



PIMCO CANADA CORP.

# Rapport annuel

31 décembre 2023

Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO

Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)

Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)

Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada)

Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)

Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)

Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence

Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base

Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)

Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)

Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)



Vous pouvez obtenir un exemplaire du Rapport de la direction sur le rendement du Fonds sur demande et sans frais en composant le 1 866 341-3350 ou en nous écrivant à PIMCO Canada Corp. 199, rue Bay, bureau 2050, succursale Commerce Court Station, C. P. 363, Toronto (Ontario) Canada M5L 1G2. Vous pouvez aussi l'obtenir sur notre site au [www.pimco.ca](http://www.pimco.ca) ou sur SEDAR+ au [www.sedarplus.ca](http://www.sedarplus.ca).



	Page
Responsabilité de la direction à l'égard de l'information financière	1
Rapport de l'auditeur indépendant	2
Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO	
États de la situation financière	4
États du résultat global	5
États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6
Tableaux des flux de trésorerie	7
Inventaire du portefeuille	8
Notes annexes propres au Fonds	16
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)	
États de la situation financière	23
États du résultat global	24
États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	25
Tableaux des flux de trésorerie	26
Inventaire du portefeuille	27
Notes annexes propres au Fonds	41
Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)	
États de la situation financière	50
États du résultat global	52
États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	54
Tableaux des flux de trésorerie	56
Inventaire du portefeuille	57
Notes annexes propres au Fonds	66
Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada)	
États de la situation financière	74
États du résultat global	76
États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	78
Tableaux des flux de trésorerie	80
Inventaire du portefeuille	81
Notes annexes propres au Fonds	93
Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)	
États de la situation financière	102
États du résultat global	103
États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	104
Tableaux des flux de trésorerie	105
Inventaire du portefeuille	106
Notes annexes propres au Fonds	112
Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)	
États de la situation financière	119
États du résultat global	121
États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	122

	Page
Tableaux des flux de trésorerie	124
Inventaire du portefeuille	125
Notes annexes propres au Fonds	135
Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence	
États de la situation financière	144
États du résultat global	145
États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	146
Tableaux des flux de trésorerie	147
Inventaire du portefeuille	148
Notes annexes propres au Fonds	149
Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base	
États de la situation financière	153
États du résultat global	154
États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	155
Tableaux des flux de trésorerie	156
Inventaire du portefeuille	157
Notes annexes propres au Fonds	158
Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)	
États de la situation financière	163
États du résultat global	164
États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	165
Tableaux des flux de trésorerie	166
Inventaire du portefeuille	167
Notes annexes propres au Fonds	172
Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)	
États de la situation financière	179
États du résultat global	180
États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	181
Tableaux des flux de trésorerie	182
Inventaire du portefeuille	183
Notes annexes propres au Fonds	190
Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)	
États de la situation financière	197
États du résultat global	198
États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	199
Tableaux des flux de trésorerie	200
Inventaire du portefeuille	201
Notes annexes propres au Fonds	209
Notes annexes	217
Glossaire	234
Informations générales	235

Les états financiers ci-joints des Fonds (défini à la note 1 des états financiers) ont été préparés par PIMCO Canada Corp. (le « gestionnaire »). Le gestionnaire des Fonds est responsable de l'information et des déclarations contenues dans les présents états financiers.

Le gestionnaire maintient des processus adéquats pour s'assurer que les informations financières publiées sont pertinentes et fiables. Les états financiers ont été préparés conformément aux normes IFRS de comptabilité et ils comprennent certains montants fondés sur des estimations et des jugements formulés par le gestionnaire. Les méthodes comptables significatives que la direction estime appropriées pour les Fonds sont énoncées à la note 3 des états financiers.

PricewaterhouseCoopers s.r.l./s.e.n.c.r.l. est l'auditeur externe des Fonds. Son rapport est présenté ci-après. Son audit des états financiers a été effectué conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada de manière à lui permettre d'exprimer une opinion sur les états financiers à l'intention des porteurs de parts.



Stuart Graham  
Président, en qualité de chef de la direction  
PIMCO Canada Corp.

# Rapport de l'auditeur indépendant

---

Aux porteurs de parts et au fiduciaire de  
Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO  
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)  
Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)  
Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada)  
Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)  
Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)  
Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence  
Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base  
Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)  
Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)  
Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)  
(individuellement, le « Fonds »)

## Notre opinion

À notre avis, les états financiers ci-joints de chaque Fonds donnent, dans tous leurs aspects significatifs, une image fidèle de la situation financière de chaque Fonds aux 31 décembre 2023 et 2022, ainsi que de sa performance financière et de ses flux de trésorerie pour les exercices clos à ces dates, conformément aux Normes internationales d'information financière publiées par l'International Accounting Standards Board (normes IFRS de comptabilité).

## Notre audit

Nous avons effectué l'audit des états financiers de chaque Fonds, qui comprennent :

- les états de la situation financière aux 31 décembre 2023 et 2022;
- les états du résultat global pour les exercices clos à ces dates;
- les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les exercices clos à ces dates;
- les tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos à ces dates;
- les notes annexes, qui comprennent les informations significatives sur les méthodes comptables et d'autres informations explicatives.

## Fondement de l'opinion

Nous avons effectué notre audit conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada. Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces normes sont plus amplement décrites dans la section *Responsabilités de l'auditeur à l'égard de l'audit des états financiers* de notre rapport.

Nous estimons que les éléments probants que nous avons obtenus sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

## Indépendance

Nous sommes indépendants de chaque Fonds conformément aux règles de déontologie qui s'appliquent à notre audit des états financiers au Canada, et nous nous sommes acquittés des autres responsabilités déontologiques qui nous incombent selon ces règles.

## Autres informations

La responsabilité des autres informations de chaque Fonds incombe à la direction. Les autres informations se composent du rapport annuel de la direction sur le rendement du Fonds de chaque Fonds.

Notre opinion sur les états financiers ne s'étend pas aux autres informations et nous n'exprimons aucune forme d'assurance que ce soit sur ces informations.

En ce qui concerne notre audit des états financiers de chaque Fonds, notre responsabilité consiste à lire les autres informations désignées ci-dessus et, ce faisant, à apprécier s'il existe une incohérence significative entre celles-ci et les états financiers de chaque Fonds ou la connaissance que nous avons acquise au cours de l'audit, ou encore si les autres informations semblent autrement comporter une anomalie significative.

Si, à la lumière des travaux que nous avons effectués, nous concluons à la présence d'une anomalie significative dans les autres informations, nous sommes tenus de signaler ce fait. Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

## Responsabilités de la direction et des responsables de la gouvernance à l'égard des états financiers

La direction est responsable de la préparation et de la présentation fidèle des états financiers de chaque Fonds conformément aux normes IFRS de comptabilité, ainsi que du contrôle interne qu'elle considère comme nécessaire pour permettre la préparation d'états financiers exempts d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs.

Lors de la préparation des états financiers, c'est à la direction qu'il incombe d'évaluer la capacité de chaque Fonds à poursuivre ses activités, de communiquer, le cas échéant, les questions relatives à la continuité de l'exploitation et d'appliquer le principe comptable de continuité d'exploitation, sauf si la direction a l'intention de liquider l'un des Fonds ou de cesser ses activités, ou si elle n'a aucune autre solution réaliste que de le faire.

Il incombe aux responsables de la gouvernance de surveiller le processus d'information financière de chaque Fonds.

### Responsabilités de l'auditeur à l'égard de l'audit des états financiers

Nos objectifs sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers de chaque Fonds, pris dans leur ensemble, sont exempts d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, et de délivrer un rapport de l'auditeur contenant notre opinion. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, qui ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada permettra toujours de détecter toute anomalie significative qui pourrait exister. Les anomalies peuvent résulter de fraudes ou d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, individuellement ou collectivement, elles puissent influencer sur les décisions économiques que les utilisateurs des états financiers de chaque Fonds prennent en se fondant sur ceux-ci.

Dans le cadre d'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada, nous exerçons notre jugement professionnel et faisons preuve d'esprit critique tout au long du processus. En outre :

- nous identifions et évaluons les risques que les états financiers de chaque Fonds comportent des anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion. Le risque de non-détection d'une anomalie significative résultant d'une fraude est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, les omissions volontaires, les fausses déclarations ou le contournement du contrôle interne;
- nous acquérons une compréhension des éléments du contrôle interne pertinents pour l'audit afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne de chaque Fonds;
- nous apprécions le caractère approprié des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables faites par la direction, de même que des informations y afférentes fournies par cette dernière;
- nous tirons une conclusion quant au caractère approprié de l'utilisation par la direction du principe comptable de continuité d'exploitation et, selon les éléments probants obtenus, quant à l'existence ou non d'une incertitude significative liée à des événements ou situations susceptibles de jeter un doute important sur la capacité de chaque Fonds à poursuivre ses activités. Si nous concluons à l'existence d'une incertitude significative, nous sommes tenus d'attirer l'attention des lecteurs de notre rapport sur les informations fournies dans les états financiers de chaque Fonds au sujet de cette incertitude ou, si ces informations ne sont pas adéquates, d'exprimer une opinion modifiée. Nos conclusions s'appuient sur les éléments probants obtenus jusqu'à la date de notre rapport. Des événements ou situations futurs pourraient par ailleurs amener l'un des Fonds à cesser ses activités;
- nous évaluons la présentation d'ensemble, la structure et le contenu des états financiers de chaque Fonds, y compris les informations fournies dans les notes, et apprécions si les états financiers représentent les opérations et événements sous-jacents d'une manière propre à donner une image fidèle.

Nous communiquons aux responsables de la gouvernance, entre autres informations, l'étendue et le calendrier prévus des travaux d'audit et nos constatations importantes, y compris toute déficience importante du contrôle interne que nous aurions relevée au cours de notre audit.

Nous fournissons également aux responsables de la gouvernance une déclaration précisant que nous nous sommes conformés aux règles de déontologie pertinentes concernant l'indépendance, et leur communiquons toutes les relations et les autres facteurs qui peuvent raisonnablement être considérés comme susceptibles d'avoir des incidences sur notre indépendance ainsi que les sauvegardes connexes, s'il y a lieu.

L'associée responsable de la mission d'audit au terme de laquelle le présent rapport de l'auditeur indépendant est délivré est Patrizia Ferrari.

PricewaterhouseCoopers s.r.l./s.e.n.c.r.l.



Toronto (Ontario)  
Le 14 mars 2024

## États de la situation financière Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
<b>Actif :</b>		
Actif courant :		
<i>Placements, à la juste valeur</i>		
Placements dans des titres <sup>†</sup>	488 847 \$	622 595 \$
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	230	128
Hors cote	4 089	283
Trésorerie	4 047	2 104
Dépôts auprès de contreparties	5 565	9 433
Devises	561	1 243
Montants à recevoir pour les placements vendus	20 063	2 221
Montants à recevoir pour les parts vendues	546	1 035
Intérêts et dividendes à recevoir	3 108	3 835
Autres actifs	6	0
	527 062	642 877
<b>Passif :</b>		
Passif courant :		
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	156	497
Hors cote	176	5 831
Achats de placements à payer	17 719	2 189
Dépôts de contreparties	437	396
Montants à payer pour les parts rachetées	11 883	21
Frais de gestion à payer	15	18
	30 386	8 952
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>496 676 \$</b>	<b>633 925 \$</b>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A	3 960 \$	3 769 \$
Nombre de parts rachetables - série A	403	398
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	9,82 \$	9,47 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F	12 788 \$	14 642 \$
Nombre de parts rachetables - série F	1 295	1 536
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	9,87 \$	9,53 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I	470 795 \$	605 844 \$
Nombre de parts rachetables - série I	48 530	64 570
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	9,70 \$	9,38 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série M	6 072 \$	6 989 \$
Nombre de parts rachetables - série M	623	741
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série M	9,75 \$	9,43 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série O	3 061 \$	2 681 \$
Nombre de parts rachetables - série O	312	283
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série O	9,82 \$	9,47 \$
<sup>†</sup> Comprend les prises en pension de :	358 \$	45 710 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

# États du résultat global Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	Exercice clos le 31 décembre 2023	Exercice clos le 31 décembre 2022
<b>Revenus :</b>		
<b>Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés</b>		
Intérêts à distribuer	26 353 \$	20 779 \$
Revenu (perte) sur instruments dérivés	(473)	150
Gain (perte) net réalisé à la vente de placements	(12 001)	(30 862)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(4 786)	(8 945)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés hors cote	(4 519)	(8 578)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements en portefeuille	26 720	(56 622)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	5 681	(5 099)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés hors cote	9 473	(2 908)
Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés	46 448	(92 085)
<b>Autres revenus (pertes)</b>		
Produits divers	1	0
Gain (perte) net réalisé sur opérations en devises	(1 772)	(748)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente à la conversion des actifs et des passifs libellés en devises	62	4
Autres revenus (pertes)	(1 709)	(744)
Total - Revenus (pertes)	44 739	(92 829)
<b>Charges :</b>		
Frais de gestion	170	371
Frais liés au CEI	3	3
Charges d'intérêts	46	16
Coûts de transaction	49	30
Frais juridiques	0	6
Total - Charges	268	426
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>44 471 \$</b>	<b>(93 255)\$</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série</b>		
Série A	263 \$	(738) \$
Série F	1 013	(4 312)
Série I	42 502	(82 230)
Série M	483	(5 327)
Série O	210	(648)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part</b>		
Série A	0,66 \$	(1,65)\$
Série F	0,75	(1,77)
Série I	0,71	(1,37)
Série M	0,83	(1,84)
Série O	0,71	(1,83)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO

(en milliers\*)

	Exercice clos le 31 décembre 2023					
	Série A	Série F	Série I	Série M	Série O	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	3 769 \$	14 642 \$	605 844 \$	6 989 \$	2 681 \$	633 925 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	263	1 013	42 502	483	210	44 471
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>						
Provenant du revenu net de placement	(133)	(527)	(26 267)	(230)	(99)	(27 256)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(133)	(527)	(26 267)	(230)	(99)	(27 256)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>						
Produit de la vente de parts rachetables	834	3 046	240 059	1 821	401	246 161
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	100	358	26 267	129	70	26 924
Coût des parts rachetables rachetées	(873)	(5 744)	(417 610)	(3 120)	(202)	(427 549)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	61	(2 340)	(151 284)	(1 170)	269	(154 464)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	191	(1 854)	(135 049)	(917)	380	(137 249)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	3 960 \$	12 788 \$	470 795 \$	6 072 \$	3 061 \$	496 676 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Parts rachetables vendues	87	315	25 753	192	43	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	10	37	2 783	14	7	S.O.
Parts rachetables rachetées	(92)	(593)	(44 576)	(324)	(21)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	5	(241)	(16 040)	(118)	29	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	398	1 536	64 570	741	283	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	403	1 295	48 530	623	312	S.O.

	Exercice clos le 31 décembre 2022					
	Série A	Série F	Série I	Série M	Série O	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	6 332 \$	58 983 \$	707 937 \$	8 287 \$	4 752 \$	786 291 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(738)	(4 312)	(82 230)	(5 327)	(648)	(93 255)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>						
Provenant du revenu net de placement	(85)	(622)	(17 980)	(715)	(69)	(19 471)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(85)	(622)	(17 980)	(715)	(69)	(19 471)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>						
Produit de la vente de parts rachetables	922	22 488	305 362	63 535	996	393 303
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	65	502	17 980	616	49	19 212
Coût des parts rachetables rachetées	(2 727)	(62 397)	(325 225)	(59 407)	(2 399)	(452 155)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(1 740)	(39 407)	(1 883)	4 744	(1 354)	(39 640)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(2 563)	(44 341)	(102 093)	(1 298)	(2 071)	(152 366)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	3 769 \$	14 642 \$	605 844 \$	6 989 \$	2 681 \$	633 925 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Parts rachetables vendues	93	2 264	31 243	6 154	94	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	7	51	1 862	63	5	S.O.
Parts rachetables rachetées	(270)	(6 019)	(32 625)	(6 217)	(242)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(170)	(3 704)	480	0	(143)	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	568	5 240	64 090	741	426	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	398	1 536	64 570	741	283	S.O.

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## Tableaux des flux de trésorerie Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO

(en milliers*)	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	44 471 \$	(93 255)\$
<b>Ajustements au titre du rapprochement de l'augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et des entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation :</b>		
Achats de titres	(5 183 498)	(3 605 622)
Produit de la vente de placements	5 332 833	3 670 809
(Augmentation) diminution des dépôts auprès de contreparties	3 868	(1 819)
(Augmentation) diminution des montants à recevoir au titre du revenu provenant de swaps	0	1
(Augmentation) diminution des intérêts et des dividendes à recevoir	727	(53)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	452	(13 343)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés hors cote	(4 507)	(8 723)
(Augmentation) diminution des autres actifs	(6)	0
Augmentation (diminution) des dépôts de contreparties	41	(521)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(3)	(14)
Produit des opérations de vente à découvert	98 617	68 288
Paiements au titre des opérations de vente à découvert	(98 617)	(68 288)
Produit (paiements) au titre des opérations en devises	(1 712)	(753)
<i>(Gain) perte nette réalisée</i>		
Placements	12 001	30 862
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	4 786	8 945
Instruments financiers dérivés hors cote	4 519	8 578
Opérations en devises	1 772	748
<i>Variation nette de la (plus-value) moins-value latente</i>		
Placements	(26 720)	56 622
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(5 681)	5 099
Instruments financiers dérivés hors cote	(9 473)	2 908
Conversion de passifs et d'actifs libellés en devises	(62)	(4)
Amortissement net des primes (des escomptes) sur les placements	(3 180)	(223)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation</b>	<b>170 628</b>	<b>60 242</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement :</b>		
Produit de la vente de parts rachetables**	171 296	322 088
Montant payé au titre du rachat de parts rachetables**	(340 333)	(382 301)
Distributions en trésorerie versées aux porteurs de parts rachetables	(332)	(259)
Produit des accords cadres sur transactions à livrer	0	25 794
Paiements au titre des accords cadres sur transactions à livrer	0	(25 794)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement</b>	<b>(169 369)</b>	<b>(60 472)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des devises</b>	<b>1 259</b>	<b>(230)</b>
<b>Trésorerie (découvert) et devises :</b>		
Ouverture de l'exercice	3 347	3 568
Gain (perte) de change sur la trésorerie	2	9
Clôture de l'exercice	4 608 \$	3 347 \$
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie :</b>		
Intérêts payés liés aux activités de financement	46 \$	16 \$
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	23 872 \$	20 513 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

\*\* Ne comprend pas les transferts hors trésorerie entre les séries.

# Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO

(en milliers\*, sauf le nombre d'actions, de contrats, de parts ou d'onces, selon le cas)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES 98,4 %</b>				<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 0,2 %</b>			
<b>AUSTRALIE 0,7 %</b>				<b>Fairstone Financial Issuance Trust</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,7 %</b>				2,509 %, échéant le 20 oct. 2039			
Macquarie Group Ltd.	3 900 \$	3 901 \$	3 503 \$	873 \$	873 \$	849 \$	
2,723 %, échéant le 21 août 2029							
Total - Australie		3 901	3 503				
<b>CANADA 54,7 %</b>				<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 15,1 %</b>			
<b>TITRES DU GOUVERNEMENT FÉDÉRAL 11,7 %</b>				<b>Air Canada Pass-Through Trust</b>			
<b>Obligation du gouvernement du Canada</b>				5,250 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2030			
1,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2031	28 700 \$	24 231	25 481	623 USD	820	810	
1,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2053	13 700	9 681	10 296				
2,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2033	5 700	5 440	5 774				
2,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2055	4 000	3 281	3 772				
2,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2064	2 900	3 693	2 752				
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2045	800	802	854				
<b>Fiducie du Canada pour l'habitation</b>				<b>Banque de Montréal</b>			
4,150 %, échéant le 15 juin 2033	2 400	2 323	2 525	3,190 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2028	2 800 \$	2 670	2 703
4,250 %, échéant le 15 mars 2034	6 500	6 496	6 901	4,309 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2027	1 900	1 892	1 890
		55 947	58 355				
<b>TITRES DES PROVINCES 27,5 %</b>				<b>La Banque de Nouvelle-Écosse</b>			
<b>Ville de Montréal (Canada)</b>				1,850 %, échéant le 2 nov. 2026			
2,300 %, échéant le 1 <sup>er</sup> sept. 2029	700	696	651	7 000	6 906	6 533	
<b>Ville d'Ottawa (Ontario)</b>				<b>La Compagnie de téléphone Bell du Canada</b>			
3,250 %, échéant le 10 nov. 2047	400	343	339	3,600 %, échéant le 29 sept. 2027	500	499	488
<b>Ville de Toronto (Canada)</b>				<b>Brookfield Finance, Inc.</b>			
2,800 %, échéant le 22 nov. 2049	600	467	462	5,431 %, échéant le 14 décembre 2032	1 500	1 500	1 540
3,250 %, échéant le 24 juin 2046	4 100	3 488	3 483	<b>Brookfield Property Finance ULC</b>			
4,300 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2052	1 800	1 758	1 822	3,930 %, échéant le 15 janv. 2027	700	725	633
<b>Province d'Alberta</b>				4,000 %, échéant le 30 sept. 2026			
3,050 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2048	1 600	1 680	1 346	7,125 %, échéant le 13 févr. 2028	1 300	1 300	1 279
3,300 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2046	4 400	5 250	3 892	<b>Brookfield Renewable Partners ULC</b>			
3,450 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2043	5 300	5 835	4 842	5,292 %, échéant le 28 oct. 2033	500	500	514
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2031	400	432	396	<b>Compagnie de chemin de fer Canadien Pacifique</b>			
<b>Province de la Colombie-Britannique</b>				2,540 %, échéant le 28 févr. 2028			
4,250 %, échéant le 18 décembre 2053	3 200	3 102	3 385	3 000	3 000	2 812	
4,300 %, échéant le 18 juin 2042	2 300	3 066	2 381	<b>Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix</b>			
<b>Province du Manitoba</b>				3,546 %, échéant le 10 janv. 2025			
3,800 %, échéant le 5 sept. 2053	1 900	1 765	1 807	1 300	1 322	1 278	
4,650 %, échéant le 16 juill. 2039	750	850	798	<b>CI Financial Corp.</b>			
4,800 %, échéant le 30 juin 2036	350	391	377	7,000 %, échéant le 2 décembre 2025	800	800	817
<b>Province de Terre-Neuve-et-Labrador</b>				<b>Fonds de placement immobilier Crombie</b>			
2,650 %, échéant le 17 oct. 2050	300	296	220	4,800 %, échéant le 31 janv. 2025	700	700	693
3,300 %, échéant le 17 oct. 2046	3 000	3 396	2 530	<b>Enbridge, Inc.</b>			
<b>Province d'Ontario</b>				3,100 %, échéant le 21 sept. 2033			
2,800 %, échéant le 2 juin 2048	11 500	10 811	9 349	5,000 %, échéant le 19 janv. 2082	1 600	1 379	1 366
2,900 %, échéant le 2 juin 2049	6 800	5 040	5 616	6,625 %, échéant le 12 avr. 2078	200	201	197
3,450 %, échéant le 2 juin 2045	15 600	17 845	14 307	7,220 %, échéant le 24 juill. 2030	1 000	1 358	1 100
3,500 %, échéant le 2 juin 2043	13 100	12 755	12 163	<b>Fairfax Financial Holdings Ltd.</b>			
4,650 %, échéant le 2 juin 2041	24 720	33 344	26 637	4,700 %, échéant le 16 décembre 2026	3 000	3 300	3 002
4,700 %, échéant le 2 juin 2037	6 800	9 090	7 342	4,950 %, échéant le 3 mars 2025	1 000	1 064	1 001
5,850 %, échéant le 8 mars 2033	5 700	7 643	6 598	<b>Compagnie Crédit Ford du Canada</b>			
6,000 %, échéant le 25 août 2038	6 950	10 571	8 400	4,460 %, échéant le 13 nov. 2024	1 200	1 210	1 187
6,500 %, échéant le 8 mars 2029	1 400	1 881	1 595	6,382 %, échéant le 10 nov. 2028	800	800	836
<b>Province de Québec</b>				7,000 %, échéant le 10 févr. 2026			
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2045	7 800	7 766	7 205	7,375 %, échéant le 12 mai 2026	400	400	417
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2048	6 900	8 208	6 363	<b>Autorité aéroportuaire du Grand Toronto</b>			
5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2041	1 400	2 075	1 573	7,050 %, échéant le 12 juin 2030	220	303	254
6,250 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2032	600	845	708	<b>Fonds de placement immobilier H&amp;R</b>			
		160 689	136 587	3,369 %, échéant le 30 janv. 2024	700	705	699

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Penske Truck Leasing Canada, Inc.</b> 2,700 %, échéant le 30 sept. 2024	1 300 \$	1 297 \$	1 275 \$
<b>Fonds de placement immobilier RioCan</b> 2,829 %, échéant le 8 nov. 2028	500	500	448
<b>Rogers Communications, Inc.</b> 3,750 %, échéant le 15 avr. 2029 4,250 %, échéant le 15 avr. 2032	1 500 4 500	1 498 4 251	1 443 4 331
<b>Banque Royale du Canada</b> 1,936 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2025 4,612 %, échéant le 26 juill. 2027	7 000 1 000	6 616 994	6 747 1 006
<b>TELUS Corp.</b> 2,050 %, échéant le 7 oct. 2030 2,750 %, échéant le 8 juill. 2026 2,850 %, échéant le 13 nov. 2031	2 700 900 1 500	2 581 897 1 496	2 314 867 1 323
<b>La Banque Toronto-Dominion</b> 4,680 %, échéant le 8 janv. 2029	6 000	5 955	6 070
<b>TransCanada PipeLines Ltd.</b> 3,800 %, échéant le 5 avr. 2027 6,280 %, échéant le 26 mai 2028	500 2 467	551 3 160	490 2 593
<b>Transcanada Trust</b> 4,650 %, échéant le 18 mai 2077	1 400	1 351	1 280
		<u>77 455</u>	<u>74 929</u>

#### TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 0,2 %

<b>Fiducie de liquidité sur actifs immobiliers</b> 2,381 %, échéant le 12 févr. 2055 2,867 %, échéant le 12 févr. 2055	696 400	698 403	652 355
		<u>1 101</u>	<u>1 007</u>
Total – Canada		<u>296 065</u>	<u>271 727</u>

#### ÎLES CAÏMANS 5,8 %

##### TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 5,7 %

<b>ACAS CLO Ltd.</b> 6,547 %, échéant le 18 oct. 2028	747 USD	911	989
<b>Anchorage Capital CLO Ltd.</b> 6,705 %, échéant le 15 juill. 2030	401	506	531
<b>Apex Credit CLO Ltd.</b> 6,622 %, échéant le 20 sept. 2029	479	594	635
<b>Brightspire Capital Ltd.</b> 6,620 %, échéant le 19 août 2038	420	523	543
<b>BXMT Ltd.</b> 6,876 %, échéant le 15 nov. 2037	820	1 077	1 053
<b>Catamaran CLO Ltd.</b> 6,774 %, échéant le 22 avr. 2030	1 013	1 247	1 342
<b>Crestline Denali CLO Ltd.</b> 6,707 %, échéant le 20 avr. 2030	953	1 193	1 262
<b>Dryden Senior Loan Fund</b> 6,675 %, échéant le 15 avr. 2029	671	859	888
<b>Elevation CLO Ltd.</b> 6,590 %, échéant le 25 oct. 2030	1 303	1 611	1 724
<b>Gallatin CLO Ltd.</b> 6,745 %, échéant le 15 juill. 2031	2 187	2 795	2 893
<b>GPMT Ltd.</b> 6,723 %, échéant le 16 juill. 2035	764	938	1 000
<b>LCM Ltd.</b> 6,757 %, échéant le 20 avr. 2031	500	606	661
<b>LoanCore Issuer Ltd.</b> 6,776 %, échéant le 15 juill. 2036 6,776 %, échéant le 15 nov. 2038	557 1 400	673 1 731	729 1 816

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Lument Finance Trust, Inc.</b> 6,646 %, échéant le 15 juin 2039	1 500 USD	1 818 \$	1 946 \$
<b>M360 Ltd.</b> 6,971 %, échéant le 22 nov. 2038	770	968	1 006
<b>MF1 Ltd.</b> 6,573 %, échéant le 16 juill. 2036	965	1 167	1 260
<b>MidOcean Credit CLO</b> 6,682 %, échéant le 29 janv. 2030	397	498	526
<b>Mountain View CLO LLC</b> 6,695 %, échéant le 16 janv. 2031	1 386	1 724	1 835
<b>Nassau Ltd.</b> 6,805 %, échéant le 15 oct. 2029	100	133	133
<b>OZLM Ltd.</b> 6,682 %, échéant le 16 mai 2030	905	1 129	1 198
<b>Stratus CLO Ltd.</b> 6,627 %, échéant le 29 déc. 2029	897	1 156	1 183
<b>Venture CLO Ltd.</b> 6,678 %, échéant le 28 août 2029 6,777 %, échéant le 20 janv. 2029 6,807 %, échéant le 20 avr. 2032	77 760 1 200	102 966 1 455	102 1 007 1 586
<b>Voya CLO Ltd.</b> 6,614 %, échéant le 17 avr. 2030	343	422	454
		<u>26 802</u>	<u>28 302</u>

#### PRÊTS AVEC PARTICIPATION ET CESSION 0,1 %

<b>American Airlines, Inc.</b> 10,427 %, échéant le 20 avr. 2028	360	466	491
Total - Îles Caïmans		<u>27 268</u>	<u>28 793</u>

#### FRANCE 1,5 %

##### OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,5 %

<b>BNP Paribas SA</b> 2,538 %, échéant le 13 juill. 2029	4 300 \$	4 209	3 868
<b>Électricité de France SA</b> 5,993 %, échéant le 23 mai 2030	900	900	943
<b>Société Générale SA</b> 1,488 %, échéant le 14 déc. 2026 6,691 %, échéant le 10 janv. 2034	1 000 USD 1 000	1 280 1 367	1 220 1 401
Total - France		<u>7 756</u>	<u>7 432</u>

#### ALLEMAGNE 0,5 %

##### OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %

<b>Deutsche Bank AG</b> 2,552 %, échéant le 7 janv. 2028 6,720 %, échéant le 18 janv. 2029	1 000 USD 800	1 115 1 074	1 217 1 111
Total - Allemagne		<u>2 189</u>	<u>2 328</u>

#### GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES 0,4 %

##### OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,4 %

<b>Sirius Real Estate Ltd.</b> 1,750 %, échéant le 24 nov. 2028	1 500 EUR	2 148	1 827
Total - Guernesey, Îles anglo-normandes		<u>2 148</u>	<u>1 827</u>

#### IRLANDE 5,3 %

##### TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 4,7 %

<b>Adagio CLO DAC</b> 4,685 %, échéant le 15 oct. 2031	400 EUR	597	577
---	---------	-----	-----

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Ares European CLO DAC</b> 4,745 %, échéant le 15 oct. 2031	1 382 EUR	2 034 \$	2 002 \$				
<b>Armada Euro CLO DAC</b> 4,685 %, échéant le 15 juill. 2031	995	1 483	1 440				
<b>Aurium CLO DAC</b> 4,695 %, échéant le 16 janv. 2031	1 596	2 289	2 310				
<b>Black Diamond CLO DAC</b> 4,982 %, échéant le 15 mai 2032	684	1 021	988				
<b>BlueMountain Fuji EUR CLO DAC</b> 4,615 %, échéant le 15 juill. 2030	543	834	791				
4,685 %, échéant le 15 janv. 2031	1 192	1 749	1 724				
<b>Cairn CLO DAC</b> 4,745 %, échéant le 15 oct. 2031	400	587	575				
<b>Carlyle Euro CLO DAC</b> 4,892 %, échéant le 15 août 2032	500	743	722				
<b>Harvest CLO DAC</b> 4,566 %, échéant le 26 juin 2030	529	780	766				
<b>OAK Hill European Credit Partners DAC</b> 4,723 %, échéant le 20 janv. 2032	456	704	660				
<b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b> 4,695 %, échéant le 15 juill. 2031	1 342	1 927	1 939				
4,745 %, échéant le 15 avr. 2031	1 543	2 283	2 225				
<b>Sculptor European CLO DAC</b> 4,755 %, échéant le 14 janv. 2032	1 700	2 432	2 451				
<b>Segovia European CLO DAC</b> 4,873 %, échéant le 20 juill. 2032	1 500	2 202	2 166				
<b>Tikehau CLO DAC</b> 4,844 %, échéant le 4 août 2034	1 300	1 935	1 880				
		23 600	23 216				
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 0,6 %</b>							
<b>Bruegel DAC</b> 4,762 %, échéant le 22 mai 2031	1 066	1 568	1 494				
<b>Primrose Residential DAC</b> 4,626 %, échéant le 24 mars 2061	1 022	1 498	1 491				
<b>Taurus DEU DAC</b> 5,116 %, échéant le 22 déc. 2030	197	294	283				
		3 360	3 268				
Total - Irlande		26 960	26 484				
<b>ITALIE 0,2 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>							
<b>Mundys SpA</b> 1,875 %, échéant le 12 févr. 2028	700 EUR	1 068	943				
Total - Italie		1 068	943				
<b>JAPON 0,0 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,0 %</b>							
<b>Nissan Motor Co. Ltd.</b> 4,810 %, échéant le 17 sept. 2030	200 USD	275	248				
Total - Japon		275	248				
<b>JERSEY, ÎLES ANGLONORMANDES 0,2 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>							
<b>G City Europe Ltd.</b> 4,250 %, échéant le 11 sept. 2025	500 EUR	735	674				
<b>Heathrow Funding Ltd.</b> 3,250 %, échéant le 21 mai 2027	500 \$	521 \$	488 \$				
Total - Jersey, Îles anglo-normandes		1 256	1 162				
<b>LUXEMBOURG 0,3 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,3 %</b>							
<b>Aroundtown SA</b> 4,625 %, échéant le 18 sept. 2025	1 400 \$	1 459	1 352				
<b>Cromwell Ereit Lux Finco SARL</b> 2,125 %, échéant le 19 nov. 2025	200 EUR	314	276				
Total - Luxembourg		1 773	1 628				
<b>MULTINATIONAL 0,0 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,0 %</b>							
<b>Delta Air Lines, Inc.</b> 4,500 %, échéant le 20 oct. 2025	1 USD	1	1				
Total - Multinational		1	1				
<b>ROUMANIE 0,2 %</b>							
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,2 %</b>							
<b>Obligations internationales du gouvernement de la Roumanie</b>							
1,750 %, échéant le 13 juill. 2030	700 EUR	863	830				
Total - Roumanie		863	830				
<b>SUISSE 0,9 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,9 %</b>							
<b>UBS Group AG</b> 6,442 %, échéant le 11 août 2028	1 400 USD	1 795	1 928				
6,537 %, échéant le 12 août 2033	1 700	2 082	2 405				
Total - Suisse		3 877	4 333				
<b>ROYAUME-UNI 2,1 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 2,1 %</b>							
<b>Barclays PLC</b> 2,166 %, échéant le 23 juin 2027	8 100 \$	8 062	7 486				
<b>Lloyds Banking Group PLC</b> 3,500 %, échéant le 3 févr. 2025	2 600	2 578	2 536				
<b>Workspace Group PLC</b> 2,250 %, échéant le 11 mars 2028	300 GBP	527	435				
Total - Royaume-Uni		11 167	10 457				
<b>ÉTATS-UNIS 23,7 %</b>							
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 6,9 %</b>							
<b>510 Asset-Backed Trust</b> 2,240 %, échéant le 25 juin 2061	365 USD	450	462				
<b>Bayview Financial Asset Trust</b> 6,620 %, échéant le 25 mars 2037	681	853	903				
<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b> 5,810 %, échéant le 25 déc. 2036	1 000	1 207	1 277				
<b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust</b> 5,610 %, échéant le 25 juill. 2037	273	323	329				
5,670 %, échéant le 25 sept. 2037	329	383	387				
6,170 %, échéant le 25 mars 2036	713	867	824				
<b>ECMC Group Student Loan Trust</b> 6,452 %, échéant le 25 juill. 2069	572	754	751				
6,602 %, échéant le 25 nov. 2069	944	1 234	1 248				

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Fieldstone Mortgage Investment Trust</b> 6,115 %, échéant le 25 févr. 2036	1 134 USD	1 262 \$	1 328 \$
<b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b> 6,415 %, échéant le 25 juin 2034 6,520 %, échéant le 25 oct. 2034	874 1 162	1 116 1 460	1 113 1 416
<b>Fremont Home Loan Trust</b> 6,325 %, échéant le 25 juill. 2034	499	654	605
<b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b> 5,690 %, échéant le 25 avr. 2037	361	392	363
<b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b> 6,010 %, échéant le 25 févr. 2036	404	313	205
<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b> 5,610 %, échéant le 25 mai 2037 5,700 %, échéant le 25 nov. 2036	579 554	699 561	651 419
<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b> 5,810 %, échéant le 25 janv. 2047	1 827	1 266	741
<b>Navient Private Education Loan Trust</b> 6,926 %, échéant le 16 juill. 2040	217	270	289
<b>Navient Private Education Refi Loan Trust</b> 6,476 %, échéant le 15 avr. 2069	522	675	686
<b>Nelnet Student Loan Trust</b> 6,352 %, échéant le 27 juin 2067	847	1 143	1 114
<b>Option One Mortgage Loan Trust</b> 5,610 %, échéant le 25 janv. 2037 5,610 %, échéant le 25 févr. 2037 5,610 %, échéant le 25 mars 2037	408 145 397	425 154 407	337 125 353
<b>PRET LLC</b> 1,992 %, échéant le 25 févr. 2061 2,240 %, échéant le 27 sept. 2060	407 138	495 173	527 183
<b>Ready Capital Mortgage Financing LLC</b> 6,420 %, échéant le 25 juill. 2036 6,670 %, échéant le 25 nov. 2036 6,987 %, échéant le 25 janv. 2037	735 1 453 1 262	919 1 823 1 616	964 1 914 1 676
<b>Renaissance Home Equity Loan Trust</b> 5,340 %, échéant le 25 janv. 2037 5,749 %, échéant le 25 févr. 2036 5,945 %, échéant le 25 août 2036	980 176 2 524	649 229 2 277	440 215 1 377
<b>Residential Asset Mortgage Products Trust</b> 5,980 %, échéant le 25 mars 2036	860	1 070	1 105
<b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b> 6,085 %, échéant le 25 mars 2036 6,475 %, échéant le 25 mai 2035 6,620 %, échéant le 25 juin 2035	300 1 769 500	356 2 227 651	374 2 302 651
<b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b> 5,750 %, échéant le 25 sept. 2036	631	834	759
<b>SLM Student Loan Trust</b> 6,196 %, échéant le 25 oct. 2029	722	1 008	956
<b>SMB Private Education Loan Trust</b> 1,290 %, échéant le 15 juill. 2053 6,320 %, échéant le 15 sept. 2054	609 999	811 1 303	728 1 305
<b>Soundview Home Loan Trust</b> 5,670 %, échéant le 25 juin 2037 6,175 %, échéant le 25 nov. 2035	274 154	288 197	256 200
<b>Specialty Underwriting &amp; Residential Finance Trust</b> 6,370 %, échéant le 25 juin 2036	323	389	404
<b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b> 5,700 %, échéant le 25 mai 2047 5,730 %, échéant le 25 mai 2047	300 1 000	372 1 123	379 1 105
<b>VMC Finance LLC</b> 6,573 %, échéant le 16 juin 2036	553	668	727
		<u>36 346</u>	<u>34 473</u>

**OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 8,5 %**

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Air Lease Corp.</b> 2,625 %, échéant le 5 déc. 2024	700 \$	694 \$	681 \$
<b>Alaska Airlines, fiducie à flux identiques</b> 4,800 %, échéant le 15 févr. 2029	229 USD	311	296
<b>American Airlines, fiducie à flux identiques</b> 2,875 %, échéant le 11 janv. 2036 3,000 %, échéant le 15 avr. 2030 3,350 %, échéant le 15 avr. 2031 3,375 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2028 3,600 %, échéant le 22 mars 2029	95 134 351 345 709	117 162 431 421 890	107 161 421 420 880
<b>AT&amp;T, Inc.</b> 4,000 %, échéant le 25 nov. 2025	3 600 \$	3 692	3 546
<b>Bank of America Corp.</b> 3,407 %, échéant le 20 sept. 2025	3 500	3 503	3 446
<b>British Airways Pass-Through Trust</b> 3,300 %, échéant le 15 juin 2034 Credit Suisse AG AT1 Claim	167 USD 700	213 0	198 111
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b> 2,013 %, échéant le 28 févr. 2029 2,599 %, échéant le 30 nov. 2027 3,307 %, échéant le 31 oct. 2025	1 000 \$ 3 300 900	874 3 294 912	900 3 109 883
<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b> 1,896 %, échéant le 5 mars 2028	8 100	7 924	7 489
<b>Morgan Stanley</b> 1,779 %, échéant le 4 août 2027 3,000 %, échéant le 7 févr. 2024	4 000 1 700	3 930 1 673	3 721 1 696
<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b> 3,000 %, échéant le 15 juin 2028 3,150 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2026	1 500 USD 200	1 802 282	1 813 254
<b>Sabra Health Care LP</b> 3,900 %, échéant le 15 oct. 2029	400	523	477
<b>SBA Tower Trust</b> 2,328 %, échéant le 15 juill. 2052	1 000	1 351	1 172
<b>STORE Capital Corp.</b> 4,625 %, échéant le 15 mars 2029	100	125	122
<b>Synchrony Financial</b> 3,950 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2027	700	962	868
<b>United Airlines, fiducie à flux identiques</b> 2,700 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2033 3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> sept. 2031 4,000 %, échéant le 11 oct. 2027 4,150 %, échéant le 25 févr. 2033 4,300 %, échéant le 15 févr. 2027 5,875 %, échéant le 15 avr. 2029	83 76 107 73 55 970	103 93 127 93 74 1 294	94 92 136 89 71 1 303
<b>Verizon Communications, Inc.</b> 2,375 %, échéant le 22 mars 2028 2,500 %, échéant le 16 mai 2030	2 500 \$ 3 000	2 493 2 940	2 313 2 682
<b>Walt Disney Co.</b> 3,057 %, échéant le 30 mars 2027	800	823	773
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b> 2,493 %, échéant le 18 févr. 2027 2,975 %, échéant le 19 mai 2026	1 500 700	1 412 683	1 408 674
		<u>44 221</u>	<u>42 406</u>

**TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 7,1 %**

<b>1211 Avenue of the Americas Trust</b> 3,901 %, échéant le 10 août 2035	400 USD	582	509
<b>225 Liberty Street Trust</b> 3,597 %, échéant le 10 févr. 2036	400	580	486

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust</b>				<b>Morgan Stanley Capital Trust</b>			
4,185 %, échéant le 15 août 2046	600 USD	665 \$	624 \$	2,428 %, échéant le 5 avr. 2042	300 USD	423 \$	307 \$
<b>Beneria Cowen &amp; Pritzer Collateral Funding Corp.</b>				<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>			
6,275 %, échéant le 15 juin 2038	1 800	2 192	2 146	6,000 %, échéant le 25 déc. 2035	79	87	42
<b>BMO Mortgage Trust</b>				6,550 %, échéant le 25 nov. 2035	1 100	1 355	1 447
7,055 %, échéant le 15 nov. 2056	1 700	2 401	2 444	<b>New Residential Mortgage Loan Trust</b>			
<b>Chevy Chase Funding LLC, certificats adossés à des créances hypothécaires</b>				3,500 %, échéant le 25 déc. 2057	333	477	422
5,720 %, échéant le 25 juin 2036	320	395	383	<b>New York Mortgage Trust</b>			
<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>				5,250 %, échéant le 25 juill. 2062	442	548	574
6,170 %, échéant le 25 sept. 2062	543	703	722	<b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>			
7,373 %, échéant le 25 août 2035	1	1	1	0,523 %, échéant le 25 sept. 2046	322	244	149
<b>Commercial Mortgage Trust</b>				<b>NYO Commercial Mortgage Trust</b>			
3,545 %, échéant le 10 févr. 2036	400	578	495	6,571 %, échéant le 15 nov. 2038	1 100	1 362	1 349
6,776 %, échéant le 15 déc. 2038	740	936	899	<b>Residential Accredited Loans, Inc. Trust</b>			
<b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>				5,970 %, échéant le 25 août 2037	38	47	46
5,750 %, échéant le 25 avr. 2047	6	6	7	<b>Residential Asset Securitization Trust</b>			
<b>Credit Suisse Commercial Mortgage Trust</b>				5,500 %, échéant le 25 oct. 2035	837	846	757
6,443 %, échéant le 15 juin 2034	444	544	545	<b>SFO Commercial Mortgage Trust</b>			
<b>Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust</b>				6,626 %, échéant le 15 mai 2038	1 200	1 475	1 492
6,421 %, échéant le 25 oct. 2037	451	540	365	<b>SREIT Trust</b>			
<b>Credit Suisse Mortgage Capital Trust</b>				6,176 %, échéant le 15 oct. 2038	1 800	2 199	2 340
2,257 %, échéant le 15 août 2037	671	925	823	<b>Starwood Mortgage Residential Trust</b>			
3,850 %, échéant le 25 sept. 2057	359	512	453	1,486 %, échéant le 25 avr. 2065	86	114	106
4,046 %, échéant le 25 mars 2060	405	542	546	<b>Fiducie de prêts hypothécaires à taux variable structurés</b>			
6,876 %, échéant le 15 juill. 2038	700	877	821	5,770 %, échéant le 25 févr. 2037	240	317	305
<b>Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust</b>				<b>Fiducie de placements en actifs hypothécaires structurés</b>			
5,610 %, échéant le 25 juill. 2047	76	93	92	6,145 %, échéant le 19 mars 2034	411	509	499
<b>Extended Stay America Trust</b>				<b>Towd Point Mortgage Trust</b>			
6,556 %, échéant le 15 juill. 2038	1 400	1 725	1 840	2,750 %, échéant le 25 oct. 2056	6	9	8
<b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust</b>				<b>UBS Commercial Mortgage Trust</b>			
6,000 %, échéant le 25 févr. 2037	6	6	3	2,921 %, échéant le 15 oct. 2052	300	412	349
<b>GS Mortgage Securities Corp. Trust</b>				<b>Verus Securitization Trust</b>			
8,762 %, échéant le 15 août 2039	500	636	668	1,277 %, échéant le 25 avr. 2064	232	281	275
<b>GS Mortgage Securities Trust</b>				3,889 %, échéant le 25 mars 2060	710	964	912
3,621 %, échéant le 10 oct. 2035	400	579	499	5,500 %, échéant le 25 mars 2060	300	418	387
<b>IMS Ecuadorian Mortgage Trust</b>				<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>			
3,400 %, échéant le 18 août 2043	800	1 021	993	6,030 %, échéant le 25 nov. 2045	15	12	18
<b>IndyMac INDX Mortgage Loan Trust</b>				6,110 %, échéant le 25 juill. 2045	7	6	9
6,270 %, échéant le 25 nov. 2034	14	17	16	6,190 %, échéant le 25 nov. 2034	7	7	9
<b>JP Morgan Alternative Loan Trust</b>				<b>Worldwide Plaza Trust</b>			
5,950 %, échéant le 25 nov. 2036	546	664	609	3,526 %, échéant le 10 nov. 2036	1 300	1 846	1 314
6,000 %, échéant le 25 déc. 2035	308	362	281			36 805	35 102
<b>JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b>							
6,591 %, échéant le 15 nov. 2038	900	1 136	1 173	<b>ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX AMÉRICAINS 1,2 %</b>			
<b>JP Morgan Mortgage Trust</b>				<b>Freddie Mac</b>			
3,500 %, échéant le 25 mai 2050	207	268	243	5,753 %, échéant le 15 janv. 2047	2 839	3 689	3 641
<b>Legacy Mortgage Asset Trust</b>				5,803 %, échéant le 15 août 2045	1 863	2 426	2 397
1,750 %, échéant le 25 juill. 2061	369	447	471			6 115	6 038
1,875 %, échéant le 25 oct. 2068	321	411	404	Total - États-Unis		123 487	118 019
1,991 %, échéant le 25 sept. 2060	45	57	60	<b>INSTRUMENTS À COURT TERME 1,9 %</b>			
<b>Lehman XS Trust</b>				<b>PRISES EN PENSION<sup>e)</sup> 0,1 %</b>			
5,830 %, échéant le 25 déc. 2036	487	631	618			356	358
<b>Luminent Mortgage Trust</b>							
5,810 %, échéant le 25 déc. 2036	687	844	784				
<b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>							
6,190 %, échéant le 25 août 2035	500	613	628				
<b>MFA Trust</b>							
1,479 %, échéant le 25 mars 2065	78	102	97				
1,947 %, échéant le 25 avr. 2065	195	256	238				

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>BONS DU TRÉSOR DU CANADA 1,8 %</b>			
5,240 %, échéant le 10 oct. 2024 <sup>a), b)</sup>	1 000 \$	961 \$	964 \$
5,315 %, échéant le 10 oct. 2024 <sup>a), b)</sup>	8 100	7 784	7 810
		8 745	8 774
Total - Placements à court terme		9 101	9 132
Total - Placements dans des titres		519 155	488 847
<b>Total - Placements 98,4 %</b>	<b>519 155 \$</b>	<b>488 847 \$</b>	
Instruments financiers dérivés <sup>d), e)</sup> 0,8 %		(3)	3 987
Autres actifs, moins les passifs 0,8 %			3 842
<b>Total de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables 100,0 %</b>			<b>496 676 \$</b>

**NOTES À L'INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE :**

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

^ Titre en défaillance.

a) Titre à coupon zéro.

b) Coupon représentant un rendement à l'échéance.

**EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT****c) PRISES EN PENSION :**

Contrepartie	Taux de financement	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du capital	Garanti par	Garanties (reçues)	Prises en pension, à la valeur	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>
SSB	2,600 %	29 déc. 2023	2 janv. 2024	270 USD	Obligations du Trésor des États-Unis, 0,250 %, échéant le 31 oct. 2025 <sup>2)</sup>	(363) \$	358 \$	358 \$
<b>Total - Prises en pension de titres</b>						<b>(363) \$</b>	<b>358 \$</b>	<b>358 \$</b>

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

<sup>2)</sup> La garantie en dépôt est détenue par une contrepartie.

**Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et des autres opérations de financement et des garanties données/(reçues).**

**d) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE****OPTIONS ACHETÉES****OPTIONS SUR CONTRATS À TERME NÉGOCIÉS EN BOURSE**

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nombre de contrats	Coût	Juste valeur
Vente - Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 10 ans, CBOT, février 2024	111,500 USD	26 janv. 2024	37	30 \$	20 \$
Vente - Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada à 10 ans à la bourse de Montréal, mars 2024	61,000 \$	16 févr. 2024	425	5	2
<b>Total des options achetées</b>				<b>35 \$</b>	<b>22 \$</b>

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO (suite)

### OPTIONS VENDUES :

#### OPTIONS SUR CONTRATS À TERME NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nombre de contrats	Primes (reçues)	Juste valeur
Vente - Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 10 ans, CBOT, février 2024	109,500 USD	26 janv. 2024	37	(8) \$	(4) \$
Achat - Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 10 ans, CBOT, février 2024	114,500	26 janv. 2024	37	(26)	(16)
<b>Total - options vendues</b>				<b>(34) \$</b>	<b>(20) \$</b>

### CONTRATS À TERME :

Description	Type	Mois de l'échéance	Nombre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	Marge de variation	
					Actif	Passif
Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada à 5 ans, mars	Position longue	Mars 2024	518	1 568 \$	83 \$	0 \$
Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada à 10 ans, mars	Position longue	Mars 2024	511	2 783	15	0
Contrats à terme Euro-Bund, mars	Position courte	Mars 2024	1	(4)	2	0
Contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans, mars	Position courte	Mars 2024	6	(101)	35	0
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 2 ans, mars	Position courte	Mars 2024	21	(57)	0	(3)
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 5 ans, mars	Position courte	Mars 2024	219	(774)	0	(25)
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position longue	Mars 2024	5	15	0	0
<b>Total des contrats à terme</b>				<b>3 430 \$</b>	<b>135 \$</b>	<b>(28) \$</b>

### SWAPS :

#### SWAPS SUR DÉFAILLANCE D'INDICES DE CRÉDIT – PROTECTION À LA VENTE <sup>1)</sup>

Indice/tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>2)</sup>	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur <sup>3)</sup>	Marge de variation	
						Actif	Passif
Indice iTraxx Crossover-40 à 5 ans	5,000 %	20 déc. 2028	3 300 EUR	280 \$	385 \$	15 \$	0 \$

- <sup>1)</sup> Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, le Fonds soit i) versera à l'acheteur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et prendra livraison de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) paiera un montant net de règlement, sous forme de trésorerie, de titres ou d'autres obligations livrables, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence.
- <sup>2)</sup> Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait devoir payer en tant que vendeur de protection de crédit ou recevoir en tant qu'acheteur de protection de crédit en cas d'incident de crédit, conformément aux dispositions du swap en question.
- <sup>3)</sup> Les cours et les valeurs résultantes des swaps sur défaillance permettent de suivre l'évolution du risque de paiement/rendement et déterminent la probabilité qu'un passif (ou un actif) attendu sur le dérivé de crédit soit réalisé si le swap est dénoué ou si le notionnel est vendu à la clôture de la période. L'augmentation des justes valeurs en termes absolus, lorsque comparées aux valeurs notionnelles du swap, indique un affaiblissement du niveau de solvabilité de l'instrument référencé sous-jacent et une plus grande probabilité de défaillance ou de risque de défaillance, ou de survenance d'autres incidents de crédit définis dans les dispositions de l'accord.

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	Marge de variation	
						Actif	Passif	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,200 %	13 mai 2025	35 300 USD	(10) \$	423 \$	0 \$	(11) \$
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,000	28 juill. 2025	14 600	(91)	(29)	0	(5)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	18 déc. 2025	22 000	(39)	(29)	0	(10)
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	4,500	20 sept. 2033	900 AUD	24	22	1	0
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	4,500	20 mars 2034	2 000	135	47	2	0
À payer	Indice CAONREPO	3,850	15 mars 2025	79 100 \$	(294)	(465)	7	0
À payer	Indice CAONREPO	3,500	10 mai 2025	51 600	306	(239)	21	0
À payer	Indice CAONREPO	4,750	28 juill. 2025	16 300	166	165	8	0
À recevoir	Indice CAONREPO	4,800	20 sept. 2025	29 000	(383)	(383)	0	(18)
À payer	Indice CAONREPO	3,500	18 déc. 2025	29 300	61	77	19	0
À recevoir	Indice CAONREPO	3,850	1 <sup>er</sup> déc. 2031	26 400	(1 235)	(1 464)	0	(60)
					(1 360) \$	(1 875) \$	58 \$	(104) \$
<b>Total des swaps</b>					<b>(1 080) \$</b>	<b>(1 490) \$</b>	<b>73 \$</b>	<b>(104) \$</b>

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée.

#### e) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE

##### CONTRATS DE CHANGE À TERME :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
BPS	Mars 2024	13 670 TWD	434 USD	0 \$	(24) \$
CBK	Janv. 2024	2 983 \$	2 204	0	(64)
	Janv. 2024	1 746 USD	2 362 \$	48	0
	Févr. 2024	2 133	10 941 BRL	153	0
	Mars 2024	433	13 670 TWD	27	0
GLM	Janv. 2024	731 \$	539 USD	0	(17)
	Janv. 2024	572 EUR	838 \$	1	0
	Janv. 2024	216 GBP	372	7	0
	Janv. 2024	92 524 USD	125 735	3 151	0
	Févr. 2024	18 BRL	4 USD	0	0
JPM	Févr. 2024	1 570	320	0	(3)
MBC	Mars 2024	558 TWD	18	0	(1)
SCX	Janv. 2024	260 \$	175 EUR	0	(4)
	Janv. 2024	1 505	1 133 USD	3	(7)
	Janv. 2024	21 322 EUR	31 818 \$	625	0
	Janv. 2024	1 094 USD	1 485	36	0
<b>Total des contrats de change à terme</b>				<b>4 051 \$</b>	<b>(120) \$</b>

##### OPTIONS ACHETÉES

##### OPTIONS SUR SWAP DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Valeur notionnelle <sup>1)</sup>	Coût	Juste valeur
BOA	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 5 ans	LIBOR en CAD à 3 mois	À recevoir	3,400 %	7 févr. 2024	8 700	0 \$	38 \$
<b>Total des options achetées</b>							<b>0 \$</b>	<b>38 \$</b>

##### OPTIONS VENDUES :

##### OPTIONS SUR SWAP DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Valeur notionnelle <sup>1)</sup>	Primes (reçues)	Juste valeur
BOA	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 5 ans	LIBOR en CAD à 3 mois	À recevoir	3,000 %	7 févr. 2024	8 700	(4) \$	(41) \$
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 5 ans	LIBOR en CAD à 3 mois	À payer	3,650	7 févr. 2024	8 700	0	(15)
<b>Total - options vendues</b>							<b>(4) \$</b>	<b>(56) \$</b>

<sup>1)</sup> La valeur notionnelle représente le nombre de contrats.

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues).

## Notes annexes propres au Fonds Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO

(en milliers\*)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

### SOMMAIRE DES EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA)						
SSB	358 \$	0 \$	0 \$	358 \$	(363) \$	(5) \$
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement <sup>3)</sup></b>	<b>358 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA)						
RBC	44 821 \$	0 \$	0 \$	44 821 \$	(45 873) \$	(1 052) \$
SSB	910	0	0	910	(929)	(19)
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement <sup>3)</sup></b>	<b>45 731 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

<sup>2)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux emprunts et autres opérations de financement ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

<sup>3)</sup> Les emprunts se sont établis entre 0 \$ et 0 \$ pour la période close le 31 décembre 2023 (entre 0 \$ et 17 993 \$ pour la période close le 31 décembre 2022).

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2023 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs <sup>1)</sup>		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
<b>Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée</b>	<b>22 \$</b>	<b>135 \$</b>	<b>73 \$</b>	<b>230 \$</b>	<b>(20) \$</b>	<b>(32) \$</b>	<b>(104) \$</b>	<b>(156) \$</b>

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2022 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
<b>Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée</b>	<b>4 \$</b>	<b>80 \$</b>	<b>44 \$</b>	<b>128 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(344) \$</b>	<b>(153) \$</b>	<b>(497) \$</b>

<sup>1)</sup> À la clôture de la période, il y avait une marge de variation des passifs non réglée de (4) \$ pour les contrats à terme liquidés.

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
BOA	0 \$	38 \$	0 \$	38 \$	0 \$	(56) \$	0 \$	(56) \$	(18) \$	0 \$	(18) \$
BPS	0	0	0	0	(24)	0	0	(24)	(24)	0	(24)
CBK	228	0	0	228	(64)	0	0	(64)	164	0	164
GLM	3 159	0	0	3 159	(17)	0	0	(17)	3 142	(3 626)	(484)
JPM	0	0	0	0	(3)	0	0	(3)	(3)	0	(3)
MBC	0	0	0	0	(1)	0	0	(1)	(1)	0	(1)
SCX	664	0	0	664	(11)	0	0	(11)	653	(556)	97
<b>Total - Hors cote</b>	<b>4 051 \$</b>	<b>38 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>4 089 \$</b>	<b>(120) \$</b>	<b>(56) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(176) \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
BOA	129 \$	1 \$	0 \$	130 \$	(3 472) \$	0 \$	0 \$	(3 472) \$	(3 342) \$	3 501 \$	159 \$
BPS	19	0	0	19	0	0	0	0	19	0	19
BRC	0	0	0	0	(1)	0	0	(1)	(1)	0	(1)
CBK	35	0	0	35	(31)	0	0	(31)	4	0	4
CLY	0	0	0	0	(1 894)	0	0	(1 894)	(1 894)	0	(1 894)
GLM	16	0	0	16	(15)	0	0	(15)	1	0	1
IND	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1 625	1 625
JPM	37	0	0	37	0	0	0	0	37	0	37
MBC	0	0	0	0	(311)	0	0	(311)	(311)	517	206
MYI	9	0	0	9	0	0	0	0	9	0	9
RBC	17	0	0	17	0	0	0	0	17	0	17
SCX	20	0	0	20	(15)	0	0	(15)	5	0	5
TOR	0	0	0	0	(92)	0	0	(92)	(92)	27	(65)
<b>Total - Hors cote</b>	<b>282 \$</b>	<b>1 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>283 \$</b>	<b>(5 831) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(5 831) \$</b>			

<sup>1)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux instruments financiers dérivés hors cote ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

## ÉVALUATIONS DE LA JUSTE VALEUR

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2023 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Australie				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	3 503 \$	0 \$	3 503 \$
Canada				
Titres du gouvernement fédéral	0	58 355	0	58 355
Titres provinciaux	0	136 587	0	136 587
Titres adossés à des actifs	0	849	0	849
Obligations et billets de sociétés	0	74 929	0	74 929
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	1 007	0	1 007
Îles Caïmans				
Titres adossés à des actifs	0	28 302	0	28 302
Prêts avec participation et cession	0	491	0	491
France				
Obligations et billets de sociétés	0	7 432	0	7 432
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	2 328	0	2 328

