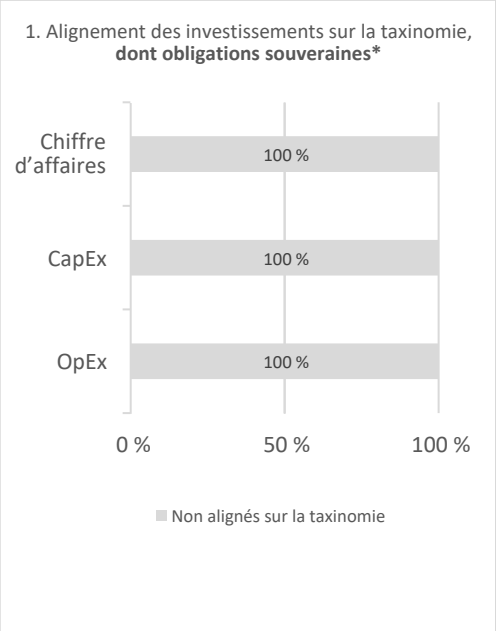
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

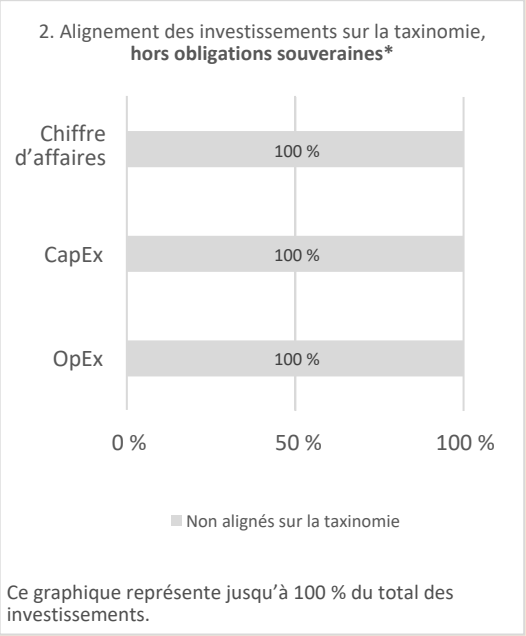
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS Global Research Focused Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Global Research Focused Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Research Focused Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 8 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Accenture, Chubb LTD, ConocoPhilips, Danaher Corp, Iberdrola et LEG Immobilien SE. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, l'analyse de scénarios climatiques, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Canadian Pacific Railway et Woodside Petroleum Ltd. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Honeywell International et Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Woodside Petroleum Ltd, Amazon.com Inc. et Microsoft.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Strategic Equity Fund **(« MFS Global Strategic Equity Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : 549300CC0OZ25I4TJK84

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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 d'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 ?

Depuis le 31 mai 2022, le MFS Global Strategic Equity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Strategic Equity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 89,05 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Strategic Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 88,18 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,02 % de l'actif du MFS Global Strategic Equity Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 mai 2022 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	66,53	65,88
30 avril 2022	74,94	74,39

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	73,79	73,07
30 avril 2022	59,07	58,63

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

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

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	89,05	88,18
30 avril 2022	83,77	83,14

- ***… et par rapport aux périodes précédentes ?***

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

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

du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 mai 2022 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Microsoft Corp	Technologies de l'information	7,22	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	6,76	États-Unis
Amazon.com Inc	Biens de consommation discrétionnaire	4,91	États-Unis
Mastercard Inc	Technologies de l'information	4,04	États-Unis
Roche Holding AG	Soins de santé	3,74	Suisse
MSCI Inc	Finance	3,50	États-Unis
Nestle SA	Biens de consommation courante	3,48	Suisse
Thermo Fisher Scientific Inc	Soins de santé	3,41	États-Unis
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	3,30	France
Canadian Pacific Railway Ltd	Industrie	3,25	Canada
Danaher Corp	Soins de santé	3,23	États-Unis
Charles Schwab Corp	Finance	3,19	États-Unis
Novo Nordisk AS	Soins de santé	3,16	Danemark
Wolters Kluwer NV	Industrie	3,00	Pays-Bas
Estee Lauder Cos Inc	Biens de consommation courante	2,92	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des périodes s'achevant les 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

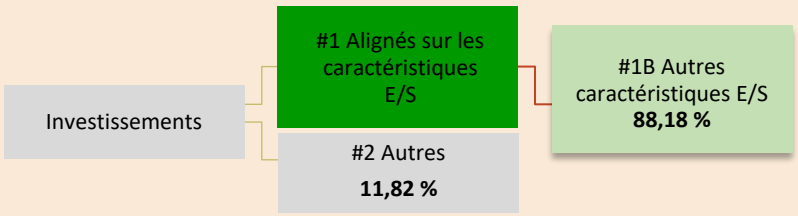
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

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

Le MFS Global Strategic Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Strategic Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 99,02 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Strategic Equity Fund ; les investissements restants (0,88 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 89,05 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Strategic Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 88,18 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 11,82 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Technologies de l'information	25,53
Soins de santé	17,69
Industrie	12,27
Finance	10,92
Biens de consommation discrétionnaire	10,68
Biens de consommation courante	8,93
Services de communication	8,50
Matériaux	4,87
Liquidités et instruments assimilés	0,58
Autre	0,02

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

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

Zéro. Le MFS Global Strategic Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des actifs durables et ne s'engage pas à atteindre un objectif environnemental au sens de la taxinomie de l'UE.

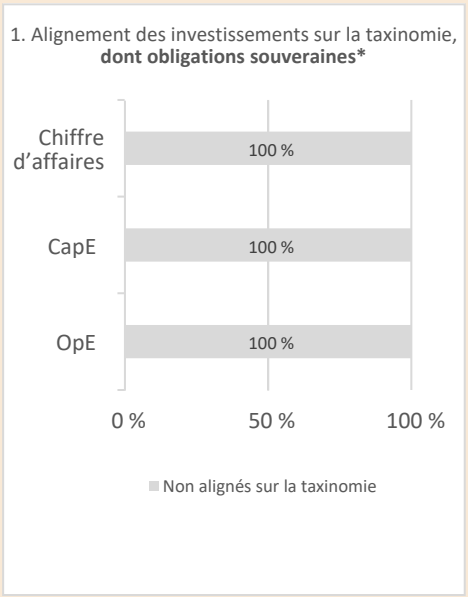
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

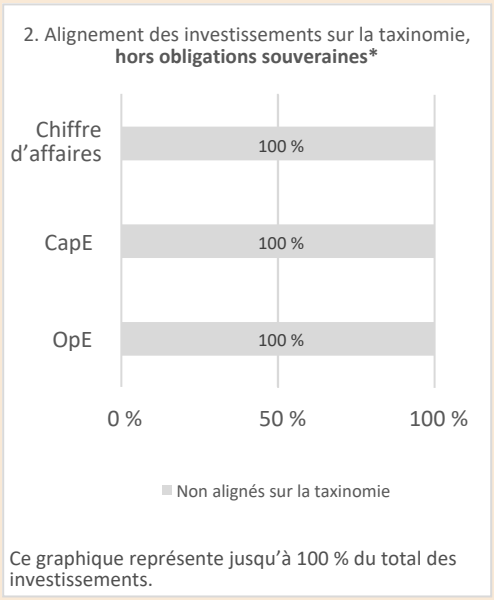
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

✖ Non. Le MFS Global Strategic Equity Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Global Strategic Equity Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Strategic Equity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 2 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Boston Scientific Corp et Danaher Corp. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Microsoft et National Australia Bank Limited.

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Total Return Fund **(« MFS Global Total Return »)**
Identifiant d'entité juridique : 1RDQ67M094ZPUN2RRO1

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ Oui	☒ No
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Depuis le 21 juillet 2022, le MFS Global Total Return Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Total Return Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation et au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille (selon le cas) dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des quatre critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023 : 83,01 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Total Return Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 49,31 % de l'actif total ; 73,98 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Total Return Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 8,73 % de l'actif total. Les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 59,31 % et 11,80 % de l'actif du MFS Global Total Return Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 22 juillet 2022 au 31 janvier 2023.

Critère climatique 1 – mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation et de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de participation et de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	**% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	66,12	39,22
30 juin 2022	69,44	41,02

Critère climatique 1	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	59,75	7,05
30 juin 2022	62,51	3,55

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

Critère climatique 2	**% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	58,24	34,54
30 juin 2022	8,30	4,90

Critère climatique 2	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	32,12	3,79
30 juin 2022	30,14	7,37

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

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

Critère climatique 3	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	0	0
30 juin 2022	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	5,68	0,67
30 juin 2022	5,25	0,62

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	83,01	49,24
30 juin 2022	73,33	43,23

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

Critères climatiques	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	73,98	8,73
30 juin 2022	72,72	8,57

- ***et par rapport aux périodes précédentes ?***

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser

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.

divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Global Total Return Fund.