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
Guernesey, îles anglo-normandes				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	1 827 \$	0 \$	1 827 \$
Irlande				
Titres adossés à des actifs	0	23 216	0	23 216
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	3 268	0	3 268
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0	943	0	943
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	248	0	248
Jersey, îles Anglo-Normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	1 162	0	1 162
Luxembourg				
Obligations et billets de sociétés	0	1 628	0	1 628
Multinational				
Obligations et billets de sociétés	0	1	0	1
Roumanie				
Émissions souveraines	0	830	0	830
Suisse				
Obligations et billets de sociétés	0	4 333	0	4 333
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	10 457	0	10 457
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	34 473	0	34 473
Obligations et billets de sociétés	0	42 406	0	42 406
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	35 101	1	35 102
Organismes gouvernementaux américains	0	6 038	0	6 038
Instruments à court terme				
Prises en pension	0	358	0	358
Bons du Trésor du Canada	0	8 774	0	8 774
<b>Total - Placements</b>	<b>0 \$</b>	<b>488 846 \$</b>	<b>1 \$</b>	<b>488 847 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	137	93	0	230
Hors cote	0	4 089	0	4 089
	<b>137 \$</b>	<b>4 182 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>4 319 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	(152)	0	(152)
Hors cote	0	(176)	0	(176)
	<b>0 \$</b>	<b>(328) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(328) \$</b>
<b>Total - Instruments financiers dérivés</b>	<b>137 \$</b>	<b>3 854 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>3 991 \$</b>
<b>Totaux</b>	<b>137 \$</b>	<b>492 700 \$</b>	<b>1 \$</b>	<b>492 838 \$</b>

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2022 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Australie				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	3 317 \$	0 \$	3 317 \$
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	59	0	59
Canada				
Services bancaires et financiers	0	5 581	0	5 581
Titres du gouvernement fédéral	0	77 982	0	77 982
Titres provinciaux	0	87 869	0	87 869
Titres adossés à des actifs	0	941	0	941
Obligations et billets de sociétés	0	104 406	0	104 406
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	3 055	0	3 055
Îles Caïmans				
Titres adossés à des actifs	0	50 636	0	50 636
Obligations et billets de sociétés	0	3 715	0	3 715
Prêts avec participation et cession	0	540	0	540

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	1 671 \$	0 \$	1 671 \$
France				
Obligations et billets de sociétés	0	4 789	0	4 789
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	2 507	0	2 507
Guernesey, îles anglo-normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	1 496	0	1 496
Hong Kong				
Obligations et billets de sociétés	0	3 039	0	3 039
Irlande				
Titres adossés à des actifs	0	24 757	0	24 757
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	3 403	0	3 403
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0	846	0	846
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	3 725	0	3 725
Jersey, îles Anglo-Normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	1 532	0	1 532
Luxembourg				
Obligations et billets de sociétés	0	2 678	0	2 678
Multinational				
Obligations et billets de sociétés	0	1 322	0	1 322
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	4 496	0	4 496
Roumanie				
Émissions souveraines	0	709	0	709
Suisse				
Obligations et billets de sociétés	0	10 136	0	10 136
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	17 814	0	17 814
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	7 215	0	7 215
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	41 022	0	41 022
Obligations et billets de sociétés	0	62 220	0	62 220
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	36 565	0	36 565
Instruments à court terme				
Prises en pension	0	45 710	0	45 710
Bons du Trésor du Canada	0	6 842	0	6 842
<b>Total - Placements</b>	<b>0 \$</b>	<b>622 595 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>622 595 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	43	85	0	128
Hors cote	0	283	0	283
	<b>43 \$</b>	<b>368 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>411 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(344)	(153)	0	(497)
Hors cote	0	(5 831)	0	(5 831)
	<b>(344) \$</b>	<b>(5 984) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(6 328) \$</b>
<b>Total - Instruments financiers dérivés</b>	<b>(301) \$</b>	<b>(5 616) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(5 917) \$</b>
<b>Totaux</b>	<b>(301) \$</b>	<b>616 979 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>616 678 \$</b>

Il n'y a eu aucun transfert significatif entre les niveaux 1, 2 et 3 pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

CONCENTRATION DU PORTEFEUILLE

Le portefeuille de placements du Fonds est concentré dans les segments suivants :

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Australie	0,7 %	0,5 %
Canada	54,7 %	44,2 %
Îles Caïmans	5,8 %	8,7 %
Danemark	0,0 %	0,3 %
France	1,5 %	0,8 %
Allemagne	0,5 %	0,4 %
Guernesey, Îles anglo-normandes	0,4 %	0,2 %
Hong Kong	0,0 %	0,5 %
Irlande	5,3 %	4,4 %
Italie	0,2 %	0,1 %
Japon	0,0 %	0,6 %
Jersey, Îles Anglo-Normandes	0,2 %	0,2 %
Luxembourg	0,3 %	0,4 %
Multinational	0,0 %	0,2 %
Pays-Bas	0,0 %	0,7 %
Roumanie	0,2 %	0,1 %
Suisse	0,9 %	1,6 %
Royaume-Uni	2,1 %	3,9 %
États-Unis	23,7 %	22,1 %
Instruments à court terme	1,9 %	8,3 %
Instruments financiers dérivés	0,8 %	(0,9) %
Autres actifs, moins les passifs	0,8 %	2,7 %
Total (% de l'actif net)	100,0 %	100,0 %

RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

RISQUE DE CHANGE

Les tableaux ci-dessous indiquent l'exposition globale au risque de change, sauf celui afférent à la monnaie fonctionnelle du Fonds.

Au 31 décembre 2023	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Dollar australien	72 \$	0 \$	72 \$	Dollar australien	1 \$	0 \$	1 \$
Réal brésilien	0	2 546	2 546	Réal brésilien	0	1 524	1 524
Livre sterling	1 849	(365)	1 484	Livre sterling	9 676	(8 253)	1 423
Yuan renminbi chinois (continental)	0	0	0	Yuan renminbi chinois (continental)	0	0	0
Yuan renminbi chinois (Offshore)	0	0	0	Yuan renminbi chinois (Offshore)	0	(1)	(1)
Euro	30 686	(31 774)	(1 088)	Euro	37 834	(37 543)	291
Roupie indienne	0	0	0	Roupie indienne	0	0	0
Shekel israélien	(250)	0	(250)	Shekel israélien	(250)	0	(250)
Yen japonais	1	0	1	Yen japonais	1	0	1
Peso mexicain	52	0	52	Peso mexicain	52	0	52
Dollar néo-zélandais	0	0	0	Dollar néo-zélandais	0	0	0
Couronne norvégienne	1	0	1	Couronne norvégienne	1	0	1
Zloty polonais	2	0	2	Zloty polonais	2	0	2
Nouveau leu roumain	1	0	1	Nouveau leu roumain	1	0	1
Dollar de Singapour	2	0	2	Dollar de Singapour	2	0	2
Rand sud-africain	2	0	2	Rand sud-africain	2	0	2
Franc suisse	0	0	0	Franc suisse	0	0	0
Dollar de Taïwan	0	(24)	(24)	Dollar de Taïwan	0	(6 165)	(6 165)
Nouvelle livre turque	0	0	0	Nouvelle livre turque	0	0	0
Dollar américain	125 999	(123 582)	2 417	Dollar américain	180 462	(172 856)	7 606
	158 417 \$	(153 199) \$	5 218 \$		227 784 \$	(223 294) \$	4 490 \$

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport aux autres monnaies, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 261 \$ (225 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

### RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT

Les tableaux ci-dessous résumant l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt. Ils incluent les instruments financiers du Fonds à la juste valeur, classés en fonction de la date d'échéance. Certains actifs ou passifs figurant dans l'état de la situation financière, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, ont été regroupés pour permettre la présentation ci-dessous.

<b>Actif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	4 246 \$	11 917 \$	97 481 \$	375 203 \$	0 \$	488 847 \$
Instruments financiers dérivés	4 051	0	55	3	210	4 319
Trésorerie et devises	0	0	0	0	4 608	4 608
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	5 565	5 565
Montants à recevoir	0	0	0	0	23 717	23 717
Autres actifs	0	0	0	0	6	6
<b>Total - Actif</b>	<b>8 297 \$</b>	<b>11 917 \$</b>	<b>97 536 \$</b>	<b>375 206 \$</b>	<b>34 106 \$</b>	<b>527 062 \$</b>
<b>Passif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	(120) \$	0 \$	(44) \$	(60) \$	(108) \$	(332) \$
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(437)	(437)
Montants à payer	0	0	0	0	(29 617)	(29 617)
<b>Total - Passif</b>	<b>(120) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(44) \$</b>	<b>(60) \$</b>	<b>(30 162) \$</b>	<b>(30 386) \$</b>
<b>Actif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	53 767 \$	49 214 \$	110 219 \$	409 395 \$	0 \$	622 595 \$
Instruments financiers dérivés	268	15	0	0	128	411
Trésorerie et devises	0	0	0	0	3 347	3 347
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	9 433	9 433
Montants à recevoir	0	0	0	0	7 091	7 091
<b>Total - Actif</b>	<b>54 035 \$</b>	<b>49 229 \$</b>	<b>110 219 \$</b>	<b>409 395 \$</b>	<b>19 999 \$</b>	<b>642 877 \$</b>
<b>Passif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	(5 831) \$	0 \$	(152) \$	0 \$	(345) \$	(6 328) \$
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(396)	(396)
Montants à payer	0	0	0	0	(2 228)	(2 228)
<b>Total - Passif</b>	<b>(5 831) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(152) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(2 969) \$</b>	<b>(8 952) \$</b>

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si les taux d'intérêt en vigueur avaient progressé ou reculé de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 35 756 \$ ou 7,2 % (44 649 \$, ou 7,0 %, au 31 décembre 2022). La sensibilité du Fonds à la variation des taux d'intérêt a été estimée d'après la durée moyenne pondérée des instruments de créance. Dans les faits, les résultats des opérations peuvent différer et la différence peut être importante.

### AUTRE RISQUE DE PRIX

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'était pas exposé à l'autre risque de prix de façon importante, car il détenait surtout des titres de créance.

RISQUE DE LIQUIDITÉ

Les tableaux ci-dessous font état des passifs du Fonds, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, par date de paiement contractuel : moins de trois mois, de trois mois à un an ou plus d'un an, selon le cas.

Passif courant au 31 décembre 2023	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Total
Instruments financiers dérivés	228 \$	0 \$	104 \$	332 \$
Achats de placements à payer	17 719	0	0	17 719
Dépôts de contreparties	437	0	0	437
Montants à payer pour les parts rachetées	11 883	0	0	11 883
Frais de gestion à payer	15	0	0	15
<b>Total - Passif</b>	<b>30 282 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>104 \$</b>	<b>30 386 \$</b>

Passif courant au 31 décembre 2022	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Total
Instruments financiers dérivés	6 328 \$	0 \$	0 \$	6 328 \$
Achats de placements à payer	2 189	0	0	2 189
Dépôts de contreparties	396	0	0	396
Montants à payer pour les parts rachetées	21	0	0	21
Frais de gestion à payer	18	0	0	18
<b>Total - Passif</b>	<b>8 952 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>8 952 \$</b>

RISQUE DE CRÉDIT

Les tableaux ci-dessous résument la composition des notations des instruments financiers du Fonds.

	Au 31 décembre 2023	Au 31 décembre 2022
Catégorie investissement	95 %	92 %
Inférieur à la catégorie investissement	5 %	8 %
Sans notation	0 %	0 %
Total (% des placements et des instruments financiers dérivés)	100 %	100 %

Les notations sont fournies par Standard & Poor's Ratings Services (S&P), Moody's Investors Services, Inc. (Moody's), Fitch Ratings, Inc. (Fitch) ou DBRS Limited (DBRS). Lorsqu'il existe plus d'une notation pour un titre, la plus élevée a été retenue. Si la notation d'un instrument n'est pas fournie par l'une de ces agences, un titre reçoit une notation interne. Les notations inférieures à la catégorie investissement sont celles inférieures à Baa3 selon Moody's, à BAA- selon la notation interne, à BBB- selon S&P et Fitch, et à BBBL selon DBRS.

## États de la situation financière Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 déc. 2023	31 déc. 2022
<b>Actif :</b>		
Actif courant :		
<i>Placements, à la juste valeur</i>		
Placements dans des titres <sup>†</sup>	243 821 \$	245 071 \$
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	1 234	904
Hors cote	4 881	1 621
Trésorerie	540	805
Dépôts auprès de contreparties	11 853	14 849
Devises	1 906	1 446
Montants à recevoir pour les placements vendus	36 729	40 037
Montants à recevoir pour les parts vendues	685	84
Intérêts et dividendes à recevoir	1 132	883
	302 781	305 700
<b>Passif :</b>		
Passif courant :		
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	1 027	869
Hors cote	1 272	9 710
Achats de placements à payer	58 902	65 999
Montants à payer pour l'intérêt sur les swaps	0	1
Dépôts de contreparties	1 514	480
Montants à payer pour les parts rachetées	325	214
Distributions à payer	26	26
Frais de gestion à payer	40	59
	63 106	77 358
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	239 675 \$	228 342 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A	6 880 \$	9 586 \$
Nombre de parts rachetables - série A	668	980
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	10,29 \$	9,78 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F	53 781 \$	73 704 \$
Nombre de parts rachetables - série F	5 080	7 358
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	10,59 \$	10,02 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I	179 014 \$	145 052 \$
Nombre de parts rachetables - série I	16 904	14 567
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	10,59 \$	9,96 \$
<sup>†</sup> Comprend les prises en pension de :	17 442 \$	29 783 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États du résultat global Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Revenus :</b>		
<b>Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés</b>		
Intérêts à distribuer	6 230 \$	6 261 \$
Revenu (perte) sur dividendes	0	9
Revenu (perte) sur instruments dérivés	(1 882)	(297)
Gain (perte) net réalisé à la vente de placements	(3 883)	(21 773)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	1 414	3 349
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés hors cote	(3 689)	(2 134)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements en portefeuille	616	(5 908)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	2 022	(3 400)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés hors cote	11 430	(6 805)
Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés	12 258	(30 698)
<b>Autres revenus (pertes)</b>		
Produits divers	20	0
Gain (perte) net réalisé sur opérations en devises	2 972	12 915
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente à la conversion des actifs et des passifs libellés en devises	738	(73)
Autres revenus (pertes)	3 730	12 842
Total - Revenus (pertes)	15 988	(17 856)
<b>Charges :</b>		
Frais de gestion	550	762
Frais liés au CEI	1	1
Charges d'intérêts	74	35
Retenues d'impôts	4	0
Coûts de transaction	20	27
Frais juridiques	0	1
Total - Charges	649	826
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>15 339 \$</b>	<b>(18 682) \$</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série</b>		
Série A	415 \$	(709) \$
Série F	3 544	(6 181)
Série I	11 380	(11 792)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part</b>		
Série A	0,50 \$	(0,69) \$
Série F	0,58	(0,71)
Série I	0,71	(0,64)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

	Exercice clos le 31 déc. 2023			
	Série A	Série F	Série I	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	9 586 \$	73 704 \$	145 052 \$	228 342 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	415	3 544	11 380	15 339
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>				
Provenant du revenu net de placement	(47)	(473)	(1 192)	(1 712)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(47)	(473)	(1 192)	(1 712)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>				
Produit de la vente de parts rachetables	1 193	23 929	74 398	99 520
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	39	284	1 192	1 515
Coût des parts rachetables rachetées	(4 306)	(47 207)	(51 816)	(103 329)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(3 074)	(22 994)	23 774	(2 294)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(2 706)	(19 923)	33 962	11 333
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	6 880 \$	53 781 \$	179 014 \$	239 675 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Parts rachetables vendues	120	2 348	7 339	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	4	28	118	S.O.
Parts rachetables rachetées	(436)	(4 654)	(5 120)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(312)	(2 278)	2 337	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	980	7 358	14 567	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	668	5 080	16 904	S.O.

	Exercice clos le 31 déc. 2022			
	Série A	Série F	Série I	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	11 403 \$	104 280 \$	232 160 \$	347 843 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(709)	(6 181)	(11 792)	(18 682)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>				
Produit de la vente de parts rachetables	834	38 533	75 423	114 790
Coût des parts rachetables rachetées	(1 942)	(62 928)	(150 739)	(215 609)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(1 108)	(24 395)	(75 316)	(100 819)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(1 817)	(30 576)	(87 108)	(119 501)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	9 586 \$	73 704 \$	145 052 \$	228 342 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Parts rachetables vendues	84	3 798	7 499	S.O.
Parts rachetables rachetées	(195)	(6 233)	(15 024)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(111)	(2 435)	(7 525)	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	1 091	9 793	22 092	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	980	7 358	14 567	S.O.

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## Tableaux des flux de trésorerie Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)

(en milliers*)	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	15 339 \$	(18 682) \$
<b>Ajustements au titre du rapprochement de l'augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et des entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation :</b>		
Achats de titres	(7 266 059)	(7 416 493)
Produit de la vente de placements	7 260 991	7 511 275
(Augmentation) diminution des dépôts auprès de contreparties	2 996	(8 247)
(Augmentation) diminution des intérêts et des dividendes à recevoir	(249)	648
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	3 264	(229)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés hors cote	(3 957)	(2 289)
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les swaps	(1)	(2)
Augmentation (diminution) des dépôts de contreparties	1 034	164
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(19)	(24)
Produit des opérations de vente à découvert	35 574	1 635
Paiements au titre des opérations de vente à découvert	(35 574)	(1 895)
Produit (paiements) au titre des opérations en devises	3 707	12 820
<i>(Gain) perte nette réalisée</i>		
Placements	3 883	21 773
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(1 414)	(3 349)
Instruments financiers dérivés hors cote	3 689	2 134
Opérations en devises	(2 972)	(12 915)
<i>Variation nette de la (plus-value) moins-value latente</i>		
Placements	(616)	5 908
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(2 022)	3 400
Instruments financiers dérivés hors cote	(11 430)	6 805
Conversion de passifs et d'actifs libellés en devises	(738)	73
Amortissement net des primes (des escomptes) sur les placements	(738)	(299)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation</b>	<b>4 688</b>	<b>102 211</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement :</b>		
Produit de la vente de parts rachetables**	92 263	109 122
Montant payé au titre du rachat de parts rachetables**	(96 562)	(211 520)
Distributions en trésorerie versées aux porteurs de parts rachetables	(197)	0
Produit des accords cadres sur transactions à livrer	1 882	17 600
Paiements au titre des accords cadres sur transactions à livrer	(1 882)	(17 600)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement</b>	<b>(4 496)</b>	<b>(102 398)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des devises</b>	<b>192</b>	<b>(187)</b>
<b>Trésorerie (découvert) et devises :</b>		
Ouverture de l'exercice	2 251	2 416
Gain (perte) de change sur la trésorerie	3	22
Clôture de l'exercice	2 446 \$	2 251 \$
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie :</b>		
Intérêts payés liés aux activités de financement	72 \$	35 \$
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	5 207 \$	6 617 \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	0 \$	9 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

\*\* Ne comprend pas les transferts hors trésorerie entre les séries.