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

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

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Obligation d'État chinoise, 11 mars 26	Marchés émergents	2,06	Chine
Johnson & Johnson	Soins de santé	1,58	États-Unis
Roche Holding AG	Soins de santé	1,54	Suisse
Merck & Co Inc	Soins de santé	1,39	États-Unis
Obligation du Trésor américain, 15 août 40	Emprunts d'État américains	1,19	États-Unis
Obligation du Trésor américain, 15 novembre 49	Emprunts d'État américains	1,00	États-Unis
Obligation du Trésor coréen, 10 juin 29	Marchés émergents	1,00	Corée du Sud
Aon PLC	Finance	0,95	États-Unis
UBS Group AG	Finance	0,93	Suisse
Texas Instruments Inc	Technologies de l'information	0,92	États-Unis
KDDI Corp	Services de communication	0,91	Japon
BNP Paribas SA	Finance	0,88	France
Gilt britannique, 22 juillet 27	Hors marché américain	0,87	Royaume-Uni
Comcast Corp	Services de communication	0,86	États-Unis
JPMorgan Chase & Co	Finance	0,80	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

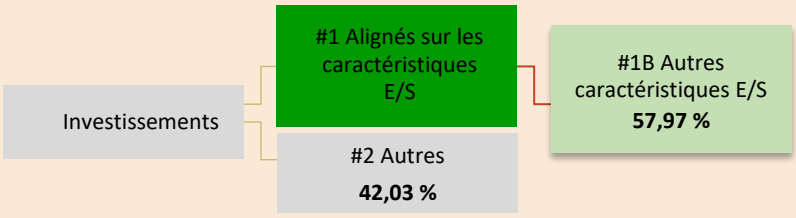
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Total Return Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation et 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Total Return Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 59,31 % et 11,80 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Total Return Fund ; les investissements restants (28,89 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 83,01 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Total Return Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 49,24 % de l'actif total du portefeuille ; 73,98 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Total Return Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 8,73 % de l'actif total du portefeuille ; 57,97 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 42,03 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Finance	12,37
Créances d'entreprises	11,80
Soins de santé	9,26
Industrie	8,80
Marchés émergents	7,66
Biens de consommation courante	7,33
Hors marché américain	6,62
Technologies de l'information	6,60

Autre	6,00
Titres adossés à des créances hypothécaires	4,24
Services de communication	3,79
Matériaux	2,91
Énergie	2,75
Biens de consommation discrétionnaire	2,63
Liquidités et instruments assimilés	2,30
Services publics	1,80
Obligations titrisées (CDO)	1,51
Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales	0,77
Obligations municipales	0,72
Immobilier	0,44
Titres adossés à des actifs	0,34
Obligations convertibles	0,10
Agences	0,02
Emprunts d'État américains	-0,75

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

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

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

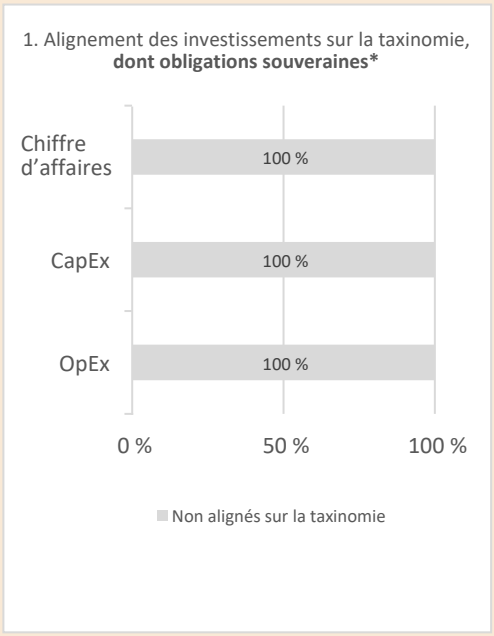
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

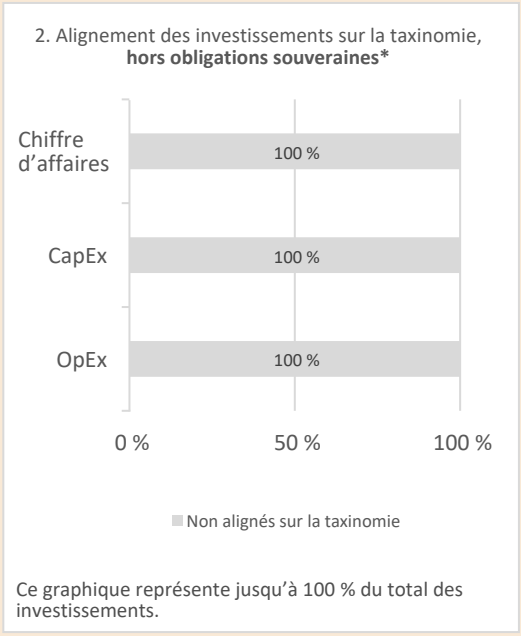
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS Global Total Return Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

**** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.***

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Global Total Return Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Total Return Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 20 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Accenture, American Electric Power Co Inc, Boston Scientific Corp, Cboe Global Markets, CEZ, Chubb Ltd, Colgate Palmolive, ConocoPhillips, Constellation Brands, Danaher, Danone SA, Duke Energy Corp, Enel SpA, Glencore, Kimberly-Clark, PPG, Sempra Energy, Union Pacific et Xcel Energy Inc. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, le risque physique, l'analyse de scénarios climatiques, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Microsoft et National Bank of Australia.

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.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Limited Maturity Fund **(« MFS Limited Maturity Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : H22Q4XW7UTNWFDP0PD4

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Depuis le 21 juillet 2022, le MFS Limited Maturity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Limited Maturity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 76,20 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Limited Maturity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 42,36 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 55,59 % de l'actif du MFS Limited Maturity Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 21 juillet 2022 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	66,95	37,22
30 juin 2022	70,45	39,60

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

Critère climatique 2	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	29,48	16,39
30 juin 2022	30,68	17,24

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

Critère climatique 3	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 juin 2022	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	1,57	0,87
30 juin 2022	1,58	0,89

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

Critères climatiques	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	76,20	42,36
30 juin 2022	79,01	44,41

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

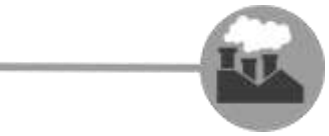
Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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



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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

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

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 21 juillet 2022 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Bon du Trésor américain, 15 mai 24	Gouvernement	8,44 %	États-Unis
Bon du Trésor américain, 15 mai 25	Gouvernement	4,74 %	États-Unis
Swap de taux d'intérêt (IRS) en USD à 3 ans, receveur, 13 mai 25	Gouvernement	2,65 %	États-Unis
Swap de taux d'intérêt (IRS) en USD à 3 ans, receveur, 6 décembre 25	Gouvernement	1,95 %	États-Unis
Bon du Trésor américain, 15 décembre 23	Gouvernement	1,92 %	États-Unis
Bon du Trésor américain, 15 novembre 25	Gouvernement	1,58 %	États-Unis
Bon du Trésor américain, 31 juillet 24	Gouvernement	1,55 %	États-Unis
Royal Bank of Canada, 26 octobre 23	Entreprise	0,94 %	Canada
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 30 juin 22	Gouvernement	0,83 %	États-Unis
Hyundai Capital America, 6 avril 23	Entreprise	0,83 %	Corée du Sud
AT&T Inc, 0,9 %, 25 mars 24	Entreprise	0,77 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 30 septembre 22	Gouvernement	0,77 %	États-Unis
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 15 septembre 24	Entreprise	0,73 %	Japon
Wells Fargo & Co, FRB 2 juin 24	Entreprise	0,73 %	États-Unis
NatWest Group PLC, FRB, 22 mars 25	Entreprise	0,72 %	Royaume-Uni

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

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

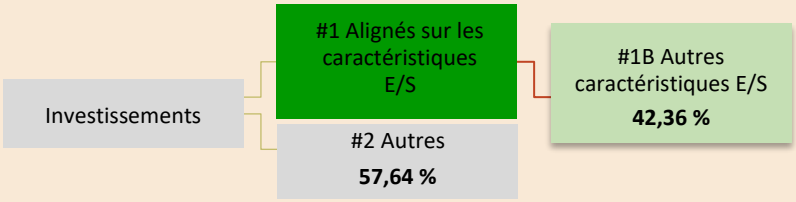
L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Le MFS Limited Maturity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Limited Maturity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 55,59 % de l'actif total du portefeuille du MFS Limited Maturity Fund ; les investissements restants (44,41 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 76,20 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Limited Maturity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 42,36 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 57,64 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de

l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Sociétés privées – industrie	26,93
Sociétés privées – établissements financiers	26,48
Trésor – bons du Trésor	18,22
Titrisation – obligations de prêts garantis	14,99
Sociétés privées – services publics	3,79
Produits dérivés – négociés en bourse	2,89
Titrisation – titres adossés à des actifs	2,11
Liquidités	2,91
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires commerciales	1,01
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	0,87
Gouvernement – agences gouvernementales	0,80
Obligations municipales – location	0,67
Titrisation – obligation hypothécaire garantie	0,56
Gouvernement – titres souverains liés à un État	0,45
Obligations municipales – services publics	0,21
Obligations municipales – obligations fiscales spéciales	0,21
Obligations municipales – autres	0,19
Obligations municipales – éducation	0,18
Obligations municipales – transport	0,16
Obligations municipales – développement industriel	0,13
Obligations municipales – logement	0,12
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires avec flux identiques	0,10
Produits dérivés – de gré à gré	-3,30

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 décembre 2021, 31 mars 2022, 30 juin 2022 et 30 septembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de

marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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

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

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

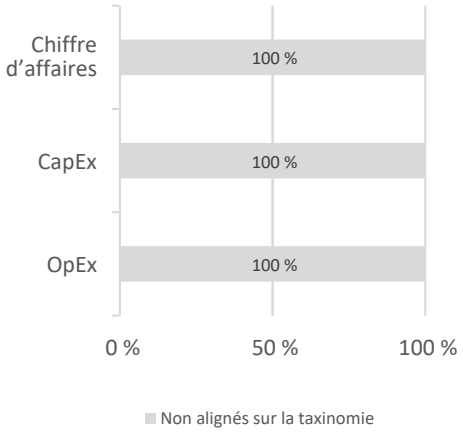
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

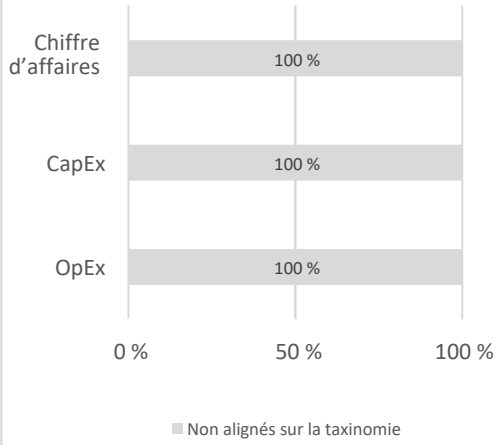
☒ Non. Le MFS Limited Maturity Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Limited Maturity Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements - MFS Limited Maturity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 2 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Enel SpA et Glencore, Macquarie. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi).

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Managed Wealth Fund **(« MFS Managed Wealth Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : 222100EEEJHVDAVX719

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Depuis le 21 juillet 2022, le MFS Managed Wealth Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Managed Wealth Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 86,78 % des titres de participation du portefeuille MFS Managed Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 80,57 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 92,84 % de l'actif du MFS Managed Wealth Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 21 juillet 2022 au 31 janvier 2023.

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

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	68,82	63,89
30 juin 2022	69,05	57,29

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

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	62,96	58,45
30 juin 2022	8,92	7,40

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

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

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	86,78	80,57
30 juin 2022	81,26	59,12

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

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

Sans objet.

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

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

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

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

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

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

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

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS savent faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à différentes étapes du processus d'investissement et des activités d'engagement. De plus, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences

négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 21 juillet 2022 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Microsoft Corp	Technologies de l'information	3,57	États-Unis
Amazon.com Inc	Biens de consommation discrétionnaire	2,00	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	1,73	États-Unis
Nestle SA	Biens de consommation courante	1,64	Suisse
Apple Inc	Technologies de l'information	1,53	États-Unis
Thermo Fisher Scientific Inc	Soins de santé	1,29	États-Unis
Aon PLC	Finance	1,19	États-Unis
Roche Holding AG	Soins de santé	1,11	Suisse
Danaher Corp	Soins de santé	1,08	États-Unis
JPMorgan Chase & Co	Finance	1,04	États-Unis
Mastercard Inc	Technologies de l'information	1,02	États-Unis
Johnson & Johnson	Soins de santé	1,00	États-Unis
Diageo PLC	Biens de consommation courante	0,97	Royaume-Uni
Abbott Laboratories	Soins de santé	0,95	États-Unis
Schneider Electric SE	Industrie	0,89	France

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

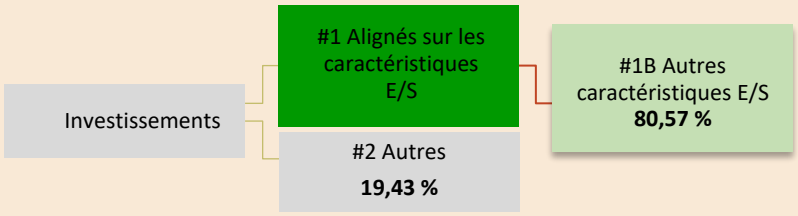
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Managed Wealth Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Managed Wealth Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

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

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 92,84 % de l'actif total du portefeuille du MFS Managed Wealth Fund ; les investissements restants (7,16 % du portefeuille) comprenaient des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés. Au 31 janvier 2023, 86,78 % des titres de participation du portefeuille du MFS Managed Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 80,57 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 19,43 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

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

Secteurs	Pondération moyenne en %
Autre	73,12
Technologies de l'information	16,50
Soins de santé	15,17
Finance	14,55
Industrie	12,67
Liquidités et instruments assimilés	12,58
Biens de consommation discrétionnaire	7,61
Biens de consommation courante	6,64
Services de communication	4,67
Matériaux	4,29
Services publics	2,39
Énergie	2,17
Immobilier	0,57
Options sur indices	-1,54
Contrats à terme standardisés sur indices	-71,48

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

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

Zéro. Le MFS Managed Wealth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des actifs durables ayant un objectif environnemental au sens de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

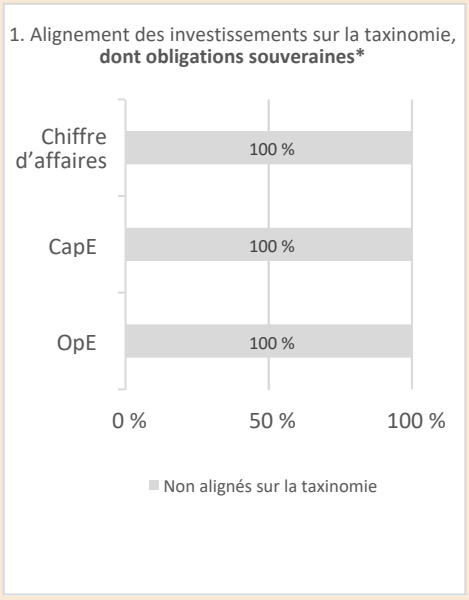
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

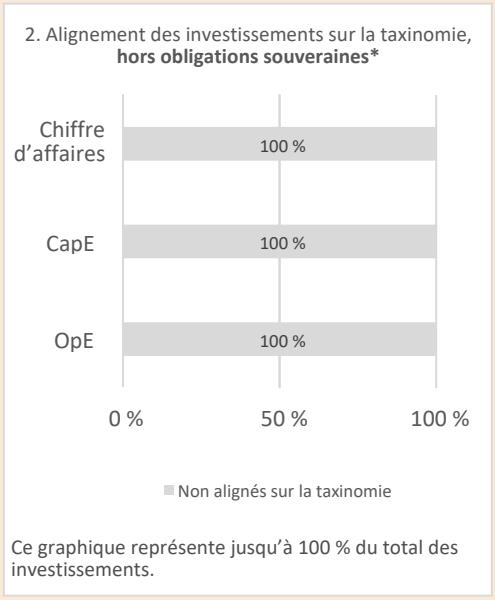
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS Managed Wealth Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

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

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

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

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

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

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

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

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

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

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

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS Managed Wealth Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

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

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du

climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Managed Wealth Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 19 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Accenture PLC, AIA Group Ltd, Bayer AG, Charter Communications Inc, Check Point Software Technologies Ltd, Chubb Ltd, Cie Générale des Établissements Michelin SCA, Citigroup Inc, Colgate-Palmolive Co, Compass Group PLC, ConocoPhillips, Danaher Corp, Duke Energy Corp, EOG Resources Inc, Kimberly-Clark Corp, Lowe's Cos Inc, PPG Industries Inc, Rolls-Royce Holdings PLC, Take-Two Interactive Software Inc, Union Pacific Corp et Xcel Energy Inc. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, l'analyse de scénarios climatiques, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE une proposition d'actionnaires liée au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Microsoft.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Prudent Capital Fund **(« MFS Prudent Capital Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : 222100FL6ZWWC5ZUHJ09

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

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

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

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

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Prudent Capital Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Prudent Capital Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation et au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille (selon le cas) dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des quatre critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023 : 68,64 % des titres de participation du portefeuille du MFS Prudent Capital Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 40,43 % de l'actif total ; 62,92 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Prudent Capital Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 6,82 % de l'actif total. Les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 58,88 % et 10,84 % de l'actif du MFS Prudent Capital Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Critère climatique 1 – mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation et de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de participation et de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	**% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	46,45	27,35
30 novembre 2021	66,76	32,23

Critère climatique 1	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	52,77	5,77
30 novembre 2021	29,9	3,02

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

Critère climatique 2	**% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	61,28	36,08
30 novembre 2021	52,30	25,27

Critère climatique 2	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	23,71	2,57
30 novembre 2021	9,60	0,97

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

Critère climatique 3	**% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 3	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	6,09	0,66
30 novembre 2021	0	0

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

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	68,64	40,42
30 novembre 2021	80,16	38,70

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

Critères climatiques	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	62,92	6,82
30 novembre 2021	34,6	3,50

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Sans objet.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

Le MFS Prudent Capital Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur

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.

permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Prudent Capital Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et l'**intensité des émissions de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone**, **exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles**, **part de la consommation d'énergies non renouvelables et intensité de la production et de la consommation d'énergie par secteur climatique à fort impact** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales** et **diversité du genre dans les Conseils d'administration**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Bon du Trésor américain, 1,375 %, 30 septembre 23	Emprunts d'État américains	4,95	États-Unis
Bon du Trésor américain, 1,375 %, 30 juin 23	Emprunts d'État américains	4,74	États-Unis
Bon du Trésor américain, 0,5 %, 15 mars 23	Emprunts d'État américains	4,74	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	3,58	États-Unis
Bon du Trésor américain, 2,625 %, 31 décembre 23	Emprunts d'État américains	3,43	États-Unis
LEG Immobilien SE	Immobilier	3,33	Allemagne
Bon du Trésor américain, 1,625 %, 15 décembre 22	Emprunts d'État américains	3,14	États-Unis
Check Point Software Technologies Ltd	Technologies de l'information	2,15	Israël
Bon du Trésor américain, 2,25 %, 31 mars 24	Emprunts d'État américains	2,07	États-Unis
Iberdrola SA	Services publics	2,06	Espagne
iShares Physical Gold ETC ETF	ETF	2,04	Irlande
Vonovia SE	Immobilier	2,04	Allemagne
Wolters Kluwer NV	Industrie	1,96	Pays-Bas
KDDI Corp	Services de communication	1,88	Japon
Sage Group PLC/The	Technologies de l'information	1,62	Royaume-Uni