(en milliers\*, sauf le nombre d'actions, de contrats, de parts ou d'onces, selon le cas)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES 101,7 %</b>			
<b>ARGENTINE 0,1 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,1 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement de l'Argentine</b>			
0,750 %, échéant le 9 juill. 2030	230 USD	195 \$	122 \$
1,000 %, échéant le 9 juill. 2029	5	4	3
Total - Argentine		199	125
<b>AUSTRALIE 0,8 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
<b>National Australia Bank Ltd.</b>			
5,134 %, échéant le 28 nov. 2028	400 USD	549	544
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,6 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement de l'Australie</b>			
0,500 %, échéant le 21 sept. 2026	400 AUD	379	332
1,000 %, échéant le 21 déc. 2030	700	636	525
1,250 %, échéant le 21 mai 2032	100	72	73
1,750 %, échéant le 21 juin 2051	50	46	27
2,500 %, échéant le 21 mai 2030	500	518	420
		1 651	1 377
Total - Australie		2 200	1 921
<b>BERMUDES 0,4 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 0,4 %</b>			
<b>Symphony CLO Ltd.</b>			
7,002 %, échéant le 25 avr. 2034	800 USD	1 079	1 061
Total - Bermudes		1 079	1 061
<b>BRÉSIL 0,1 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,0 %</b>			
<b>Odebrecht Oil &amp; Gas Finance Ltd.</b>			
0,000 %, échéant le 29 janv. 2024 <sup>(b), (e)</sup>	50 USD	3	2
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,1 %</b>			
<b>Brazil Letras do Tesouro Nacional</b>			
0,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2024 <sup>(b)</sup>	200 BRL	55	54
0,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juill. 2024 <sup>(b)</sup>	1 000	259	260
		314	314
Total - Brésil		317	316
<b>CANADA 1,8 %</b>			
<b>TITRES DU GOUVERNEMENT FÉDÉRAL 1,1 %</b>			
<b>Obligation du gouvernement du Canada</b>			
1,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2053	200 \$	149	151
2,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2033	2 400	2 316	2 431
		2 465	2 582
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,4 %</b>			
<b>Fairfax Financial Holdings Ltd.</b>			
2,750 %, échéant le 29 mars 2028	100 EUR	146	140
<b>Compagnie Crédit Ford du Canada</b>			
7,375 %, échéant le 12 mai 2026	300 \$	300	313
<b>La Banque Toronto-Dominion</b>			
3,765 %, échéant le 8 sept. 2026	400 EUR	590	597
		1 036	1 050

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 0,3 %</b>			
<b>Fiducie de liquidité sur actifs immobiliers</b>			
2,381 %, échéant le 12 févr. 2055	209 \$	209 \$	196 \$
2,867 %, échéant le 12 févr. 2055	600	600	533
		809	729
Total - Canada		4 310	4 361

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>ÎLES CAÏMANS 4,8 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 3,9 %</b>			
<b>ACAS CLO Ltd.</b>			
6,547 %, échéant le 18 oct. 2028	455 USD	555	602
<b>Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.</b>			
6,788 %, échéant le 15 janv. 2037	700	887	914
<b>AREIT Trust</b>			
6,553 %, échéant le 17 nov. 2038	465	589	611
<b>Brightspire Capital Ltd.</b>			
6,620 %, échéant le 19 août 2038	588	733	760
<b>Elmwood CLO Ltd.</b>			
7,054 %, échéant le 17 janv. 2034	400	539	531
<b>GPMT Ltd.</b>			
6,723 %, échéant le 16 juill. 2035	328	402	429
<b>Jamestown CLO Ltd.</b>			
6,995 %, échéant le 15 avr. 2033	500	663	663
<b>Marble Point CLO Ltd.</b>			
6,695 %, échéant le 15 oct. 2030	278	346	369
<b>MF1 Ltd.</b>			
6,706 %, échéant le 19 févr. 2037	700	885	913
<b>MF1 Multifamily Housing Mortgage Loan Trust</b>			
6,326 %, échéant le 15 juill. 2036	62	78	81
<b>TPG Real Estate Finance Issuer Ltd.</b>			
6,988 %, échéant le 15 févr. 2039	700	889	909
<b>Venture CLO Ltd.</b>			
6,535 %, échéant le 15 avr. 2027	28	36	37
<b>Vibrant CLO Ltd.</b>			
6,797 %, échéant le 20 juill. 2032	700	876	921
<b>Wind River CLO Ltd.</b>			
6,707 %, échéant le 18 juill. 2031	480	597	635
6,735 %, échéant le 15 juill. 2031	700	888	925
		8 963	9 300

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,8 %</b>			
<b>Gaci First Investment Co.</b>			
4,750 %, échéant le 14 févr. 2030	300	398	398
4,875 %, échéant le 14 févr. 2035	400	524	519
5,125 %, échéant le 14 févr. 2053	200	250	241
<b>Sands China Ltd.</b>			
5,650 %, échéant le 8 août 2028	200	259	263
<b>Suci Second Investment Co.</b>			
6,000 %, échéant le 25 oct. 2028	300	410	420
		1 841	1 841

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,1 %</b>			
<b>KSA Sukuk Ltd.</b>			
5,268 %, échéant le 25 oct. 2028	200	275	276
Total - Îles Caïmans		11 079	11 417

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>DANEMARK 5,8 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 5,8 %</b>							
<b>Danske Bank AS</b>							
6,259 %, échéant le 22 sept. 2026	300 USD	403 \$	405 \$				
<b>Jyske Realkredit AS</b>							
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2024	2 500 DKK	479	491	1,750 %, échéant le 19 nov. 2030	200 EUR	308 \$	255 \$
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2024	2 500	475	488	2,552 %, échéant le 7 janv. 2028	200 USD	254	243
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2024	8 600	1 613	1 658	7,079 %, échéant le 10 févr. 2034	600	807	818
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2050	2 648	505	387	Total - Allemagne		3 294	3 010
1,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2053	1 680	314	254				
<b>Nordea Kredit Realkreditaktieselskab</b>				<b>HONGRIE 0,2 %</b>			
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2024	6 700	1 275	1 306	<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,2 %</b>			
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2024	4 900	921	945	<b>Obligations internationales du gouvernement de Hongrie</b>			
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2050	3 621	693	531	5,000 %, échéant le 22 févr. 2027	100 EUR	136	153
1,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2053	4 075	771	652	6,250 %, échéant le 22 sept. 2032	200 USD	273	283
<b>Nykredit Realkredit AS</b>				Total - Hongrie			
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2024	4 300	820	839			409	436
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2050	2 961	562	455	<b>IRLANDE 2,2 %</b>			
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2053	550	112	84	<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 2,0 %</b>			
1,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2053	9 133	1 743	1 407	<b>Accunia European CLO DAC</b>			
<b>Realkredit Danmark AS</b>				4,915 %, échéant le 15 juill. 2030			
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2024	9 000	1 722	1 766		152 EUR	230	222
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2024	8 000	1 525	1 559	<b>Aurium CLO DAC</b>			
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2050	2 895	522	445	4,695 %, échéant le 16 janv. 2031			
1,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2053	376	67	57		599	858	866
1,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2053	1 182	224	180	<b>Blackrock European CLO DAC</b>			
Total - Danemark		14 746	13 909	4,585 %, échéant le 15 oct. 2031			
					295	450	424
				<b>BlueMountain Fuji EUR CLO DAC</b>			
				4,615 %, échéant le 15 juill. 2030			
					197	303	287
				<b>CVC Cordatus Loan Fund DAC</b>			
				4,615 %, échéant le 15 oct. 2031			
					200	306	288
				<b>Dryden Euro CLO DAC</b>			
				4,625 %, échéant le 15 avr. 2033			
					249	379	359
				<b>Griffith Park CLO DAC</b>			
				4,704 %, échéant le 21 nov. 2031			
					398	601	574
				<b>Harvest CLO DAC</b>			
				4,605 %, échéant le 15 oct. 2031			
					391	602	562
				<b>Jubilee CLO DAC</b>			
				4,565 %, échéant le 15 avr. 2030			
					275	421	399
				4,575 %, échéant le 15 avr. 2030			
					283	433	412
				<b>LT Autorahoitus DAC</b>			
				4,534 %, échéant le 18 juill. 2033			
					288	428	423
						5 011	4 816
				<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
				<b>AerCap Ireland Capital DAC</b>			
				1,650 %, échéant le 29 oct. 2024			
					200 USD	247	256
				<b>Roadster Finance DAC</b>			
				2,375 %, échéant le 8 déc. 2032			
					100 EUR	151	129
						398	385
				Total - Irlande			
						5 409	5 201
				<b>ISRAËL 0,9 %</b>			
				<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,9 %</b>			
				<b>Obligation internationale du gouvernement d'Israël</b>			
				5,000 %, échéant le 30 oct. 2026			
					1 500 EUR	2 171	2 246
				Total - Israël			
						2 171	2 246
				<b>ITALIE 0,7 %</b>			
				<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>			
				<b>AMCO - Asset Management Co. SpA</b>			
				0,750 %, échéant le 20 avr. 2028			
					300 EUR	447	386
				<b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b>			
				0,875 %, échéant le 8 oct. 2027			
					300	432	410
				6,750 %, échéant le 5 sept. 2027			
					200	295	306
						1 174	1 102

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,2 %</b>			
Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 %, échéant le 5 mai 2026	300 USD	407 \$	397 \$
Total - Italie		<u>1 581</u>	<u>1 499</u>
<b>JAPON 5,9 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,6 %</b>			
Nomura Holdings, Inc. 2,329 %, échéant le 22 janv. 2027	200 USD	254	243
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,409 %, échéant le 7 nov. 2029	400 EUR	582	500
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,520 %, échéant le 13 janv. 2028	500 USD	684	679
		<u>1 520</u>	<u>1 422</u>
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 5,3 %</b>			
Development Bank of Japan, Inc. 0,500 %, échéant le 27 août 2025	500	667	617
Japan Finance Organization for Municipalities 0,625 %, échéant le 2 sept. 2025	400	524	494
<b>Obligations internationales du gouvernement du Japon</b>			
0,005 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2024	160 000 JPY	1 655	1 504
0,005 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2024	180 000	1 845	1 692
0,005 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2024	350 000	3 445	3 291
0,100 %, échéant le 10 mars 2028 <sup>d)</sup>	183 245	2 088	1 810
0,500 %, échéant le 20 mars 2049	129 000	1 567	941
0,700 %, échéant le 20 juin 2051	119 000	1 381	889
1,500 %, échéant le 20 sept. 2043	150 000	1 444	1 436
		<u>14 616</u>	<u>12 674</u>
Total - Japon		<u>16 136</u>	<u>14 096</u>
<b>JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES 0,8 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 0,6 %</b>			
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. 6,957 %, échéant le 24 oct. 2032	500 USD	686	662
Saranac CLO Ltd. 6,781 %, échéant le 13 août 2031	666	836	883
		<u>1 522</u>	<u>1 545</u>
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
G City Europe Ltd. 4,250 %, échéant le 11 sept. 2025	300 EUR	447	404
Total - Jersey, Îles anglo-normandes		<u>1 969</u>	<u>1 949</u>
ACTIONS			
<b>LUXEMBOURG 0,3 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,0 %</b>			
Drillco Holding Lux SA <sup>a)</sup>	3 191	85	105
VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
CPI Property Group SA 1,750 %, échéant le 14 janv. 2030	500 EUR	704	418
FORESEA Holding SA 7,500 %, échéant le 15 juin 2030	33 USD	38	40
		<u>742</u>	<u>458</u>

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 0,1 %</b>			
Miravet SARL - Compartiment 4,806 %, échéant le 26 mai 2065	194 EUR	294 \$	281 \$
Total - Luxembourg		<u>1 121</u>	<u>844</u>
<b>MALAISIE 0,2 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
Petronas Capital Ltd. 2,480 %, échéant le 28 janv. 2032	400 USD	500	453
Total - Malaisie		<u>500</u>	<u>453</u>
<b>PAYS-BAS 0,6 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>			
CTP NV 0,500 %, échéant le 21 juin 2025	500 EUR	733	690
ING Groep NV 2,125 %, échéant le 23 mai 2026	300	402	429
		<u>1 135</u>	<u>1 119</u>
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 0,1 %</b>			
Jubilee Place BV 4,815 %, échéant le 17 juill. 2058	241	357	352
Total - Pays-Bas		<u>1 492</u>	<u>1 471</u>
<b>NORVÈGE 0,1 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,1 %</b>			
Obligations internationales du gouvernement de la Norvège 1,750 %, échéant le 13 mars 2025	1 500 NOK	237	191
Total - Norvège		<u>237</u>	<u>191</u>
<b>PÉROU 0,3 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,3 %</b>			
Obligations internationales du gouvernement du Pérou 8,200 %, échéant le 12 août 2026	1 900 PEN	919	723
Total - Pérou		<u>919</u>	<u>723</u>
<b>POLOGNE 0,3 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,3 %</b>			
Obligations internationales du gouvernement de la Pologne 3,875 %, échéant le 14 févr. 2033	200 EUR	286	305
4,250 %, échéant le 14 févr. 2043	100	143	154
4,875 %, échéant le 4 oct. 2033	100 USD	135	135
5,500 %, échéant le 16 nov. 2027	100	134	138
Total - Pologne		<u>698</u>	<u>732</u>
<b>QATAR 0,1 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %</b>			
QatarEnergy 2,250 %, échéant le 12 juill. 2031	200 USD	245	226
Total - Qatar		<u>245</u>	<u>226</u>
<b>ROUMANIE 0,5 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,5 %</b>			
Obligations internationales du gouvernement de la Roumanie 2,000 %, échéant le 14 avr. 2033	200 EUR	296	220
2,750 %, échéant le 14 avr. 2041	100	149	98

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
2,875 %, échéant le 13 avr. 2042	300 EUR	434 \$	298 \$
6,625 %, échéant le 27 sept. 2029	300	450	470
Total - Roumanie		1 329	1 086

### ARABIE SAOUDITE 0,4 %

#### OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %

<b>Saudi Arabian Oil Co.</b>			
2,250 %, échéant le 24 nov. 2030	200 USD	221	228

### ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,3 %

<b>Obligations internationales du gouvernement de l'Arabie saoudite</b>			
4,750 %, échéant le 18 janv. 2028	400	535	536
4,875 %, échéant le 18 juill. 2033	200	266	271
		801	807
Total - Arabie saoudite		1 022	1 035

### SERBIE 0,1 %

#### ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,1 %

<b>Obligations internationales du gouvernement de la Serbie</b>			
1,000 %, échéant le 23 sept. 2028	100 EUR	147	124
2,050 %, échéant le 23 sept. 2036	100	144	102
Total - Serbie		291	226

### SLOVÉNIE 0,1 %

#### OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %

<b>Nova Kreditna Banka Maribor dd</b>			
1,875 %, échéant le 27 janv. 2025	200 EUR	283	291
Total - Slovénie		283	291

### CORÉE DU SUD 1,9 %

#### OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,3 %

<b>Korea Southern Power Co. Ltd.</b>			
5,375 %, échéant le 21 sept. 2026	600 USD	807	803

### ÉMISSIONS SOUVERAINES 1,6 %

<b>Obligations internationales du gouvernement de la Corée</b>			
2,375 %, échéant le 10 déc. 2028	314 680 KRW	301	312
2,625 %, échéant le 10 juin 2028	282 520	277	285
3,250 %, échéant le 10 mars 2028	281 020	286	290
3,250 %, échéant le 10 juin 2033	814 790	812	843
4,250 %, échéant le 10 déc. 2032	1 478 100	1 605	1 644
<b>Korea Housing Finance Corp.</b>			
5,375 %, échéant le 15 nov. 2026	400 USD	550	540
		3 831	3 914
Total - Corée du Sud		4 638	4 717

### ESPAGNE 0,9 %

#### TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 0,0 %

<b>BBVA Consumer Auto</b>			
0,270 %, échéant le 20 juill. 2031	30 EUR	42	42

#### OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %

<b>Banco Santander SA</b>			
1,849 %, échéant le 25 mars 2026	200 USD	252	246
6,607 %, échéant le 7 nov. 2028	200	276	282
		528	528

### ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,7 %

<b>Communauté autonome de Catalogne</b>			
4,220 %, échéant le 26 avr. 2035	100 EUR	171 \$	150 \$
<b>Communauté autonome de Madrid</b>			
1,571 %, échéant le 30 avr. 2029	400	599	550
<b>Obligations internationales du gouvernement d'Espagne</b>			
3,450 %, échéant le 30 juill. 2066	800 EUR	1 760	1 097
		2 530	1 797
Total - Espagne		3 100	2 367

### SWEDEN 0,1 %

#### OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %

<b>EQT AB</b>			
2,375 %, échéant le 6 avr. 2028	200 EUR	277	277
Total - Suède		277	277

### SUISSE 1,1 %

#### OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,1 %

<b>Credit Suisse AG</b>			
5,779 %, échéant le 2 févr. 2024	300 USD	403	397
<b>UBS Group AG</b>			
6,246 %, échéant le 22 sept. 2029	200	270	277
6,373 %, échéant le 15 juill. 2026	400	539	536
6,537 %, échéant le 12 août 2033	400	514	566
7,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2029	200 EUR	284	338
9,016 %, échéant le 15 nov. 2033	300 USD	479	489
Total - Suisse		2 489	2 603

### ROYAUME-UNI 7,1 %

#### OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 2,5 %

<b>Haleon U.K. Capital PLC</b>			
3,125 %, échéant le 24 mars 2025	300 USD	377	389
<b>HSBC Holdings PLC</b>			
4,292 %, échéant le 12 sept. 2026	500	659	649
5,210 %, échéant le 11 août 2028	300	382	398
<b>Nationwide Building Society</b>			
6,557 %, échéant le 18 oct. 2027	500	680	686
<b>NatWest Group PLC</b>			
5,076 %, échéant le 27 janv. 2030	400	518	522
<b>Santander U.K. Group Holdings PLC</b>			
6,534 %, échéant le 10 janv. 2029	400	547	549
7,482 %, échéant le 29 août 2029	400 GBP	690	735
<b>Standard Chartered PLC</b>			
1,822 %, échéant le 23 nov. 2025	500 USD	628	638
2,608 %, échéant le 12 janv. 2028	200	255	243
2,678 %, échéant le 29 juin 2032	700	862	755
6,750 %, échéant le 8 févr. 2028	400	554	546
		6 152	6 110

#### TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 3,9 %

<b>Barley Hill No. 2 PLC</b>			
6,118 %, échéant le 27 août 2058	191 GBP	330	321
<b>Canada Square Funding PLC</b>			
6,000 %, échéant le 17 juin 2058	270	463	453
<b>Eurohome U.K. Mortgages PLC</b>			
5,490 %, échéant le 15 juin 2044	91	158	151
<b>London Wall Mortgage Capital PLC</b>			
5,970 %, échéant le 15 mai 2051	368	626	618

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Mortimer BTL PLC</b>				<b>GSAMP Trust</b>			
5,920 %, échéant le 23 juin 2053	347 GBP	594 \$	583 \$	5,970 %, échéant le 25 mai 2046	353 USD	454 \$	438 \$
<b>Polaris PLC</b>				6,055 %, échéant le 25 janv. 2036	10	9	14
5,985 %, échéant le 23 déc. 2058	234	407	394	6,190 %, échéant le 25 nov. 2035	716	853	769
<b>Resloc U.K. PLC</b>				<b>Home Equity Asset Trust</b>			
5,499 %, échéant le 15 déc. 2043	223	339	364	5,770 %, échéant le 25 oct. 2036	34	43	45
<b>Ripon Mortgages PLC</b>				<b>HSI Asset Securitization Corp. Trust</b>			
5,920 %, échéant le 28 août 2056	1 368	2 358	2 303	5,810 %, échéant le 25 déc. 2036	99	66	35
<b>RMAC Securities PLC</b>				<b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b>			
5,509 %, échéant le 12 juin 2044	284	498	462	5,690 %, échéant le 25 août 2036	140	100	72
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>				5,950 %, échéant le 25 août 2036	139	99	71
5,951 %, échéant le 20 janv. 2054	357	609	602	<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>			
6,069 %, échéant le 25 sept. 2051	307	539	518	5,600 %, échéant le 25 oct. 2036	58	64	66
6,120 %, échéant le 12 mars 2052	286	490	483	5,650 %, échéant le 25 mars 2037	264	193	150
6,121 %, échéant le 20 juill. 2060	407	714	687	5,670 %, échéant le 25 févr. 2037	1 065	829	669
<b>Towd Point Mortgage Funding</b>				5,770 %, échéant le 25 sept. 2036	260	195	122
6,365 %, échéant le 20 oct. 2051	143	253	241	<b>Nationstar Home Equity Loan Trust</b>			
<b>Trinity Square PLC</b>				5,740 %, échéant le 25 mars 2037	839	996	1 087
6,070 %, échéant le 15 juill. 2059	226	391	382	<b>New Century Home Equity Loan Trust</b>			
<b>Twin Bridges PLC</b>				3,699 %, échéant le 20 juin 2031	284	365	342
6,070 %, échéant le 12 mars 2055	403	712	678	6,175 %, échéant le 25 févr. 2036	800	973	910
		<u>9 481</u>	<u>9 240</u>	<b>Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust</b>			
				5,905 %, échéant le 25 mars 2036	214	221	280
				6,100 %, échéant le 25 févr. 2036	672	828	799
				<b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>			
				2,907 %, échéant le 25 janv. 2036	87	114	114
				6,010 %, échéant le 25 mai 2036	400	500	500
				<b>Option One Mortgage Loan Trust</b>			
				5,610 %, échéant le 25 mars 2037	68	80	80
				<b>Park Place Securities, Inc.</b>			
				6,205 %, échéant le 25 sept. 2035	574	726	744
				<b>People's Choice Home Loan Securities Trust</b>			
				6,415 %, échéant le 25 mai 2035	254	183	307
				<b>PRET LLC</b>			
				1,744 %, échéant le 25 juill. 2051	362	458	463
				<b>Renaissance Home Equity Loan Trust</b>			
				7,238 %, échéant le 25 sept. 2037	420	358	237
				<b>Residential Asset Mortgage Products Trust</b>			
				6,115 %, échéant le 25 févr. 2036	700	816	881
				6,520 %, échéant le 25 sept. 2035	600	685	685
				<b>SMB Private Education Loan Trust</b>			
				1,290 %, échéant le 15 juill. 2053	152	203	182
				6,576 %, échéant le 15 juill. 2053	38	51	50
				<b>Soundview Home Loan Trust</b>			
				5,730 %, échéant le 25 févr. 2037	1 267	648	475
				5,970 %, échéant le 25 nov. 2036	299	368	374
				<b>Specialty Underwriting &amp; Residential Finance Trust</b>			
				5,770 %, échéant le 25 sept. 2037	1 133	1 142	1 032
				<b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>			
				5,995 %, échéant le 25 juill. 2036	441	538	557
				<b>Terwin Mortgage Trust</b>			
				6,410 %, échéant le 25 nov. 2033	4	6	5
				<b>Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.</b>			
				5,102 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2035	100	138	135
				<b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b>			
				5,815 %, échéant le 25 janv. 2037	450	438	576
						<u>20 825</u>	<u>20 272</u>
				<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 2,8 %</b>			
				<b>Ally Financial, Inc.</b>			
				5,800 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2025	200	266	265