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

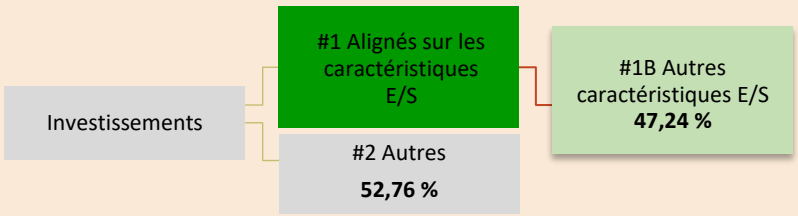
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Prudent Capital Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation et 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Prudent Capital Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 58,88 % et 10,84 % de l'actif total du portefeuille du MFS Prudent Capital Fund ; les investissements restants (30,28 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et / ou des instruments assimilés ; 68,64 % des titres de participation du portefeuille du MFS Prudent Capital Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 40,42 % de l'actif total du portefeuille ; 62,92 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Prudent Capital Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 6,82 % de l'actif total du portefeuille ; 47,24 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 52,76 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Emprunts d'État américains	27,87
Technologies de l'information	13,23
Autre	13,17
Services de communication	10,95
Créances d'entreprises	9,21
Immobilier	7,64
Industrie	7,61

Biens de consommation courante	5,40
Liquidités et instruments assimilés	3,81
ETF	2,57
Services publics	2,06
Biens de consommation discrétionnaire	2,02
Finance	1,97
Titres adossés à des créances hypothécaires	1,72
Matériaux	1,25
Dette des marchés émergents	0,94
Options sur actions	-0,26
Contrats à terme standardisés sur indices	-2,48
Options sur indices	-8,66

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Prudent Capital Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

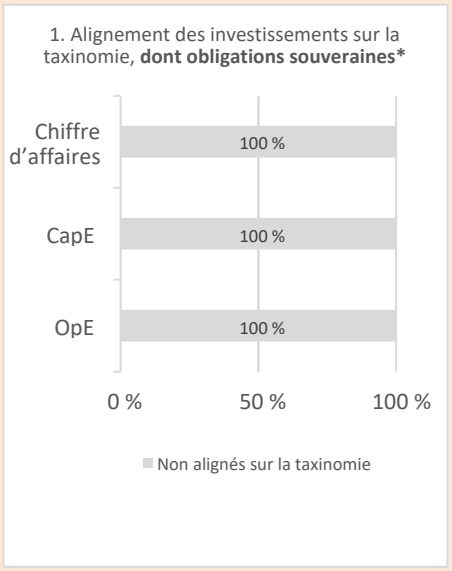
☐ Oui :

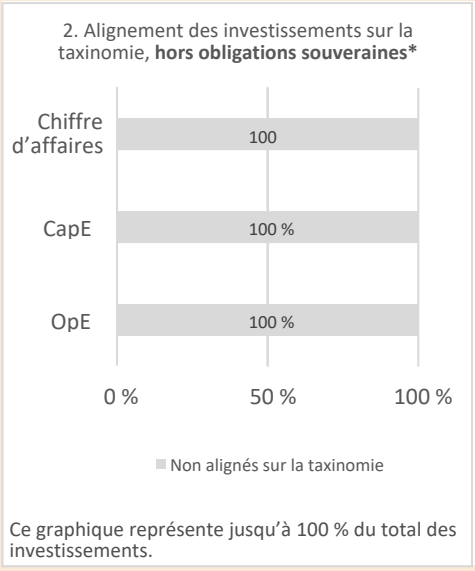
☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS Prudent Capital Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS Prudent Capital Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Prudent Capital Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation et les titres de créance d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de produits dérivés, de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Prudent Capital Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme » Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du MFS Prudent Capital Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Prudent Capital Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 8 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Check Point Software, Danone, Iberdrola, LEG Immobilien SE, Q-Park Holding et Warner Music Group. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, le risque physique, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Honeywell International, Charter Communications Inc. et Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Amazon.com Inc., Comcast Corp et Microsoft.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce Règlement ne comprend pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Prudent Wealth Fund **(« MFS Prudent Wealth Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : 549300LM7K1F8VSRZS66

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Prudent Wealth Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Prudent Wealth Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation et au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille (selon le cas) dans des émetteurs qui répondent, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des quatre critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023 : 60,92 % des titres de participation du portefeuille du MFS Prudent Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 41,12 % de l'actif total ; 100 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Prudent Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 1,14 % de l'actif total. Les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 67,51 % et 1,14 % de l'actif du MFS Prudent Wealth Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Critère climatique 1 – mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation et de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de participation et de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	**% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	39,18	26,45
30 novembre 2021	67,01	37,0

Critère climatique 1	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	100	1,14
30 novembre 2021	100	0,90

Critère climatique 2 – mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	**% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	54,86	37,04
30 novembre 2021	43,80	24,20

Critère climatique 2	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	30,70	0,35
30 novembre 2021	33,1	0,28

Critère climatique 3 – mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	**% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 3	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	60,92	41,12
30 novembre 2022	76,12	42,03

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	100	1,14
30 novembre 2022	100	0,90

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Sans objet.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

Le MFS Prudent Wealth Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Prudent Wealth Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et l'**intensité des émissions de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone**, **exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles**, **part de la consommation d'énergies non renouvelables et intensité de la production et de la consommation d'énergie par secteur climatique à fort impact** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales** et **diversité du genre dans les Conseils d'administration**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Bon du Trésor américain, 30 septembre 23	Emprunts d'État américains	4,87	États-Unis
Bon du Trésor américain, 30 juin 23	Emprunts d'État américains	4,69	États-Unis
Bon du Trésor américain, 15 mars 23	Emprunts d'État américains	4,66	États-Unis
Bon du Trésor américain, 31 décembre 23	Emprunts d'État américains	3,36	États-Unis
LEG Immobilien SE	Immobilier	3,12	Allemagne
Bon du Trésor américain, 15 décembre 22	Emprunts d'État américains	3,06	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	2,90	États-Unis
iShares Physical Gold ETC ETF	ETF	2,28	Irlande
Iberdrola SA	Services publics	2,04	Espagne
Bon du Trésor américain, 31 mars 24	Emprunts d'État américains	1,97	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Check Point Software Technologies Ltd	Technologies de l'information	1,82	Israël
KDDI Corp	Services de communication	1,81	Japon
Serco Group PLC	Industrie	1,62	Royaume-Uni
Wolters Kluwer NV	Industrie	1,45	Pays-Bas
Sage Group PLC	Technologies de l'information	1,44	Royaume-Uni

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

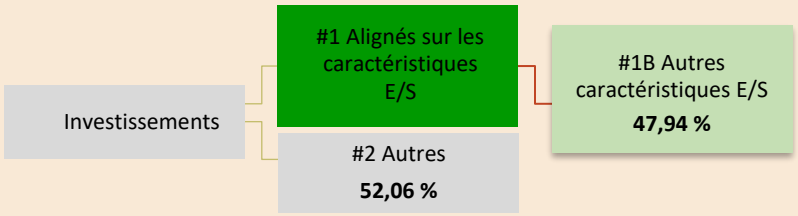
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Prudent Wealth Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation et 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Prudent Wealth Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 67,51 % et 1,14 % de l'actif total du portefeuille du MFS Prudent Wealth Fund ; les investissements restants du portefeuille comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 60,92 % des titres de participation du portefeuille du MFS Prudent Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 41,12 % de l'actif total du portefeuille ; 62,92 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Prudent Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 6,82 % de l'actif total du portefeuille ; 47,94 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 52,06 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Emprunts d'État américains	27,53
Autre	21,12
Technologies de l'information	12,69
Immobilier	11,03
Services de communication	10,33
Industrie	9,65
Biens de consommation courante	5,66
Liquidités et instruments assimilés	4,31
Biens de consommation discrétionnaire	3,74
ETF	2,87
Matériaux	2,64
Finance	2,60
Services publics	2,04
Créances d'entreprises	1,03
Soins de santé	0,74
Options sur actions	-0,22
Contrats à terme standardisés sur indices	-2,47
Options sur indices	-15,29

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Prudent Wealth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

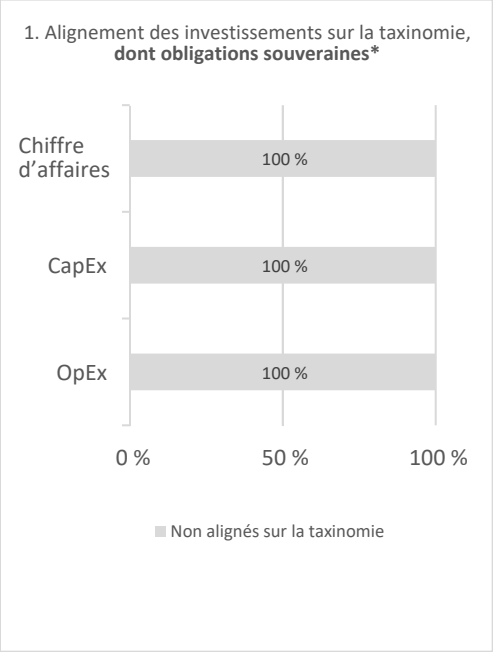
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

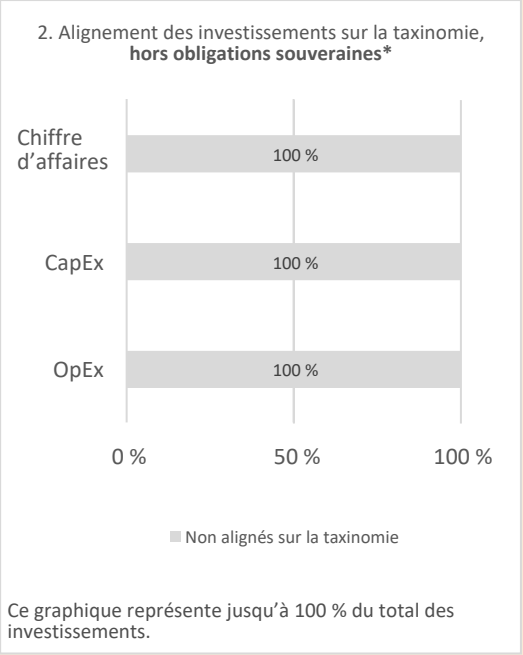
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS Prudent Wealth Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS Prudent Wealth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Prudent Wealth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation et les titres de créance d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de produits dérivés, de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Prudent Wealth Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du MFS Prudent Wealth Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS Prudent Wealth Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 6 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Check Point Software, Danone, Iberdrola et LEG Immobilien SE. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Charter Communications Inc. et Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Booking Holdings Inc. et Microsoft.

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.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.K. Equity Fund **(« MFS U.K. Equity Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : DAPX7647TOH0KQ40FF91

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____% d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS U.K. Equity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.K. Equity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 91,42 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.K. Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 90,84 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,36 % de l'actif du MFS U.K. Equity Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	73,96	73,49
30 novembre 2021	74,09	72,80

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	59,32	58,94
30 novembre 2021	51,80	50,89

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	91,42	90,84
30 novembre 2021	88,62	87,07

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Sans objet.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

Le MFS U.K. Equity Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.K. Equity Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et l'**intensité des émissions de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone**, **exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles**, **part de la consommation d'énergies non renouvelables et intensité de la production et de la consommation d'énergie par secteur climatique à fort impact** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales** et **diversité du genre dans les Conseils d'administration**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas

les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Shell PLC	Énergie	5,46	Royaume-Uni
AstraZeneca PLC	Soins de santé	5,25	Royaume-Uni
Diageo PLC	Biens de consommation courante	4,78	Royaume-Uni
RELX PLC	Industrie	3,99	Royaume-Uni
Glencore PLC	Matériaux	3,69	Royaume-Uni
Reckitt Benckiser Group PLC	Biens de consommation courante	3,52	Royaume-Uni
Imperial Brands PLC	Biens de consommation courante	3,39	Royaume-Uni
Rio Tinto PLC	Matériaux	3,26	Royaume-Uni
Barclays PLC	Finance	3,24	Royaume-Uni
NatWest Group PLC	Finance	3,23	Royaume-Uni
Tesco PLC	Biens de consommation courante	3,04	Royaume-Uni
Experian PLC	Industrie	2,76	Royaume-Uni
British American Tobacco PLC	Biens de consommation courante	2,76	Royaume-Uni
National Grid PLC	Services publics	2,62	Royaume-Uni
Vodafone Group PLC	Services de communication	2,40	Royaume-Uni

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

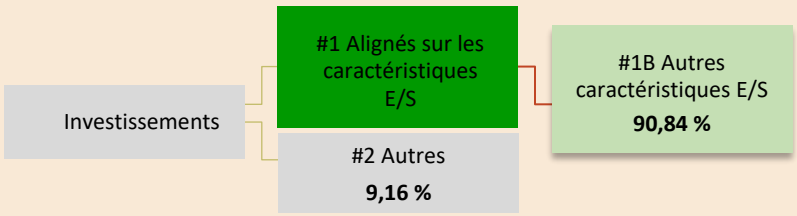
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS U.K. Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.K. Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 99,36 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.K. Equity Fund ; les investissements restants du portefeuille comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 91,42 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.K. Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 90,84 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 9,16 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Finance	18,13
Biens de consommation courante	17,87
Industrie	13,07
Matériaux	11,81
Énergie	9,01
Soins de santé	8,86
Biens de consommation discrétionnaire	8,28
Services de communication	5,66
Services publics	2,62
Immobilier	1,80
Liquidités et instruments assimilés	1,56
Technologies de l'information	1,35

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.K. Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

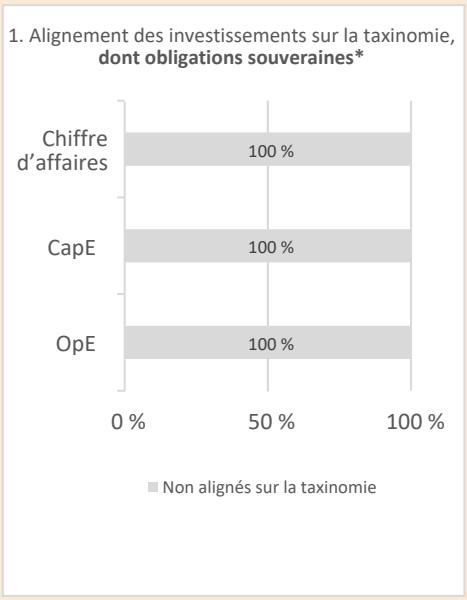
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

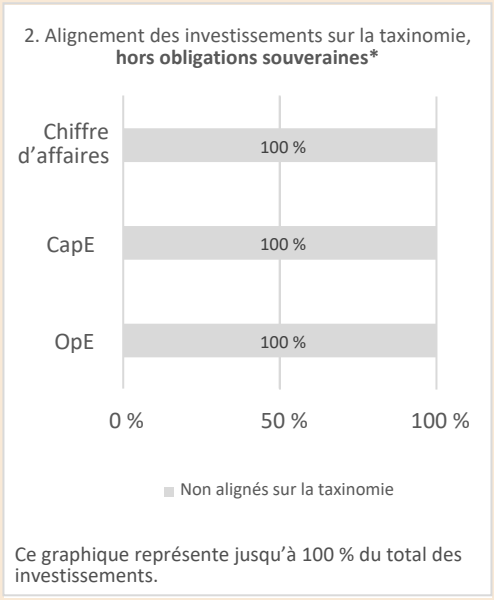
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS U.K. Equity Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS U.K. Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.K. Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS U.K. Equity Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS U.K. Equity Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS U.K. Equity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 11 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Flutter, Forterra, Glencore, Tesco, Weir Group et Whitbread. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Rio Tinto plc, London Stock Exchange group plc, Glencore plc, NatWest Group, Barclays plc et National Grid plc.

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.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce Règlement ne comprend pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.S. Concentrated Growth Fund **(« MFS U.S. Concentrated Growth Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : G651RPCOZ0VMJ132HI34

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS U.S. Concentrated Growth Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.S. Concentrated Growth Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 90,08 % des titres de participation du portefeuille MFS U.S. Concentrated Growth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 89,41 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,25 % de l'actif du MFS U.S. Concentrated Growth Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	77,45	76,87
30 novembre 2021	62,19	61,52

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	59,36	58,92
30 novembre 2021	52,80	52,20

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	90,08	89,41
30 novembre 2021	80,22	79,36

- ***… et par rapport aux périodes précédentes ?***

Sans objet.

- ***Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?***

Sans objet.

- ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

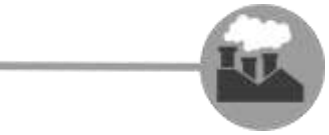
Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.S. Concentrated Growth Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et l'**intensité des émissions de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone**, **exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles**, **part de la consommation d'énergies non renouvelables et intensité de la production et de la consommation d'énergie par secteur climatique à fort impact** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales** et **diversité du genre dans les Conseils d'administration**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS savent faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à différentes étapes du processus d'investissement et des activités d'engagement. De plus, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que

les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Microsoft Corp	Technologies de l'information	8,82	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	7,68	États-Unis
Visa Inc	Technologies de l'information	6,00	États-Unis
Aon PLC	Finance	5,56	États-Unis
Accenture PLC	Technologies de l'information	5,41	États-Unis
Fidelity National Information Services Inc	Technologies de l'information	4,59	États-Unis
Danaher Corp	Soins de santé	4,54	États-Unis
Amphenol Corp	Technologies de l'information	4,31	États-Unis
Boston Scientific Corp	Soins de santé	4,07	États-Unis
TJX Cos Inc	Biens de consommation discrétionnaire	4,02	États-Unis
Church & Dwight Co Inc	Biens de consommation courante	3,91	États-Unis
NIKE Inc	Biens de consommation discrétionnaire	3,85	États-Unis
Texas Instruments Inc	Technologies de l'information	3,64	États-Unis
Fortive Corp	Industrie	3,40	États-Unis
Electronic Arts Inc	Services de communication	3,35	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

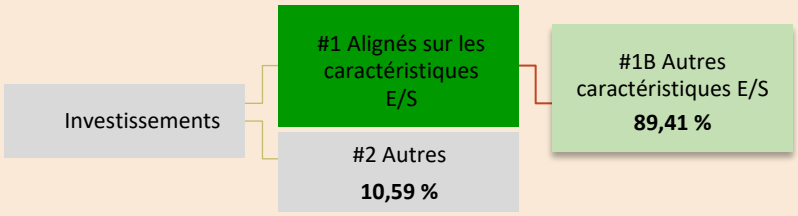
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.S. Concentrated Growth Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 99,25 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.S. Concentrated Growth Fund ; les investissements restants (0,75 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 90,08 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.S. Concentrated Growth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 89,41 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 10,59 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Technologies de l'information	35,74
Soins de santé	14,64
Biens de consommation discrétionnaire	13,17
Services de communication	11,62
Finance	8,46
Biens de consommation courante	6,72
Industrie	5,60
Immobilier	3,26
Liquidités et instruments assimilés	0,80