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Charter Communications Operating LLC</b>				6,000 %, échéant le 25 févr. 2037	79 USD	79 \$	49 \$
3,750 %, échéant le 15 févr. 2028	300 USD	392 \$	375 \$	6,090 %, échéant le 25 févr. 2035	139	175	163
<b>Citigroup, Inc.</b>				<b>Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust</b>			
3,290 %, échéant le 17 mars 2026	400	511	516	5,850 %, échéant le 25 août 2047	79	73	93
<b>Corebridge Financial, Inc.</b>				<b>Extended Stay America Trust</b>			
3,500 %, échéant le 4 avr. 2025	200	250	259	6,556 %, échéant le 15 juill. 2038	653	805	858
Credit Suisse AG AT1 Claim	400	0	64	<b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust</b>			
<b>Doctors Co. An Interinsurance Exchange</b>				6,143 %, échéant le 25 avr. 2036	37	34	41
4,500 %, échéant le 18 janv. 2032	100	125	106	<b>IndyMac INDA Mortgage Loan Trust</b>			
<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>				4,547 %, échéant le 25 août 2037	84	78	105
3,375 %, échéant le 13 nov. 2025	200	261	254	<b>JP Morgan Alternative Loan Trust</b>			
3,815 %, échéant le 2 nov. 2027	200	266	248	4,531 %, échéant le 25 déc. 2036	10	9	12
<b>GA Global Funding Trust</b>				<b>JP Morgan Mortgage Trust</b>			
2,250 %, échéant le 6 janv. 2027	200	255	241	3,500 %, échéant le 25 mai 2050	173	219	203
<b>GLP Capital LP</b>				5,000 %, échéant le 25 mai 2052	588	745	723
5,250 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2025	200	266	264	<b>MASTR Alternative Loan Trust</b>			
5,300 %, échéant le 15 janv. 2029	100	130	132	6,750 %, échéant le 25 juill. 2036	395	313	187
<b>JPMorgan Chase Bank NA</b>				<b>MASTR Asset Securitization Trust</b>			
5,110 %, échéant le 8 déc. 2026	450	612	602	6,000 %, échéant le 25 juin 2036	18	23	14
6,417 %, échéant le 8 déc. 2026	250	340	333	<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>			
<b>Morgan Stanley</b>				4,521 %, échéant le 25 mai 2036	99	85	72
2,103 %, échéant le 8 mai 2026	300 EUR	406	429	<b>Nomura Resecuritization Trust</b>			
5,164 %, échéant le 20 avr. 2029	400 USD	538	533	6,370 %, échéant le 25 mars 2037	218	285	277
<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>				<b>NYO Commercial Mortgage Trust</b>			
3,500 %, échéant le 15 juin 2025	100	141	128	6,571 %, échéant le 15 nov. 2038	700	867	858
4,200 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2029	200	254	251	<b>OBX Trust</b>			
4,450 %, échéant le 15 avr. 2042	100	138	107	6,465 %, échéant le 25 oct. 2063	496	673	666
<b>Southern California Edison Co.</b>				<b>Prime Mortgage Trust</b>			
6,266 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2024	100	126	132	6,000 %, échéant le 25 juin 2036	2	2	3
<b>Wells Fargo Bank NA</b>				<b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>			
5,254 %, échéant le 11 déc. 2026	600	812	805	6,000 %, échéant le 25 juin 2036	194	209	198
6,488 %, échéant le 11 déc. 2026	500	677	667	<b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b>			
		<u>6 766</u>	<u>6 711</u>	6,000 %, échéant le 25 juin 2037	34	31	32
				<b>Fiducie de prêts hypothécaires à taux variable structurés</b>			
				5,790 %, échéant le 25 oct. 2035	8	7	10
				5,910 %, échéant le 25 juin 2037	58	52	62
				<b>Structured Asset Securities Corp.</b>			
				5,750 %, échéant le 25 janv. 2036	45	56	49
				<b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>			
				6,190 %, échéant le 25 nov. 2035	557	673	592
				<b>Towd Point Mortgage Trust</b>			
				1,636 %, échéant le 25 avr. 2060	224	300	264
				2,710 %, échéant le 25 janv. 2060	174	238	216
				2,900 %, échéant le 25 oct. 2059	626	829	779
				3,250 %, échéant le 25 juill. 2056	800	1 029	1 030
				<b>VASA Trust</b>			
				6,376 %, échéant le 15 juill. 2039	600	753	720
				<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>			
				4,172 %, échéant le 25 sept. 2036	21	26	23
				6,030 %, échéant le 25 nov. 2045	6	5	7
				<b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>			
				5,782 %, échéant le 25 avr. 2047	139	122	143
				5,790 %, échéant le 25 févr. 2037	114	95	116
						<u>11 071</u>	<u>10 561</u>
				<b>ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX AMÉRICAINS 9,9 %</b>			
				<b>Ginnie Mae</b>			
				3,000 %, échéant le 20 juill. 2046	4	6	5
				6,114 %, échéant le 20 sept. 2066	135	200	182
				<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme</b>			
				3,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2042 -			
				1 <sup>er</sup> août 2043	127	138	154
				4,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2041	34	33	44

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, à déterminer</b>			
2,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	200 USD	217 \$	217 \$
4,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	4 800	6 026	6 022
4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	10 000	12 915	12 854
6,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	1 800	2 437	2 422
6,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	1 400	1 924	1 901
		<u>23 896</u>	<u>23 801</u>
<b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR DES ÉTATS-UNIS 2,7 %</b>			
<b>Obligations du Trésor des États-Unis</b>			
1,625 %, échéant le 15 nov. 2050	100	133	79
<b>Titres du Trésor des É.-U. indexés sur l'inflation<sup>d)</sup></b>			
0,125 %, échéant le 15 oct. 2024	240	317	311
0,125 %, échéant le 15 avr. 2025	1 429	1 899	1 827
0,125 %, échéant le 15 janv. 2032	111	131	129
0,250 %, échéant le 15 janv. 2025	1 559	2 073	2 005
0,625 %, échéant le 15 juill. 2032	106	133	128
1,125 %, échéant le 15 janv. 2033	930	1 260	1 166
1,375 %, échéant le 15 juill. 2033	405	518	521
<b>Obligations du Trésor des États-Unis</b>			
3,500 %, échéant le 15 févr. 2033	200	276	257
		<u>6 740</u>	<u>6 423</u>
Total - États-Unis		<u>70 275</u>	<u>68 687</u>
<b>INSTRUMENTS À COURT TERME 30,7 %</b>			
<b>BILLETS DE TRÉSORERIE 0,7 %</b>			
<b>AT&amp;T, Inc.</b>			
5,700 %, échéant le 19 mars 2024	750 USD	997	981
<b>L3Harris Technologies, Inc.</b>			
5,800 %, échéant le 16 janv. 2024	300	410	397
<b>Southern California Edison Co.</b>			
5,800 %, échéant le 2 janv. 2024	300	413	397
		<u>1 820</u>	<u>1 775</u>

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PRISES EN PENSION<sup>f)</sup> 7,3 %</b>			
		<u>17 441 \$</u>	<u>17 442 \$</u>
<b>BILLETS À COURT TERME 0,0 %</b>			
<b>Obligations du Trésor de l'Argentine, BONCER</b>			
3,750 %, échéant le 20 mai 2024	2 813 ARS	5	4
<b>BONS DU TRÉSOR DE LA HONGRIE 1,1 %</b>			
10,900 %, échéant le 4 janv. 2024 <sup>b), c)</sup>	719 000 HUF	2 754	2 745
<b>BONS DU TRÉSOR DU JAPON 21,6 %</b>			
(0,270 %), échéant le 4 avr. 2024 <sup>b), c)</sup>	47 000 JPY	438	442
(0,261 %), échéant le 4 avr. 2024 <sup>b), c)</sup>	143 000	1 332	1 345
(0,257 %), échéant le 4 avr. 2024 <sup>b), c)</sup>	610 000	5 681	5 735
(0,245 %), échéant le 4 mars 2024 <sup>b), c)</sup>	1 230 000	11 226	11 562
(0,202 %), échéant le 13 févr. 2024 <sup>b), c)</sup>	770 000	7 033	7 237
(0,191 %), échéant le 25 mars 2024 <sup>b), c)</sup>	1 190 000	11 198	11 187
(0,174 %), échéant le 18 mars 2024 <sup>b), c)</sup>	1 301 000	12 196	12 231
(0,156 %), échéant le 18 mars 2024 <sup>b), c)</sup>	209 000	1 959	1 965
		<u>51 063</u>	<u>51 704</u>
Total - Placements à court terme		<u>73 083</u>	<u>73 670</u>
Total - Placements dans des titres		<u>252 002</u>	<u>243 821</u>
<b>Total - Placements 101,7 %</b>		<b><u>252 002 \$</u></b>	<b><u>243 821 \$</u></b>
<b>Instruments financiers dérivés<sup>g), h)</sup> 1,6 %</b>			
		139	3 816
<b>Passifs, moins les autres actifs (3,3) %</b>			
			<u>(7 962)</u>
<b>Total de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables 100,0 %</b>			
			<b><u>239 675 \$</u></b>

**NOTES À L'INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE :**

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

- a) Titre n'ayant produit aucun revenu au cours des douze derniers mois.  
b) Titre à coupon zéro.  
c) Coupon représentant un rendement à l'échéance.  
d) Le montant du capital du titre est indexé selon l'inflation.  
e) Titre perpétuel; la date indiquée, le cas échéant, est la prochaine date de remboursement anticipé.

**EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT****f) PRISES EN PENSION :**

Contrepartie	Taux de financement	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du capital	Garanti par	Garanties (reçues)	Prises en pension, à la valeur	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>
RBC	5,000 %	29 déc. 2023	2 janv. 2024	17 300 \$	Province de Québec, 3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2045	(17 707) \$	17 300 \$	17 310 \$
SSB	2,600	29 déc. 2023	2 janv. 2024	107 USD	Obligations du Trésor des États-Unis, 0,250 %, échéant le 31 oct. 2025 <sup>2)</sup>	(144)	142	142
<b>Total - Prises en pension de titres</b>						<b>(17 851) \$</b>	<b>17 442 \$</b>	<b>17 452 \$</b>

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

<sup>2)</sup> La garantie en dépôt est détenue par une contrepartie.

Le solde moyen des emprunts pendant l'exercice clos le 31 décembre 2023 était de (5) \$ à un taux d'intérêt pondéré moyen de 5,025 %. Les emprunts peuvent comprendre des mises en pension et des accords cadres sur transactions à livrer.

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (suite)

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et des autres opérations de financement et des garanties données/(reçues).

### g) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE

#### CONTRATS À TERME :

Description	Type	Mois de l'échéance	Nombre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	Marge de variation	
					Actif	Passif
Contrats à terme sur EURIBOR à 3 mois, mars	Position longue	Mars 2024	126	28 \$	7 \$	(5) \$
Contrats à terme sur EURIBOR à 3 mois, mars	Position longue	Mars 2025	126	150	14	(25)
Contrats à terme sur EURIBOR à 3 mois, septembre	Position courte	Sept. 2024	252	(219)	46	(23)
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, décembre	Position courte	Mars 2025	202	(351)	0	(23)
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, juin	Position courte	Sept. 2024	29	(19)	0	(2)
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, juin	Position longue	Sept. 2025	50	99	7	0
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, mars	Position longue	Juin 2024	201	107	7	0
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, septembre	Position courte	Déc. 2024	72	(61)	0	(7)
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, septembre	Position longue	Déc. 2025	50	99	7	0
Contrats à terme sur obligations du gouvernement de l'Australie à 3 ans, mars	Position courte	Mars 2024	11	(11)	1	(2)
Contrats à terme sur obligations du gouvernement de l'Australie à 10 ans, mars	Position courte	Mars 2024	59	(184)	31	(39)
Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada à 10 ans, mars	Position longue	Mars 2024	33	177	1	0
Contrats à terme Euro-Bobl, mars	Position courte	Mars 2024	66	(185)	45	0
Contrats à terme Euro-BTP, mars	Position courte	Mars 2024	1	(6)	3	0
Contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans, mars	Position courte	Mars 2024	2	(33)	11	0
Contrats à terme Euro-Oat, mars	Position courte	Mars 2024	81	(440)	187	0
Contrats à terme Euro-Schatz, mars	Position courte	Mars 2024	12	(12)	1	(1)
Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans, mars	Position courte	Mars 2024	6	(72)	19	(12)
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 2 ans, mars	Position courte	Mars 2024	12	(33)	0	(2)
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 5 ans, mars	Position courte	Mars 2024	87	(312)	0	(10)
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position courte	Mars 2024	49	(230)	0	0
Contrats à terme Ultra sur obligations à long terme du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position courte	Mars 2024	14	(95)	2	0
Contrats à terme sur obligations à long terme du Trésor des É.-U., mars	Position longue	Mars 2024	1	12	0	0
Contrats à terme Ultra sur obligations à long terme du Trésor des É.-U., mars	Position courte	Mars 2024	1	(15)	1	0
Contrats à terme sur obligations du Royaume-Uni à long terme, mars	Position courte	Mars 2024	103	(1 224)	195	0
<b>Total des contrats à terme</b>				<b>(2 830) \$</b>	<b>585 \$</b>	<b>(151) \$</b>

#### SWAPS :

##### SWAPS SUR DÉFAILLANCE DE TITRES DE SOCIÉTÉS - PROTECTION À LA VENTE <sup>1)</sup>

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>3)</sup>	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste Valeur <sup>4)</sup>	Marge de variation	
						Actif	Passif
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20 juin 2025	200 USD	5 \$	16 \$	0 \$	0 \$

##### SWAPS SUR DÉFAILLANCE D'INDICES DE CRÉDIT - PROTECTION À L'ACHAT <sup>2)</sup>

Indice/tranches	Taux (à payer) fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>3)</sup>	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste Valeur <sup>4)</sup>	Marge de variation	
						Actif	Passif
Indice CDX.IG-40 à 10 ans	(1,000) %	20 juin 2033	870 USD	(14) \$	(5) \$	0 \$	0 \$
Indice CDX.IG-41 à 5 ans	(1,000)	20 déc. 2028	2 700	(7)	(69)	1	0
Indice CDX.IG-41 à 10 ans	(1,000)	20 déc. 2033	11 000	(166)	(21)	7	0
				<b>(187) \$</b>	<b>(95) \$</b>	<b>8 \$</b>	<b>0 \$</b>

<sup>1)</sup> Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, le Fonds soit i) versera à l'acheteur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et prendra livraison de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) paiera un montant net de règlement, sous forme de trésorerie, de titres ou d'autres obligations livrables, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence.

<sup>2)</sup> Si le Fonds est acheteur de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, le Fonds soit i) recevra de la part du vendeur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et livrera l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) recevra un montant net de règlement, sous forme de trésorerie, de titres ou d'autres obligations livrables, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence.

<sup>3)</sup> Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait devoir payer en tant que vendeur de protection de crédit ou recevoir en tant qu'acheteur de protection de crédit en cas d'incident de crédit, conformément aux dispositions du swap en question.

<sup>4)</sup> Les cours et les valeurs résultantes des swaps sur défaillance permettent de suivre l'évolution du risque de paiement/rendement et déterminent la probabilité qu'un passif (ou un actif) attendu sur le dérivé de crédit soit réalisé si le swap est dénoué ou si le notionnel est vendu à la clôture de la période. L'augmentation des justes valeurs en termes absolus, lorsque comparées aux valeurs notionnelles du swap, indique un affaiblissement du niveau de solvabilité de l'instrument référencé sous-jacent et une plus grande probabilité de défaillance ou de risque de défaillance, ou de survenance d'autres incidents de crédit définis dans les dispositions de l'accord.

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	Marge de variation	
							Actif	Passif
À recevoir	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	5,500 %	20 mars 2026	300 GBP	(12) \$	(16) \$	0 \$	0 \$
À payer	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	3,000	17 juin 2027	9 900	32	1	0	(21)
À payer	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	5,000	20 mars 2029	6 600	219	866	0	(31)
À payer	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	4,500	20 mars 2034	13 600	1 724	2 405	0	(200)
À recevoir	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	3,000	17 juin 2035	2 100	(7)	40	33	0
À recevoir	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	4,250	20 mars 2054	200	(42)	(57)	8	0
À recevoir	MIBOR en INR à un jour-OIS composé	6,250	20 mars 2029	116 690 INR	2	(10)	0	(3)
À recevoir	MUTKCALM en JPY à un jour-OIS composé	0,000	15 déc. 2026	150 000 JPY	(11)	12	0	0
À payer	MUTKCALM en JPY à un jour-OIS composé	0,000	15 déc. 2028	1 190 000	(229)	(253)	0	(3)
À payer	MUTKCALM en JPY à un jour-OIS composé	0,000	17 août 2031	138 440	(56)	(66)	0	(1)
À recevoir	MUTKCALM en JPY à un jour-OIS composé	0,686	10 avr. 2033	900 000	104	83	3	0
À recevoir	MUTKCALM en JPY à un jour-OIS composé	0,850	20 sept. 2033	550 000	84	(13)	3	0
À recevoir	MUTKCALM en JPY à un jour-OIS composé	0,400	19 juin 2039	330 000	346	354	10	0
À recevoir	MUTKCALM en JPY à un jour-OIS composé	0,450	15 déc. 2051	140 000	95	302	13	0
À recevoir	MUTKCALM en JPY à un jour-OIS composé	0,800	15 juin 2052	120 000	163	169	12	0
À recevoir	SIBCSORA en SGD à un jour-OIS composé	2,750	20 mars 2029	4 868 SGD	(44)	(54)	0	(9)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,117	31 mars 2024	8 057 USD	71	88	4	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,750	15 juin 2024	17 900	(732)	385	11	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,968	30 juin 2024	7 000	(104)	(104)	0	(3)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,159	31 mars 2025	11 600	120	79	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,750	21 juin 2025	1 100	1	(14)	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,228	30 août 2025	14 300	(87)	(90)	0	(5)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,000	16 déc. 2025	17 800	(2 131)	(1 491)	0	(4)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,250	20 déc. 2025	8 100	(97)	(30)	0	(3)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,965	30 nov. 2026	6 980	208	207	0	(2)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,000	15 juin 2027	7 000	410	798	2	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,981	30 nov. 2027	3 300	58	58	2	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,988	30 nov. 2027	2 600	94	46	1	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,193	30 nov. 2027	900	26	25	1	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	0,500	16 juin 2028	100	(12)	(18)	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,250	21 juin 2028	1 600	4	(28)	1	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,250	15 déc. 2028	600	79	82	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,750	20 déc. 2028	5 300	55	70	3	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,250	20 mars 2029	400	2	20	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,730	30 avr. 2029	960	48	48	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,750	30 avr. 2029	980	48	48	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,163	30 sept. 2029	1 000	(23)	(23)	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,225	30 sept. 2029	9 000	(172)	(172)	2	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,525	2 mars 2030	200	1	0	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,849	31 mars 2030	100	3	3	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,857	31 mars 2030	500	13	14	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,951	31 mars 2030	300	10	10	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	22 juin 2030	400	2	0	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,488	15 août 2031	2 400	(419)	(419)	0	(2)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,695	15 nov. 2031	6 500	(1 030)	(1 044)	0	(4)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,750	15 juin 2032	5 150	192	(852)	0	(4)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,100	15 nov. 2032	4 800	(141)	(176)	0	(3)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,000	21 juin 2033	1 970	(18)	(98)	0	(2)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,650	10 juill. 2033	120	3	2	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,760	23 août 2033	300	11	9	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,950	13 sept. 2033	300	17	16	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,165	27 sept. 2033	400	32	30	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,170	3 oct. 2033	200	16	15	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,030	4 oct. 2033	100	6	6	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,175	10 oct. 2033	100	9	8	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,200	18 oct. 2033	400	34	32	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,220	20 oct. 2033	100	8	8	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,230	23 oct. 2033	200	18	17	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,255	23 oct. 2033	100	10	9	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,450	31 oct. 2033	200	23	22	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,450	1 <sup>er</sup> nov. 2033	200	23	22	0	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	20 déc. 2033	19 200	1 631	70	0	(17)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,842	26 déc. 2033	200	(7)	(8)	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,854	29 déc. 2033	300	(11)	(13)	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,684	3 janv. 2034	200	(4)	(5)	0	(5)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,250	20 mars 2034	7 200	73	664	0	(4)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,750	20 juin 2034	1 700	7	71	0	(1)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,500	15 juin 2052	1 500	(477)	(655)	0	(7)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,906	16 sept. 2052	10	(1)	(1)	0	0