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

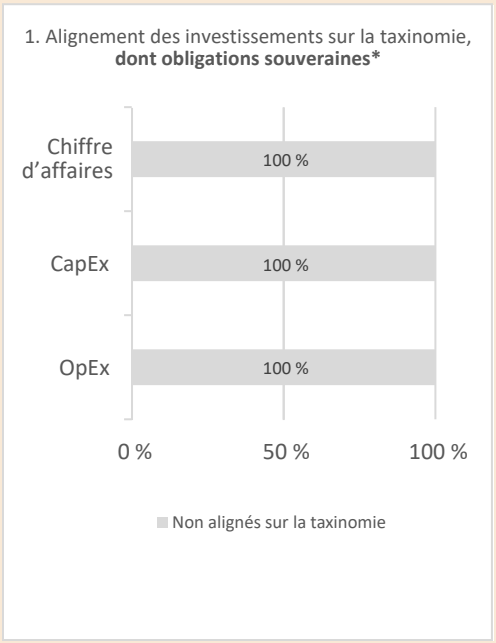
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

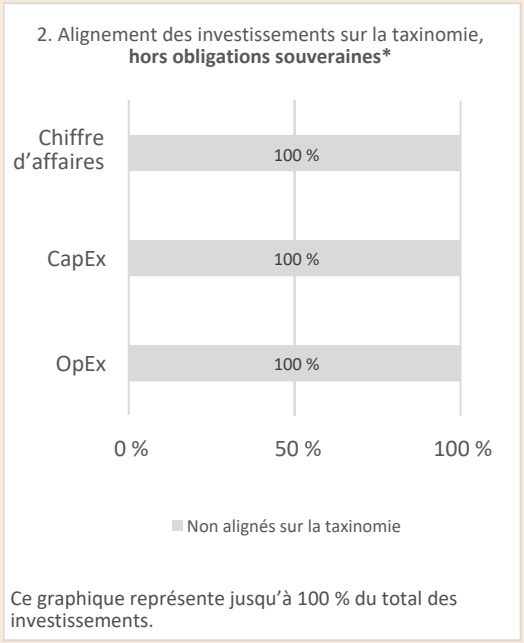
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS U.S. Concentrated Growth Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements - MFS U.S. Concentrated Growth Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 6 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Accenture, Agilent Technologies, Boston Scientific Corp, Danaher Corp et Xcel Energy. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, l'analyse de scénarios climatiques, le risque de transition, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Charter Communications Inc. et Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE la proposition d'actionnaires liée au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Microsoft.

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.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.S. Corporate Bond Fund **(« MFS U.S. Corporate Bond Fund »)**
Identifiant d'entité juridique : 549300Y6O7X5WMN51U45

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement

☐ **Oui**	☒ **Non**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS U.S. Corporate Bond Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.S. Corporate Bond Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 77,22 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS U.S. Corporate Bond Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 65,93 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 85,38 % de l'actif du MFS U.S. Corporate Bond Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	68,05	58,11
30 novembre 2021	68,17	63,25

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	28,20	24,08
30 novembre 2021	28,51	26,45

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	1,92	1,64
30 novembre 2021	2,21	2,05

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	77,22	65,93
30 novembre 2022	81,39	75,51

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Sans objet.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

Le MFS U.S. Corporate Bond Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.S. Corporate Bond Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et l'**intensité des émissions de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone**, **exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles**, **part de la consommation d'énergies non renouvelables et intensité de la production et de la consommation d'énergie par secteur climatique à fort impact** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales** et **diversité du genre dans les Conseils d'administration**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 ianvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Contrat à terme standardisé à 5 ans sur obligation du Trésor américain, 30 juin 22	Gouvernement	2,78	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 5 ans sur obligation du Trésor américain, 30 septembre 22	Gouvernement	2,29	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 31 mars 23	Gouvernement	2,07	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 30 juin 22	Gouvernement	1,88	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 30 septembre 22	Gouvernement	1,86	États-Unis
Morgan Stanley, FRB, 22 janvier 31	Entreprise	1,71	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 30 décembre 22	Gouvernement	1,60	États-Unis
Goldman Sachs Group Inc, 7 février 30	Entreprise	1,28	États-Unis
Morgan Stanley, FRB, 1er avril 31	Entreprise	1,27	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 20 décembre 22	Gouvernement	1,19	États-Unis
Bon du Trésor américain, 15 avril 25	Gouvernement	1,10	États-Unis
Evergy Inc, 15 septembre 29	Entreprise	1,06	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 22 mars 23	Gouvernement	1,05	États-Unis
Wells Fargo & Co, FRB, 2 mars 33	Entreprise	0,99	États-Unis
Bank of America Corp, FRB, 22 avril 42	Entreprise	0,90	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

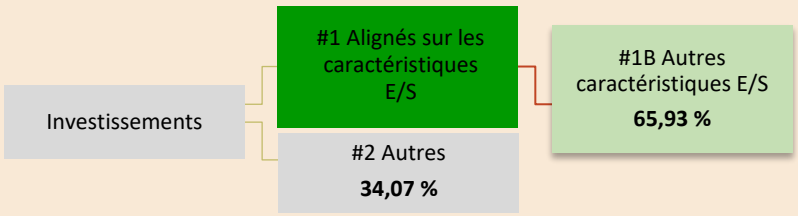
L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Le MFS U.S. Corporate Bond Fund vise à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.S. Corporate Bond Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 85,38 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.S. Corporate Bond Fund ; les investissements restants (4,62 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ;

77,22 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS U.S. Corporate Bond Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 65,93 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 34,07 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Sociétés privées – industrie	50,66
Sociétés privées – établissements financiers	29,92
Sociétés privées – services publics	8,37
Trésor – bons du Trésor	4,05
Liquidités – Liquidités	2,91
Titrisation – obligations de prêts garantis	1,48
Gouvernement – agences gouvernementales	1,14
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	0,80
Gouvernement – titres souverains liés à un État	0,69
Produits dérivés – négociés en bourse	-1,86

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Corporate Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

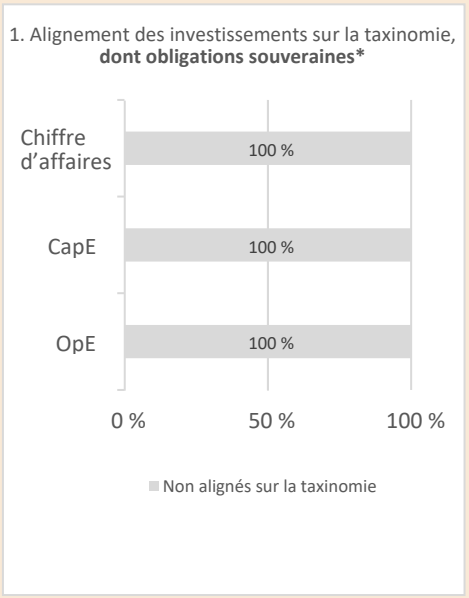
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

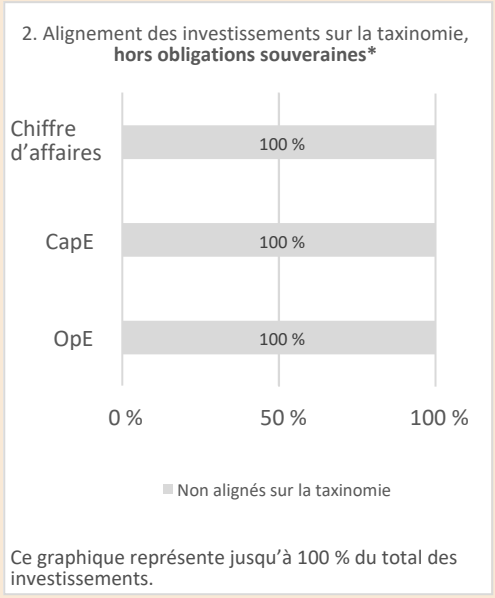
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS U.S. Corporate Bond Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS U.S. Corporate Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Corporate Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de créance d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de produits dérivés, de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS U.S. Corporate Bond Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de créance d'entreprises du MFS U.S. Corporate Bond Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements – MFS U.S. Corporate Bond Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 24 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment American Electric Power, American Homes 4 Rent, Anglo American, Boston Scientific Corp, CenterPoint Energy, Constellation Brands, Danaher Corp, Duke Energy, Enbridge, Enel SpA, Eni

SpA, Glencore, Hilton Worldwide Holdings, Millicom International Cellular, Toronto-Dominion, Vulcan Materials Co et Xcel Energy. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, l'analyse de scénarios climatiques, le risque de transition, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi).

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.S. Growth Fund (« **MFS U.S. Growth Fund** »)
Identifiant d'entité juridique : 549300DUBLFTWOTUSY90

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS U.S. Growth Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.S. Growth Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 84,52 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.S. Growth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 82,80 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 97,96 % de l'actif du MFS U.S. Growth Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	63,55	62,25
30 novembre 2021	53,80	52,84

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	70,68	69,24
30 novembre 2021	62,0	60,94

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	84,52	82,80
30 novembre 2021	78,42	77,03

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Sans objet.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

Le MFS U.S. Growth Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.S. Growth Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et l'**intensité des émissions de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone**, **exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles**, **part de la consommation d'énergies non renouvelables et intensité de la production et de la consommation d'énergie par secteur climatique à fort impact** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales** et **diversité du genre dans les Conseils d'administration**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs

des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Microsoft Corp	Technologies de l'information	9,77	États-Unis
Amazon.com Inc	Biens de consommation discrétionnaire	6,86	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	5,83	États-Unis
Apple Inc	Technologies de l'information	5,21	États-Unis
Mastercard Inc	Technologies de l'information	3,63	États-Unis
Visa Inc	Technologies de l'information	3,07	États-Unis
Adobe Inc	Technologies de l'information	2,81	États-Unis
Danaher Corp	Soins de santé	2,54	États-Unis
Intuit Inc	Technologies de l'information	2,46	États-Unis
Thermo Fisher Scientific Inc	Soins de santé	2,33	États-Unis
NVIDIA Corp	Technologies de l'information	2,23	États-Unis
Abbott Laboratories	Soins de santé	1,90	États-Unis
MSCI Inc	Finance	1,90	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie C	Services de communication	1,85	États-Unis
Boston Scientific Corp	Soins de santé	1,68	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