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (suite)

Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	Marge de variation		
							Actif	Passif	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,080 %	23 févr. 2053	500 USD	(24) \$	(30) \$	0 \$	(3) \$	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,750	21 juin 2053	710	(71)	(99)	0	(4)	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,250	20 déc. 2053	7 500	(1 205)	110	42	0	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,000	20 mars 2054	3 000	(67)	(532)	17	0	
À payer	Acceptations bancaires en CAD à 3 mois	2,250	15 juin 2027	400 \$	(5)	(19)	0	0	
À payer	Acceptations bancaires en CAD à 3 mois	3,250	21 sept. 2027	2 600	53	(35)	3	0	
À recevoir	Acceptations bancaires en CAD à 3 mois	3,250	15 mars 2028	3 480	55	41	0	(4)	
À recevoir	Acceptations bancaires en CAD à 3 mois	3,250	15 mars 2033	700	8	8	0	(1)	
À recevoir	CNY-CNREPOFIX à 3 mois	2,250	20 mars 2029	127 800 CNY	(140)	40	0	(1)	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 3 mois	2,920	13 déc. 2028	200 EUR	(5)	(6)	1	0	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 3 mois	2,880	19 déc. 2028	800	(22)	(24)	4	0	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 3 mois	2,950	29 déc. 2028	300	(9)	(10)	2	0	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 3 mois	2,760	3 janv. 2029	400	(8)	(9)	0	(9)	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 3 mois	2,990	8 déc. 2033	200	(12)	(13)	3	0	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 3 mois	2,890	22 déc. 2033	500	(23)	(25)	8	0	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 3 mois	2,910	29 déc. 2033	200	(10)	(11)	3	0	
À payer	KORIBOR en KRW à 3 mois	3,500	20 mars 2034	286 860 KRW	3	14	0	0	
À payer	NZD-BBR à 3 mois	1,000	16 juin 2026	3 100 NZD	(19)	(208)	1	0	
À payer	NZD-BBR à 3 mois	3,500	15 juin 2027	5 800	(98)	(115)	7	0	
À payer	NZD-BBR à 3 mois	3,750	15 juin 2027	600	(1)	(8)	1	0	
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	1,750	16 mars 2027	200 AUD	(11)	(12)	0	0	
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	1,000	16 juin 2031	1 400	(132)	(251)	0	(1)	
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	1,750	16 juin 2031	2 150	(332)	(291)	0	(1)	
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	4,250	15 sept. 2032	4 580	9	(9)	5	0	
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	4,500	15 sept. 2032	23 240	471	164	25	0	
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	4,250	15 mars 2033	3 000	(53)	22	2	0	
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	4,000	21 juin 2033	6 200	57	(72)	5	0	
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	4,750	20 déc. 2033	14 000	338	125	10	0	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,536	18 sept. 2025	22 000 EUR	(319)	(319)	0	(1)	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,500	20 mars 2026	33 500	614	871	10	0	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,000	19 mars 2027	3 630	31	93	0	(8)	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	0,910	25 oct. 2027	2 000	(167)	(167)	0	(6)	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,250	20 mars 2029	29 920	1 474	1 828	0	(142)	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	2,550	28 juin 2032	8 500	381	64	0	(81)	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	2,547	9 mars 2033	2 700	224	23	0	(35)	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,020	9 juin 2033	4 000	308	261	0	(56)	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,300	3 oct. 2033	600	64	61	0	(9)	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,250	20 oct. 2033	4 800	544	458	0	(70)	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,305	27 nov. 2033	200	(20)	(21)	3	0	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,000	20 mars 2034	2 310	96	160	0	(34)	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	2,250	21 sept. 2037	1 990	(226)	(104)	0	(38)	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	2,250	21 sept. 2042	430	(68)	(26)	0	(11)	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	0,054	27 mai 2050	100	60	60	2	0	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	0,064	17 nov. 2052	100	69	69	3	0	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	2,750	20 mars 2054	9 300	(1 354)	(1 282)	348	0	
À recevoir	NIBOR en NOK à 6 mois	3,033	15 mars 2028	98 000 NOK	(74)	235	0	(18)	
À payer	Indice CAONREPO	4,600	30 août 2025	17 600 \$	167	172	10	0	
À recevoir	Indice CAONREPO	3,750	20 déc. 2025	1 500	(31)	3	0	(1)	
À payer	Indice CAONREPO	3,250	21 juin 2028	10 500	99	31	13	0	
À recevoir	Indice CAONREPO	3,500	1 <sup>er</sup> juin 2032	1 300	(56)	(47)	0	(2)	
À payer	Indice CAONREPO	3,250	21 juin 2033	2 200	82	32	3	0	
À payer	Indice CAONREPO	3,250	20 déc. 2033	300	13	4	0	0	
À recevoir	Indice CAONREPO	3,750	20 déc. 2033	2 800	(142)	(160)	0	(4)	
À recevoir	Indice CAONREPO	3,250	21 juin 2053	1 300	(47)	(70)	1	0	
À recevoir	CPURNSA	2,335	5 févr. 2028	4 200 USD	470	493	0	(2)	
						1 207 \$	2 971 \$	641 \$	(876) \$
<b>Total des swaps</b>						<b>1 025 \$</b>	<b>2 892 \$</b>	<b>649 \$</b>	<b>(876) \$</b>

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée.

## h) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE

## CONTRATS DE CHANGE À TERME :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente		
				Actif	Passif	
AZD	Janv. 2024	448 AUD	403 \$	0 \$	(2) \$	
	Janv. 2024	463 \$	519 AUD	5	0	
	Janv. 2024	1 910	1 428 USD	0	(18)	
	Janv. 2024	104 NZD	87 \$	0	0	
	Mars 2024	2 811 CNH	390 USD	0	(9)	
BOA	Janv. 2024	668 \$	493	0	(15)	
	Janv. 2024	14 588 HUF	40	0	(3)	
	Févr. 2024	16 USD	113 CNY	0	0	
	Mars 2024	2 030 CNH	281 USD	0	(7)	
	Mars 2024	81 USD	587 CNH	2	0	
BPS	Mars 2024	317	26 540 INR	1	0	
	Juin 2024	114 973 KRW	89 USD	0	(1)	
	Janv. 2024	28 748 HUF	82	0	(1)	
	Janv. 2024	129 USD	44 359 HUF	0	(1)	
	Févr. 2024	2 615 TWD	82 USD	0	(6)	
	Févr. 2024	91 USD	652 CNY	2	0	
	Mars 2024	3 033 CNH	421 USD	0	(9)	
	Mars 2024	3 020 053 IDR	197	1	0	
	Mars 2024	95 355 INR	1 143	1	0	
	Mars 2024	36 787 TWD	1 171	0	(62)	
	Mars 2024	48 USD	746 923 IDR	0	0	
	Mars 2024	1 102	92 184 INR	2	0	
	BRC	Juin 2024	805 441 KRW	617 USD	0	(15)
Oct. 2024		4 813 DKK	704	0	(25)	
Janv. 2024		932 \$	632 EUR	0	(7)	
Janv. 2024		1 349	1 002 USD	0	(22)	
Janv. 2024		357 EUR	527 \$	4	0	
Janv. 2024		304 581 HUF	875 USD	0	(1)	
Janv. 2024		6 302 USD	8 488 \$	140	(1)	
Avril 2024		4 722 DKK	940	10	0	
Avril 2024		80 002 JPY	654 USD	104	0	
Mai 2024		80 000	861 \$	97	0	
CBK	Juin 2024	830 201 KRW	636 USD	0	(15)	
	Janv. 2024	948 AUD	850 \$	0	(6)	
	Janv. 2024	335 \$	372 AUD	1	0	
	Janv. 2024	1 292	959 USD	0	(22)	
	Janv. 2024	11 291 DKK	2 242 \$	27	0	
	Janv. 2024	1 753 HUF	5 USD	0	0	
	Janv. 2024	246 USD	1 199 BRL	1	0	
	Janv. 2024	1 400	1 900 \$	45	0	
	Janv. 2024	706	12 585 MXN	42	0	
	Janv. 2024	112	451 PLN	3	0	
	Févr. 2024	1 239	6 353 BRL	89	0	
	Mars 2024	3 789 CNH	534 USD	0	(1)	
	Mars 2024	1 230 811 JPY	11 423 \$	0	(241)	
	Mars 2024	2 422 PEN	643 USD	0	(13)	
	Avril 2024	1 211 BRL	246	0	(1)	
	GLM	Janv. 2024	1 442 \$	982 EUR	0	(5)
		Janv. 2024	2 227	1 640 USD	0	(54)
Janv. 2024		1 059 CHF	1 639 \$	0	(30)	
Janv. 2024		23 665 DKK	4 685	40	0	
Janv. 2024		230 EUR	337	0	0	
Janv. 2024		7 514 GBP	12 933	242	0	
Janv. 2024		151 800 JPY	1 437	10	0	
Janv. 2024		3 MXN	0 USD	0	0	
Janv. 2024		615 NOK	79 \$	0	(2)	
Janv. 2024		144 USD	700 BRL	0	0	
Janv. 2024		56 402	76 649 \$	1 921	0	
Janv. 2024		753	263 053 HUF	4	0	
Janv. 2024		426	7 480 MXN	16	0	
Janv. 2024		706	2 826 PLN	16	0	
Févr. 2024		11 BRL	2 USD	0	0	
Mars 2024		2 373 CNH	330	0	(6)	
Mars 2024		74 USD	1 132 394 IDR	0	0	
Mars 2024		176	5 449 TWD	6	0	
Avril 2024		8 071 DKK	1 610 \$	21	0	

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente		
				Actif	Passif	
JPM	Avril 2024	800 000 JPY	7 577 \$	0 \$	(59) \$	
	Juill. 2024	700 BRL	141 USD	0	0	
	Janv. 2024	2 196	446	2	(10)	
	Janv. 2024	61 082 HUF	174	0	(3)	
	Janv. 2024	62 USD	300 BRL	0	0	
	Janv. 2024	99	1 732 MXN	3	0	
	Févr. 2024	366 CNY	51 USD	0	(1)	
	Mars 2024	3 422 CNH	476	0	(9)	
	Mars 2024	61 SGD	46	0	(1)	
	Mars 2024	13 USD	200 321 IDR	0	0	
	Mars 2024	331	27 630 INR	1	0	
	Mars 2024	1 621	50 339 TWD	60	0	
	Avril 2024	206	1 006 BRL	0	(1)	
	Juin 2024	801 729 KRW	618 USD	0	(9)	
	Juill. 2024	300 BRL	60	0	0	
	MBC	Oct. 2024	160 000 JPY	1 289	144	0
		Janv. 2024	382 \$	1 945 DKK	0	(1)
Janv. 2024		623	424 EUR	0	(2)	
Janv. 2024		679	5 390 NOK	24	0	
Janv. 2024		730 DKK	144 \$	0	0	
Janv. 2024		14 782 HUF	42 USD	0	(1)	
Janv. 2024		226 600 JPY	2 082 \$	0	(49)	
Janv. 2024		167 USD	61 522 HUF	13	0	
Févr. 2024		770 000 JPY	7 186 \$	0	(90)	
Mars 2024		749 CNH	106 USD	0	0	
Mars 2024		160 000 JPY	1 729 \$	214	0	
Mars 2024		13 013 TWD	412 USD	0	(25)	
Mars 2024		16 USD	244 010 IDR	0	0	
Avril 2024		8 500 DKK	1 658 \$	0	(16)	
Avril 2024		100 003 JPY	1 086	135	0	
Oct. 2024		8 600 DKK	1 689	0	(18)	
MYI		Oct. 2024	120 000 JPY	962 USD	102	0
	Janv. 2024	297 AUD	265 \$	0	(3)	
	Janv. 2024	1 076 \$	800 USD	0	(16)	
	Janv. 2024	237 EUR	348 \$	1	0	
	Janv. 2024	2 463 HUF	7 USD	0	0	
	Janv. 2024	483 MYR	104	0	(3)	
	Janv. 2024	756 USD	1 011 \$	9	0	
	Janv. 2024	26 \$	185 CNY	1	0	
	Févr. 2024	41	295	1	0	
	Mars 2024	2 682 CNH	372 USD	0	(9)	
	Mars 2024	633 USD	9 741 233 IDR	0	(1)	
	Juin 2024	377 845 KRW	291 USD	0	(5)	
	RBC	Mars 2024	2 700 000 JPY	25 905 \$	254	0
		Avril 2024	1 USD	11 MXN	0	0
	RYL	Janv. 2024	126 \$	1 010 NOK	6	0
		Janv. 2024	91 CHF	140 \$	0	(3)
	SCX	Janv. 2024	1 490 NOK	187	0	(7)
Janv. 2024		18 985 EUR	28 332	556	0	
Janv. 2024		28 MYR	6 USD	0	0	
Janv. 2024		26 USD	187 CNY	1	0	
Févr. 2024		189 CNY	26 USD	0	(1)	
Mars 2024		2 633 CNH	364	0	(11)	
Mars 2024		24 663 TWD	781	0	(47)	
Mars 2024		43 USD	653 646 IDR	0	0	
Mars 2024		719	60 154 INR	1	0	
Juin 2024		428 133 KRW	330 USD	0	(5)	
TOR	Mars 2024	1 834 CNH	254	0	(6)	
UAG	Janv. 2024	945 DKK	186 \$	1	0	
	Janv. 2024	29 046 HUF	81 USD	0	(3)	
	Janv. 2024	9 199 USD	12 477 \$	290	0	
<b>Total des contrats de change à terme</b>				<b>4 672 \$</b>	<b>(1 016) \$</b>	

## OPTIONS ACHETÉES

## OPTIONS SUR SWAP DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Valeur notionnelle <sup>1)</sup>	Coût	Juste valeur
BOA	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 2 ans	LIBOR en CAD à 3 mois	À recevoir	9,000 %	20 mars 2024	15 000	2 \$	0 \$
BRC	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 1 an	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	5,500	26 mars 2024	4 000	8	0
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	JPY-LIBOR à 3 mois	À payer	0,050	16 mai 2024	1 400 000	1	2
CBK	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 2 ans	EURIBOR en EUR à 6 mois	À recevoir	4,409	31 janv. 2024	5 000	1	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	À recevoir	8,650	2 févr. 2024	29 000	3	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	À recevoir	10,000	1 <sup>er</sup> mai 2024	12 000	1	0
GLM	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 1 an	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	5,500	26 mars 2024	9 200	19	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 2 ans	EURIBOR en EUR à 6 mois	À recevoir	7,000	2 févr. 2024	15 000	2	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 3 ans	LIBOR en GBP à 6 mois	À recevoir	11,000	22 mai 2024	15 700	3	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	7,750	9 févr. 2024	16 000	2	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en GBP à 6 mois	À recevoir	10,500	28 mars 2024	19 000	3	4
JPM	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 1 an	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	5,500	26 mars 2024	5 400	9	0
MYC	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 1 an	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	5,500	26 mars 2024	5 000	9	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 5 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	7,053	1 <sup>er</sup> févr. 2024	2 000	0	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	7,012	1 <sup>er</sup> févr. 2024	4 000	1	0
							64 \$	6 \$

## OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Valeur notionnelle <sup>1)</sup>	Coût	Juste valeur
BOA	Vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, hors cote, à déterminer, 4,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	50,000 USD	6 févr. 2024	3 200	0 \$	0 \$
	Vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, hors cote, à déterminer, 4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	52,000	6 févr. 2024	6 700	0	0
	Vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, hors cote, à déterminer, 6,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	56,000	6 févr. 2024	126 400	7	0
BPS	Vente - hors cote, obligation du Trésor de la France Euro-OAT, 0,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2052	97,000 EUR	23 mai 2025	300	29	163
					36 \$	163 \$
<b>Total des options achetées</b>					<b>100 \$</b>	<b>169 \$</b>

## OPTIONS VENDUES :

## OPTIONS SUR DEVISES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Valeur notionnelle <sup>1)</sup>	Primes (reçues)	Juste valeur
GLM	Vente - hors cote, USD-TWD	31,000 TWD	4 mars 2024	329	(6) \$	(12) \$
JPM	Vente - hors cote, USD-TWD	31,000	1 <sup>er</sup> mars 2024	901	(17)	(34)
					<b>(23) \$</b>	<b>(46) \$</b>

## OPTIONS SUR SWAP DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Valeur notionnelle <sup>1)</sup>	Primes (reçues)	Juste valeur
BPS	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,545 %	16 janv. 2024	200	(1) \$	(3) \$
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,995	16 janv. 2024	200	(1)	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 25 ans	EURIBOR en EUR à 6 mois	À payer	0,451	23 mai 2025	300	(28)	(151)
CBK	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	EURIBOR en EUR à 6 mois	À recevoir	2,310	18 janv. 2024	100	(1)	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	EURIBOR en EUR à 6 mois	À payer	2,700	18 janv. 2024	100	(1)	0
GLM	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,648	4 janv. 2024	150	(1)	(3)
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,560	5 janv. 2024	100	(1)	(2)
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,594	5 janv. 2024	100	(1)	(2)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,010	5 janv. 2024	100	(1)	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,044	5 janv. 2024	100	(1)	0
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,215	22 janv. 2024	100	(1)	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,665	22 janv. 2024	100	(1)	(1)
MYC	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,670	4 janv. 2024	150	(1)	(4)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,120	4 janv. 2024	150	(1)	0
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,455	8 janv. 2024	150	(1)	(1)
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,475	8 janv. 2024	350	(1)	(3)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,955	8 janv. 2024	150	(1)	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,975	8 janv. 2024	350	(2)	0
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,600	12 janv. 2024	200	(1)	(4)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,050	12 janv. 2024	200	(1)	0
							(48) \$	(174) \$
<b>Total - options vendues</b>							<b>(71) \$</b>	<b>(220) \$</b>

<sup>1)</sup> La valeur notionnelle représente le nombre de contrats.

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (suite)

### SWAPS :

#### SWAPS SUR DÉFAILLANCE D'ÉMISSIONS SOUVERAINES - PROTECTION À L'ACHAT <sup>2)</sup>

Contrepartie	Entité de référence	Taux (à payer) fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>3)</sup>	Primes payées/ (reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Swaps, à la valeur <sup>4)</sup>		
							Actif	Passif	
GST	Obligations internationales du gouvernement de la Corée du Sud	(1,000) %	20 déc. 2028	400 USD	(16) \$	(1) \$	0 \$	(17) \$	
MYC	Obligations internationales du gouvernement de la Corée du Sud	(1,000)	20 déc. 2028	200	(8)	(1)	0	(9)	
	Obligations internationales du gouvernement de la Corée du Sud	(1,000)	20 déc. 2028	200	(8)	(1)	0	(9)	
						<b>(32) \$</b>	<b>(3) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(35) \$</b>

- <sup>2)</sup> Si le Fonds est acheteur de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, le Fonds soit i) recevra de la part du vendeur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et livrera l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) recevra un montant net de règlement, sous forme de trésorerie, de titres ou d'autres obligations livrables, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence.
- <sup>3)</sup> Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait devoir payer en tant que vendeur de protection de crédit ou recevoir en tant qu'acheteur de protection de crédit en cas d'incident de crédit, conformément aux dispositions du swap en question.
- <sup>4)</sup> Les cours et les valeurs résultantes des swaps sur défaillance permettent de suivre l'évolution du risque de paiement/rendement et déterminent la probabilité qu'un passif (ou un actif) attendu sur le dérivé de crédit soit réalisé si le swap est dénoué ou si le notionnel est vendu à la clôture de la période. L'augmentation des justes valeurs en termes absolus, lorsque comparées aux valeurs notionnelles du swap, indique un affaiblissement du niveau de solvabilité de l'instrument référencé sous-jacent et une plus grande probabilité de défaillance ou de risque de défaillance, ou de survenance d'autres incidents de crédit définis dans les dispositions de l'accord.