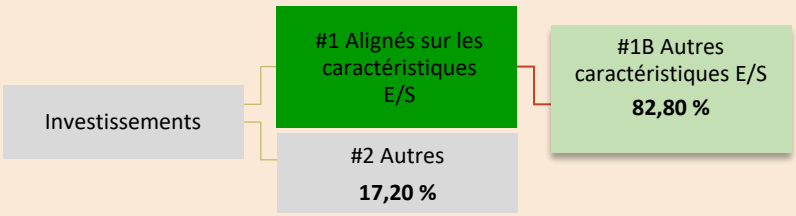
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Le MFS U.S. Growth Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.S. Growth Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 97,96 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.S. Growth Fund ; les investissements restants (2,04 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 84,52 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.S. Growth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 82,80 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 17,20 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Technologies de l'information	37,19
Soins de santé	15,47
Services de communication	11,06
Biens de consommation discrétionnaire	10,69
Industrie	7,35
Finance	6,72
Matériaux	3,87
Liquidités et instruments assimilés	2,91
Biens de consommation courante	2,64
Immobilier	1,25
Énergie	0,84

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

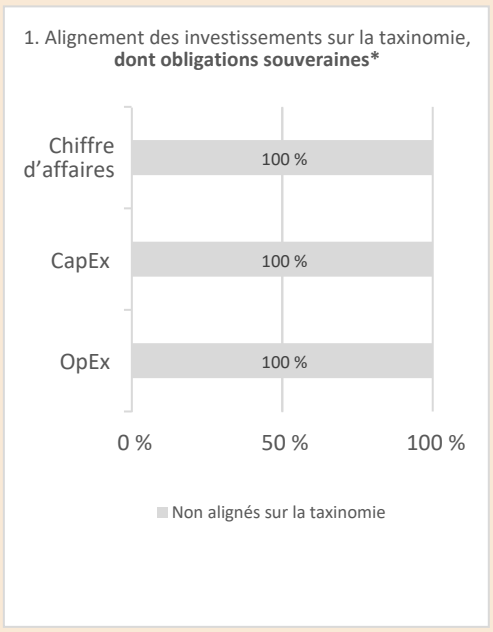
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

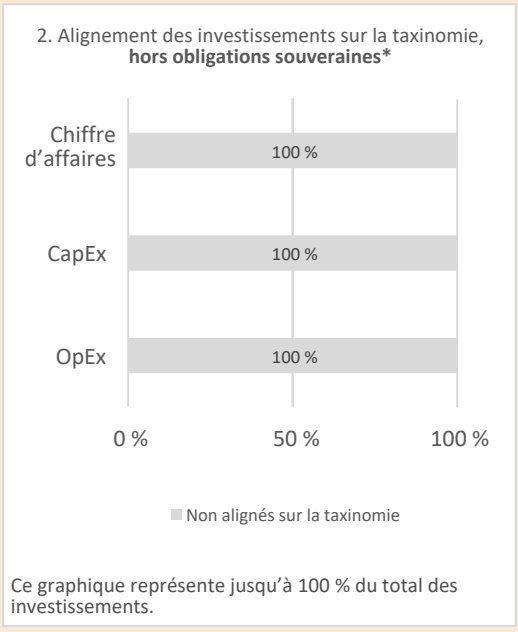
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS U.S. Growth Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





Ce graphique représente jusqu'à 100 % du total des investissements.

** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS U.S. Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS U.S. Growth Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS U.S. Growth Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS U.S. Growth Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 11 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment Accenture, Agilent Technologies, Boston Scientific Corp, Colgate Palmolive, Danaher Corp, EOG Resources Inc, Hilton Worldwide Holdings, Take-Two Interactive Software et Vulcan Materials Co. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR une proposition de la direction sur les plans de transition climatique de l'émetteur suivant : Canadian Pacific Railway Limited. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Charter Communications Inc. et Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Amazon et Microsoft.

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.

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.S. Total Return Bond Fund **(« MFS U.S. Total Return Bond Fund ») Identifiant d'entité juridique :** YJVUBFZW5FW4FOTQBP86

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement

☐ Oui	☒ No
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 21 juillet 2022, le MFS U.S. Total Return Bond Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.S. Total Return Bond Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 73,20 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS U.S. Total Return Bond Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 31,43 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 42,94 % de l'actif du MFS U.S. Total Return Bond Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 21 juillet 2022 au 31 janvier 2023.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	66,58	28,59
30 juin 2022	70,64	26,86

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	19,96	8,57
30 juin 2022	19,87	7,56

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	0	0
30 juin 2022	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	1,07	0,46
30 juin 2022	1,59	0,60

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	**% des titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères**	**% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère**
31 janvier 2023	73,20	31,42
30 juin 2022	75,54	28,72

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Sans objet.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

Le MFS U.S. Total Return Bond Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.S. Total Return Bond Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et l'**intensité des émissions de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone**, **exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles**, **part de la consommation d'énergies non renouvelables et intensité de la production et de la consommation d'énergie par secteur climatique à fort impact** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales** et **diversité du genre dans les Conseils d'administration**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 21 juillet 2022 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Bon du Trésor américain, 31 mars 24	Gouvernement	5,30 %	États-Unis
Bon du Trésor américain, 31 décembre 23	Gouvernement	4,05 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 30 juin 22	Gouvernement	2,18 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 30 septembre 22	Gouvernement	1,58 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 5 ans sur obligation du Trésor américain, 30 décembre 22	Gouvernement	1,47 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 5 ans sur obligation du Trésor américain, 31 mars 23	Gouvernement	1,47 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 21 juin 22	Gouvernement	1,39 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 22 mars 23	Gouvernement	1,39 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 21 septembre 22	Gouvernement	1,23 %	États-Unis
Bon du Trésor américain, 31 mars 27	Gouvernement	1,16 %	États-Unis
Obligation du Trésor américain, 15 novembre 50	Gouvernement	1,14 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 20 décembre 22	Gouvernement	1,10 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 5 ans sur obligation du Trésor américain, 30 septembre 22	Gouvernement	1,04 %	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 30 décembre 22	Gouvernement	1,02 %	États-Unis
Bon du Trésor américain, 30 septembre 24	Gouvernement	1,00 %	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

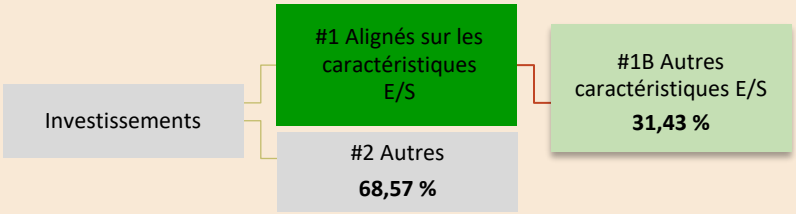
L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Le MFS U.S. Total Return Bond Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.S. Total Return Bond Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 42,94 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.S. Total Return Bond Fund ; les investissements restants (57,06 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités

et/ou des instruments assimilés ; 73,20 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS U.S. Total Return Bond Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 31,43 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 68,57 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Sociétés privées – industrie	22,00
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires avec flux identiques	19,48
Bons du Trésor	17,34
Sociétés privées – établissements financiers	14,88
Produits dérivés – négociés en bourse	11,61
Sociétés privées – services publics	2,46
Titrisation – obligations de prêts garantis	9,20
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires commerciales	7,63
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	1,92
Titrisation – titres adossés à des actifs	1,39
Liquidités	1,39
Obligations municipales – obligations locales	0,97
Titrisation – obligation hypothécaire garantie	0,92
Obligations municipales – santé	0,27
Gouvernement – agences gouvernementales	0,16

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les Activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Total Return Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

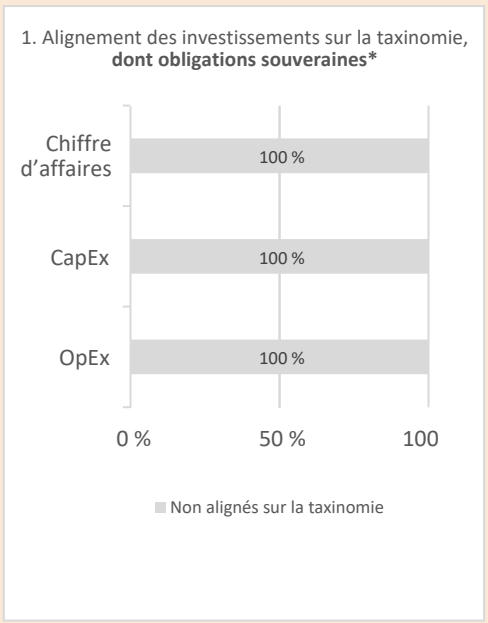
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

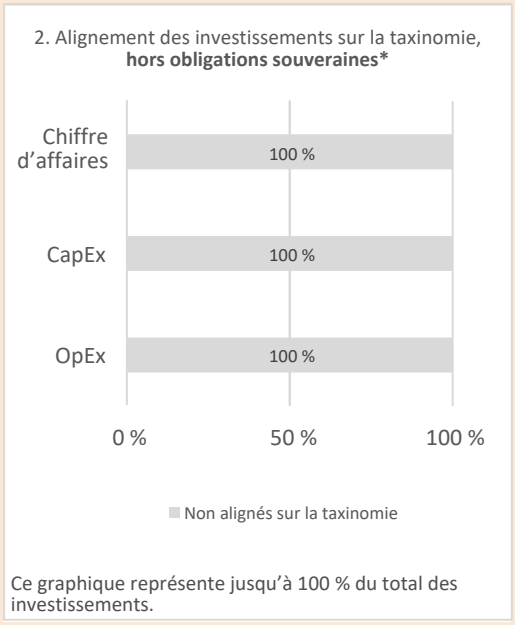
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS U.S. Total Return Bond Fund n'investit pas dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS U.S. Total Return Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Sans objet.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Total Return Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de produits dérivés, de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS U.S. Total Return Bond Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de créance d'entreprises du MFS U.S. Total Return Bond Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements - MFS U.S. Total Return Bond Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 3 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment American Electric Power, Enel SpA et Glencore. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi).

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.S. Value Fund (« **MFS U.S. Value Fund** »)
Identifiant d'entité juridique : GB1O5HOU4PVHR7NT1O15

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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 d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement

☐ **Oui**	☒ **No**
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental :**_____%	☐ Il **promeut les caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif un investissement durable, il contiendra une proportion minimale de_____% d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social :**____%	☒ Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS U.S. Value Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.S. Value Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 85,30 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.S. Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 84,46 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,02 % de l'actif du MFS U.S. Value Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	72,73	72,02
30 novembre 2021	83,44	82,39

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	48,95	48,47
30 novembre 2021	37,20	36,74

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2023	85,03	84,46
30 novembre 2021	92,34	91,17

… et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Sans objet.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Sans objet.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important à un quelconque objectif environnemental ou social.

Le MFS U.S. Value Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), afin de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.S. Value Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et l'**intensité des émissions de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone**, **exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles**, **part de la consommation d'énergies non renouvelables et intensité de la production et de la consommation d'énergie par secteur climatique à fort impact** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales** et **diversité du genre dans les Conseils d'administration**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative

du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 31 décembre 2021 au 31 janvier 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
JPMorgan Chase & Co	Finance	3,55	États-Unis
Johnson & Johnson	Soins de santé	3,41	États-Unis
Northrop Grumman Corp	Industrie	2,86	États-Unis
Cigna Corp	Soins de santé	2,62	États-Unis
Aon PLC	Finance	2,53	États-Unis
Pfizer Inc	Soins de santé	2,52	États-Unis
Texas Instruments Inc	Technologies de l'information	2,40	États-Unis
Marsh & McLennan Cos Inc	Finance	2,29	États-Unis
Comcast Corp	Services de communication	2,25	États-Unis
Chubb Ltd	Finance	2,25	États-Unis
Honeywell International Inc	Industrie	2,23	États-Unis
Progressive Corp	Finance	2,20	États-Unis
Duke Energy Corp	Services publics	2,16	États-Unis
Accenture PLC	Technologies de l'information	2,08	États-Unis
Thermo Fisher Scientific Inc	Soins de santé	2,02	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

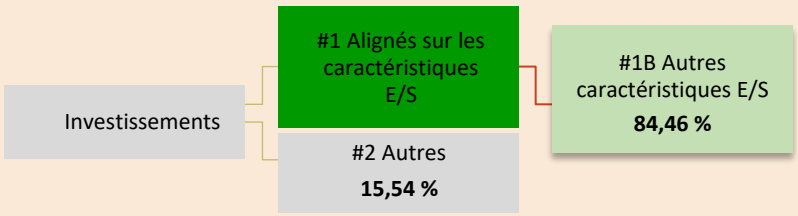
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS U.S. Value Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.S. Value Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition.

Quelle était l'allocation des actifs ?

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Au 31 janvier 2023, les titres de participation représentaient 99,02 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.S. Value Fund ; les investissements restants (0,8 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 85,30 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.S. Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 84,46 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 15,54 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Finance	25,84
Soins de santé	19,19
Industrie	17,93
Technologies de l'information	7,23
Services publics	6,96
Biens de consommation courante	6,10
Matériaux	4,10
Énergie	4,07
Biens de consommation discrétionnaire	3,56
Services de communication	3,22
Liquidités et instruments assimilés	1,07
Immobilier	0,72

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier 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 investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2022, 30 juin 2022, 30 septembre 2022 et 31 décembre 2022. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

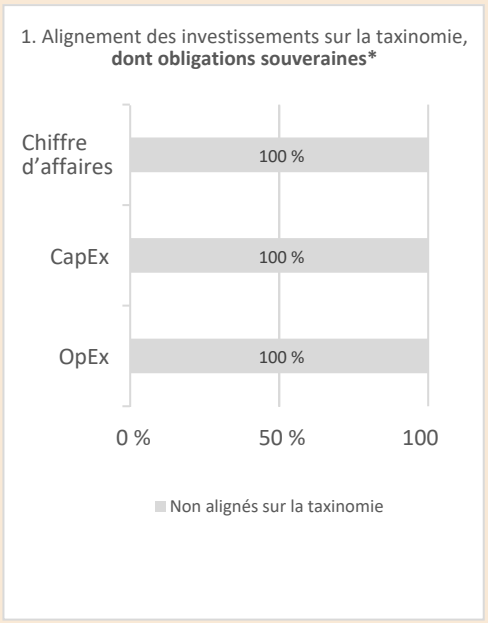
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

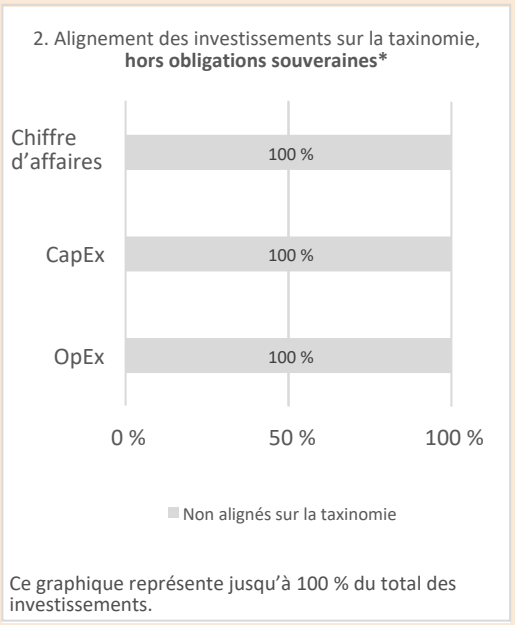
☐ Oui :

☐ Dans les combustibles fossiles ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non. Le MFS U.S. Value Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*





** Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.*

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS U.S. Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Sans objet.

sont des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif social ?

Sans objet.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés, ainsi que de produits dérivés de change.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS U.S. Value Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Assets Managers (« NZAM ») – en 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative Net Zero Asset Managers. À compter de 2022, 90 % du total des actifs sous gestion de MFS seront considérés comme participant à cette initiative, y compris les investissements dans des titres de participation du MFS U.S. Value Fund.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

L'approche de MFS repose sur la conviction que s'engager auprès des sociétés dans lesquelles le produit a investi dans tous les secteurs en faveur d'une transition qui soit cohérente avec la décarbonisation de l'économie mondiale réduira les risques financiers globaux liés au climat dans les portefeuilles d'investissement de nos clients. Nous sommes convaincus que cette approche contribuera à insuffler un changement positif, qu'elle est dans l'intérêt des clients et qu'elle est alignée sur notre objectif consistant à créer de la valeur à long terme de manière responsable.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate-related Financial Disclosures, « TCFD ») – MFS est devenu signataire en 2019. En 2022, MFS a produit son premier rapport annuel conformément aux recommandations de la TCFD. Ce rapport démontre les progrès que nous avons accomplis dans l'intégration de la sensibilisation aux risques climatiques à nos opérations commerciales et à notre stratégie d'investissement. Le rapport est disponible dans son intégralité sur www.mfs.com.

Lettre sur le climat de MFS – MFS a écrit à 700 émetteurs qui représentent nos participations en portefeuille les plus importantes et les plus émettrices. Cette lettre insistait sur le soutien de MFS à l'Accord de Paris et sur l'objectif de limiter les augmentations de température à moins de 1,5 °C par rapport aux niveaux préindustriels. MFS demandait à ces émetteurs de divulguer leurs données liées au carbone et connexes, de planifier des stratégies pour réduire leur impact et de mettre en œuvre ces stratégies à court et moyen termes.

Groupe de travail sur le climat de MFS – MFS a constitué un groupe de travail interne dédié au climat dans le but de mobiliser les professionnels de l'investissement de MFS au sens large sur le changement climatique et l'impact environnemental au sein du processus d'investissement de MFS et de l'activité d'engagement de la société. Les activités récentes au cours de la période sous revue comprennent les éléments suivants : développement d'un cadre climatique interne aligné sur l'Accord de Paris, dans la totalité des secteurs, des régions et des classes d'actifs ; intégration continue de la prise en compte du climat et des processus afférents à l'échelle de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS ; collaboration en externe avec des groupes tels que NZAM, Action pour le Climat 100+ et d'autres initiatives.

Engagements et vote par procuration - MFS U.S. Value Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 21 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille sur les risques et opportunités liés au climat, notamment Accenture, American Electric Power, Archer Daniels Midland, Boston Scientific Corp, Chubb Ltd, Citigroup, ConocoPhilips, Danaher Corp, Duke Energy, EOG Resources Inc, Kimberly-Clark, Lowe's Cos Inc, McKesson Corp, PPG Industries, Union Pacific Corp et Xcel Energy. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, l'analyse de scénarios climatiques, ainsi que les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR une proposition de la direction sur les plans de transition climatique de l'émetteur suivant : Canadian Pacific Railway Limited. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Honeywell International Inc et Charter Communications Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Comcast Corp.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :
hiips://www.mfs.com/content/mfs -enterprise/microsites/fcp/global/en/mfs-fcp-funds.html