#### SWAPS DE DEVICES

Contrepartie	À recevoir	À payer	Date d'échéance <sup>5)</sup>	Valeur notionnelle de la devise reçue	Valeur notionnelle de la devise livrée	Primes payées/ (reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Swaps, à la valeur	
								Actif	Passif
AZD	Taux variable équivalent au AUD-LIBOR à 3 mois plus 0,290 %, en fonction de la valeur notionnelle de la devise reçue	Taux variable équivalent au USD-LIBOR à 3 mois, en fonction de la valeur notionnelle de la devise livrée	4 janv. 2031	1 700 AUD	1 281 USD	11 \$	(5) \$	6 \$	0 \$
CBK	Taux variable équivalent au AUD-LIBOR à 3 mois plus 0,420 %, en fonction de la valeur notionnelle de la devise reçue	Taux variable équivalent au USD-LIBOR à 3 mois, en fonction de la valeur notionnelle de la devise livrée	31 juill. 2029	1 200	828	0	5	5	0
GLM	Taux variable équivalent au AUD-LIBOR à 3 mois plus 0,423 %, en fonction de la valeur notionnelle de la devise reçue	Taux variable équivalent au USD-LIBOR à 3 mois, en fonction de la valeur notionnelle de la devise livrée	1 <sup>er</sup> août 2029	1 100	759	(5)	4	0	(1)
MYC	Taux variable équivalent au AUD-LIBOR à 3 mois plus 0,298 %, en fonction de la valeur notionnelle de la devise reçue	Taux variable équivalent au USD-LIBOR à 3 mois, en fonction de la valeur notionnelle de la devise livrée	14 oct. 2030	900	646	6	(1)	5	0
						<b>12 \$</b>	<b>3 \$</b>	<b>16 \$</b>	<b>(1) \$</b>

- <sup>5)</sup> À la date d'échéance, la valeur notionnelle de la devise reçue sera échangée contre la valeur notionnelle de la devise livrée.

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Primes payées/ (reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Swaps, à la valeur	
								Actif	Passif
GST	À recevoir	KLIBOR en MYR à 3 mois	3,500 %	20 sept. 2028	27 660 MYR	130 \$	(106) \$	24 \$	0 \$
<b>Total des swaps</b>						<b>110 \$</b>	<b>(106) \$</b>	<b>40 \$</b>	<b>(36) \$</b>

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues).

(en milliers\*)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

**SOMMAIRE DES EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA)						
RBC	17 310 \$	0 \$	0 \$	17 310 \$	(17 707) \$	(397) \$
SSB	142	0	0	142	(144)	(2)
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement<sup>3)</sup></b>	<b>17 452 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA)						
RBC	29 514 \$	0 \$	0 \$	29 514 \$	(30 207) \$	(693) \$
SSB	283	0	0	283	(289)	(6)
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement<sup>3)</sup></b>	<b>29 797 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

<sup>2)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux emprunts et autres opérations de financement ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

<sup>3)</sup> Les emprunts se sont établis entre 0 \$ et 1 882 \$ pour la période close le 31 décembre 2023 (entre 0 \$ et 16 671 \$ pour la période close le 31 décembre 2022).

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE - SOMMAIRE**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2023 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0 \$	585 \$	649 \$	1 234 \$	0 \$	(151) \$	(876) \$	(1 027) \$

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2022 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	2 \$	502 \$	400 \$	904 \$	0 \$	(302) \$	(567) \$	(869) \$

## Notes annexes propres au Fonds Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (suite)

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	5 \$	0 \$	6 \$	11 \$	(29) \$	0 \$	0 \$	(29) \$	(18) \$	0 \$	(18) \$
BOA	3	0	0	3	(26)	0	0	(26)	(23)	0	(23)
BPS	6	163	0	169	(119)	(154)	0	(273)	(104)	0	(104)
BRC	355	2	0	357	(46)	0	0	(46)	311	(368)	(57)
CBK	208	0	5	213	(284)	0	0	(284)	(71)	0	(71)
GLM	2 276	4	0	2 280	(156)	(20)	(1)	(177)	2 103	(2 612)	(509)
GST	0	0	24	24	0	0	(17)	(17)	7	0	7
JPM	210	0	0	210	(34)	(34)	0	(68)	142	(1)	141
MBC	488	0	0	488	(202)	0	0	(202)	286	(384)	(98)
MYC	0	0	5	5	0	(12)	(18)	(30)	(25)	0	(25)
MYI	12	0	0	12	(37)	0	0	(37)	(25)	0	(25)
RBC	254	0	0	254	0	0	0	0	254	(550)	(296)
RYL	6	0	0	6	(10)	0	0	(10)	(4)	0	(4)
SCX	558	0	0	558	(64)	0	0	(64)	494	(473)	21
TOR	0	0	0	0	(6)	0	0	(6)	(6)	0	(6)
UAG	291	0	0	291	(3)	0	0	(3)	288	0	288
<b>Total - Hors cote</b>	<b>4 672 \$</b>	<b>169 \$</b>	<b>40 \$</b>	<b>4 881 \$</b>	<b>(1 016) \$</b>	<b>(220) \$</b>	<b>(36) \$</b>	<b>(1 272) \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	0 \$	0 \$	4 \$	4 \$	(8) \$	0 \$	0 \$	(8) \$	(4) \$	0 \$	(4) \$
BOA	208	0	3	211	(2 666)	(14)	(1)	(2 681)	(2 470)	2 176	(294)
BPS	101	167	5	273	(39)	(314)	(3)	(356)	(83)	81	(2)
BRC	126	0	0	126	(42)	(7)	(4)	(53)	73	0	73
CBK	381	0	2	383	(249)	0	0	(249)	134	0	134
CLY	123	0	0	123	(1 301)	0	0	(1 301)	(1 178)	0	(1 178)
GLM	152	0	0	152	(18)	(56)	(3)	(77)	75	0	75
GST	0	0	6	6	0	0	(2)	(2)	4	0	4
HUS	0	0	0	0	0	0	(1)	(1)	(1)	0	(1)
IND	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1 178	1 178
JPM	51	0	0	51	(557)	0	0	(557)	(506)	789	283
MBC	46	0	0	46	(3 533)	0	0	(3 533)	(3 487)	2 816	(671)
MYC	0	0	3	3	0	0	0	0	3	0	3
MYI	39	0	0	39	(70)	0	0	(70)	(31)	0	(31)
RBC	93	0	0	93	(570)	0	0	(570)	(477)	358	(119)
SCX	27	0	0	27	(202)	0	0	(202)	(175)	75	(100)
TOR	51	0	0	51	0	0	0	0	51	0	51
UAG	33	0	0	33	(50)	0	0	(50)	(17)	0	(17)
<b>Total - Hors cote</b>	<b>1 431 \$</b>	<b>167 \$</b>	<b>23 \$</b>	<b>1 621 \$</b>	<b>(9 305) \$</b>	<b>(391) \$</b>	<b>(14) \$</b>	<b>(9 710) \$</b>			

<sup>1)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux instruments financiers dérivés hors cote ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

### ÉVALUATIONS DE LA JUSTE VALEUR

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2023 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Argentine				
Émissions souveraines	0 \$	125 \$	0 \$	125 \$
Australie				
Obligations et billets de sociétés	0	544	0	544
Émissions souveraines	0	1 377	0	1 377

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
Bermudes				
Titres adossés à des actifs	0 \$	1 061 \$	0 \$	1 061 \$
Brésil				
Obligations et billets de sociétés	0	2	0	2
Émissions souveraines	0	314	0	314
Canada				
Titres du gouvernement fédéral	0	2 582	0	2 582
Obligations et billets de sociétés	0	1 050	0	1 050
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	729	0	729
Îles Caïmans				
Titres adossés à des actifs	0	9 300	0	9 300
Obligations et billets de sociétés	0	1 841	0	1 841
Émissions souveraines	0	276	0	276
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0	13 909	0	13 909
Finlande				
Obligations et billets de sociétés	0	893	0	893
France				
Obligations et billets de sociétés	0	2 363	0	2 363
Émissions souveraines	0	2 368	0	2 368
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	3 010	0	3 010
Hongrie				
Émissions souveraines	0	436	0	436
Irlande				
Titres adossés à des actifs	0	4 816	0	4 816
Obligations et billets de sociétés	0	385	0	385
Israël				
Émissions souveraines	0	2 246	0	2 246
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0	1 102	0	1 102
Émissions souveraines	0	397	0	397
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	1 422	0	1 422
Émissions souveraines	0	12 674	0	12 674
Jersey, îles Anglo-Normandes				
Titres adossés à des actifs	0	1 545	0	1 545
Obligations et billets de sociétés	0	404	0	404
Luxembourg				
Actions ordinaires	0	0	105	105
Obligations et billets de sociétés	0	458	0	458
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	281	0	281
Malaisie				
Obligations et billets de sociétés	0	453	0	453
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	1 119	0	1 119
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	352	0	352
Norvège				
Émissions souveraines	0	191	0	191
Pérou				
Émissions souveraines	0	723	0	723
Pologne				
Émissions souveraines	0	732	0	732
Qatar				
Obligations et billets de sociétés	0	226	0	226
Roumanie				
Émissions souveraines	0	1 086	0	1 086
Arabie saoudite				
Obligations et billets de sociétés	0	228	0	228
Émissions souveraines	0	807	0	807
Serbie				
Émissions souveraines	0	226	0	226
Slovénie				
Obligations et billets de sociétés	0	291	0	291
Corée du Sud				
Obligations et billets de sociétés	0	803	0	803
Émissions souveraines	0	3 914	0	3 914
Espagne				
Titres adossés à des actifs	0	42	0	42
Obligations et billets de sociétés	0	528	0	528
Émissions souveraines	0	1 797	0	1 797
Suède				
Obligations et billets de sociétés	0	277	0	277

## Notes annexes propres au Fonds Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (suite)

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Suisse</b>				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	2 603 \$	0 \$	2 603 \$
<b>Royaume-Uni</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	6 110	0	6 110
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	9 240	0	9 240
Émissions souveraines	0	1 701	0	1 701
<b>États-Unis</b>				
Titres adossés à des actifs	0	20 259	13	20 272
Obligations et billets de sociétés	0	6 711	0	6 711
Prêts avec participation et cession	0	136	0	136
Obligations et billets municipaux	0	783	0	783
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	10 391	170	10 561
Organismes gouvernementaux américains	0	23 801	0	23 801
Obligations du Trésor américain	0	6 423	0	6 423
<b>Instruments à court terme</b>				
Billets de trésorerie	0	1 775	0	1 775
Prises en pension	0	17 442	0	17 442
Billets à court terme	0	4	0	4
Bons du Trésor de la Hongrie	0	2 745	0	2 745
Bons du Trésor du Japon	0	51 704	0	51 704
<b>Total - Placements</b>	<b>0 \$</b>	<b>243 533 \$</b>	<b>288 \$</b>	<b>243 821 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	561	673	0	1 234
Hors cote	0	4 881	0	4 881
	<b>561 \$</b>	<b>5 554 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>6 115 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(107)	(920)	0	(1 027)
Hors cote	0	(1 272)	0	(1 272)
	<b>(107) \$</b>	<b>(2 192) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(2 299) \$</b>
<b>Total - Instruments financiers dérivés</b>	<b>454 \$</b>	<b>3 362 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>3 816 \$</b>
<b>Totaux</b>	<b>454 \$</b>	<b>246 895 \$</b>	<b>288 \$</b>	<b>247 637 \$</b>

**Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2022 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :**

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
<b>Argentine</b>				
Émissions souveraines	0 \$	87 \$	0 \$	87 \$
<b>Australie</b>				
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	88	0	88
Émissions souveraines	0	1 363	0	1 363
<b>Canada</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	254	0	254
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	820	0	820
<b>Îles Caïmans</b>				
Titres adossés à des actifs	0	10 693	0	10 693
Obligations et billets de sociétés	0	1 448	0	1 448
<b>Danemark</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	5 155	0	5 155
<b>France</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	1 687	0	1 687
Émissions souveraines	0	2 182	0	2 182
<b>Allemagne</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	3 839	0	3 839
<b>Hong Kong</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	248	0	248
<b>Hongrie</b>				
Émissions souveraines	0	144	0	144
<b>Irlande</b>				
Titres adossés à des actifs	0	5 260	0	5 260
Obligations et billets de sociétés	0	1 154	0	1 154
<b>Israël</b>				
Émissions souveraines	0	1 737	0	1 737

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	1 215 \$	0 \$	1 215 \$
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	706	0	706
Émissions souveraines	0	5 170	0	5 170
Jersey, îles Anglo-Normandes				
Titres adossés à des actifs	0	918	0	918
Obligations et billets de sociétés	0	365	0	365
Luxembourg				
Obligations et billets de sociétés	0	442	0	442
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	313	0	313
Malaisie				
Obligations et billets de sociétés	0	449	0	449
Émissions souveraines	0	923	0	923
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	1 566	0	1 566
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	382	0	382
Norvège				
Émissions souveraines	0	201	0	201
Pérou				
Émissions souveraines	0	2 754	0	2 754
Pologne				
Émissions souveraines	0	139	0	139
Qatar				
Obligations et billets de sociétés	0	225	0	225
Roumanie				
Émissions souveraines	0	513	0	513
Arabie saoudite				
Obligations et billets de sociétés	0	224	0	224
Serbie				
Émissions souveraines	0	896	0	896
Slovénie				
Obligations et billets de sociétés	0	263	0	263
Espagne				
Titres adossés à des actifs	0	116	0	116
Obligations et billets de sociétés	0	526	0	526
Émissions souveraines	0	1 684	0	1 684
Suède				
Obligations et billets de sociétés	0	255	0	255
Suisse				
Obligations et billets de sociétés	0	2 257	0	2 257
Thaïlande				
Émissions souveraines	0	119	0	119
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	6 851	0	6 851
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	12 929	0	12 929
Titres privilégiés	0	2	0	2
Émissions souveraines	0	1 674	0	1 674
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	22 054	0	22 054
Obligations et billets de sociétés	0	7 725	0	7 725
Prêts avec participation et cession	0	193	0	193
Obligations et billets municipaux	0	1 155	0	1 155
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	10 772	0	10 772
Organismes gouvernementaux américains	0	26 452	0	26 452
Obligations du Trésor américain	0	3 491	0	3 491
Instruments à court terme				
Billets de trésorerie	0	3 289	0	3 289
Prises en pension	0	29 783	0	29 783
Bons du Trésor du Canada	0	978	0	978
Bons du Trésor de la Hongrie	0	1 753	0	1 753
Bons du Trésor d'Israël	0	3 613	0	3 613
Bons du Trésor du Japon	0	50 107	0	50 107
Bons du Trésor des États-Unis	0	3 470	0	3 470
Total - Placements	0 \$	245 071 \$	0 \$	245 071 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	434	470	0	904
Hors cote	0	1 621	0	1 621
	434 \$	2 091 \$	0 \$	2 525 \$

## Notes annexes propres au Fonds Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (suite)

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(246) \$	(623) \$	0 \$	(869) \$
Hors cote	0	(9 710)	0	(9 710)
	(246) \$	(10 333) \$	0 \$	(10 579) \$
Total - Instruments financiers dérivés	188 \$	(8 242) \$	0 \$	(8 054) \$
Totaux	188 \$	236 829 \$	0 \$	237 017 \$

Il n'y a eu aucun transfert significatif entre les niveaux 1, 2 ou 3 pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

### CONCENTRATION DU PORTEFEUILLE

Le portefeuille de placements du Fonds est concentré dans les segments suivants :

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Argentine	0,1 %	0,0 %
Australie	0,8 %	0,6 %
Bermudes	0,4 %	0,0 %
Brésil	0,1 %	0,0 %
Canada	1,8 %	0,5 %
Îles Caïmans	4,8 %	5,3 %
Danemark	5,8 %	2,3 %
Finlande	0,4 %	0,0 %
France	2,0 %	1,6 %
Allemagne	1,3 %	1,7 %
Hong Kong	0,0 %	0,1 %
Hongrie	0,2 %	0,1 %
Irlande	2,2 %	2,8 %
Israël	0,9 %	0,8 %
Italie	0,7 %	0,5 %
Japon	5,9 %	2,6 %
Jersey, îles Anglo-Normandes	0,8 %	0,6 %
Luxembourg	0,3 %	0,3 %
Malaisie	0,2 %	0,6 %
Pays-Bas	0,6 %	0,9 %
Norvège	0,1 %	0,1 %
Pérou	0,3 %	1,2 %
Pologne	0,3 %	0,1 %
Qatar	0,1 %	0,1 %
Roumanie	0,5 %	0,2 %
Arabie saoudite	0,4 %	0,1 %
Serbie	0,1 %	0,4 %
Slovénie	0,1 %	0,1 %
Corée du Sud	1,9 %	0,0 %
Espagne	0,9 %	1,0 %
Suède	0,1 %	0,1 %
Suisse	1,1 %	1,0 %
Thaïlande	0,0 %	0,1 %
Royaume-Uni	7,1 %	9,4 %
États-Unis	28,7 %	31,5 %
Instruments à court terme	30,7 %	40,6 %
Instruments financiers dérivés	1,6 %	(3,5) %
Passifs, moins les autres actifs	(3,3) %	(3,8) %
Total (% de l'actif net)	100,0 %	100,0 %

## RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

## RISQUE DE CHANGE

Les tableaux ci-dessous indiquent l'exposition globale au risque de change, sauf celui afférent à la monnaie fonctionnelle du Fonds.

Au 31 décembre 2023	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Peso argentin	11 \$	0 \$	11 \$	Peso argentin	65 \$	0 \$	65 \$
Dollar australien	4 327	(1 085)	3 242	Dollar australien	1 908	450	2 358
Réal brésilien	349	1 405	1 754	Réal brésilien	33	1 673	1 706
Livre sterling	13 967	(12 691)	1 276	Livre sterling	18 524	(20 556)	(2 032)
Peso chilien	0	0	0	Peso chilien	0	57	57
Yuan renminbi chinois (continental)	80	164	244	Yuan renminbi chinois (continental)	85	(1)	84
Yuan renminbi chinois (Offshore)	(94)	(4 627)	(4 721)	Yuan renminbi chinois (Offshore)	(98)	(22)	(120)
Couronne tchèque	93	0	93	Couronne tchèque	93	0	93
Couronne danoise	13 585	(13 662)	(77)	Couronne danoise	5 291	(5 310)	(19)
Euro	67 329	(26 119)	41 210	Euro	68 561	(27 524)	41 037
Dollar de Hong Kong	0	0	0	Dollar de Hong Kong	0	0	0
Forint hongrois	2 745	(336)	2 409	Forint hongrois	1 753	(1 753)	0
Roupie indienne	0	1 762	1 762	Roupie indienne	0	0	0
Roupie indonésienne	0	834	834	Roupie indonésienne	0	0	0
Shekel israélien	(478)	0	(478)	Shekel israélien	4 874	(5 403)	(529)
Yen japonais	67 276	(62 506)	4 770	Yen japonais	57 575	(51 165)	6 410
Won coréen	3 441	(3 462)	(21)	Won coréen	0	0	0
Ringgit malais	50	(148)	(98)	Ringgit malais	940	(940)	0
Peso mexicain	461	1 693	2 154	Peso mexicain	461	44	505
Dollar néo-zélandais	851	(87)	764	Dollar néo-zélandais	926	(2 285)	(1 359)
Couronne norvégienne	251	560	811	Couronne norvégienne	236	3 130	3 366
Nouveau sol péruvien	855	(865)	(10)	Nouveau sol péruvien	2 939	(2 942)	(3)
Zloty polonais	(6)	1 103	1 097	Zloty polonais	(3)	0	(3)
Nouveau leu roumain	56	0	56	Nouveau leu roumain	56	0	56
Rouble russe	0	0	0	Rouble russe	0	0	0
Dollar de Singapour	73	(61)	12	Dollar de Singapour	230	(221)	9
Rand sud-africain	(55)	0	(55)	Rand sud-africain	(82)	30	(52)
Couronne suédoise	34	0	34	Couronne suédoise	34	0	34
Franc suisse	710	(1 813)	(1 103)	Franc suisse	721	1 633	2 354
Dollar de Taiwan	0	(935)	(935)	Dollar de Taiwan	0	(4 300)	(4 300)
Baht thaïlandais	0	0	0	Baht thaïlandais	117	732	849
Dollar américain	40 186	(81 053)	(40 867)	Dollar américain	41 665	(77 300)	(35 635)
	216 097 \$	(201 929) \$	14 168 \$		206 904 \$	(191 973) \$	14 931 \$

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport aux autres monnaies, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 708 \$ (747 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

## RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt. Ils incluent les instruments financiers du Fonds à la juste valeur, classés en fonction de la date d'échéance. Certains actifs ou passifs figurant dans l'état de la situation financière, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, ont été regroupés pour permettre la présentation ci-dessous.

Actif au 31 décembre 2023	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Placements, à la juste valeur	70 356 \$	20 263 \$	34 443 \$	118 654 \$	105 \$	243 821 \$
Instruments financiers dérivés	4 065	623	86	563	778	6 115
Trésorerie et devises	0	0	0	0	2 446	2 446
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	11 853	11 853
Montants à recevoir	0	0	0	0	38 546	38 546
<b>Total - Actif</b>	<b>74 421 \$</b>	<b>20 886 \$</b>	<b>34 529 \$</b>	<b>119 217 \$</b>	<b>53 728 \$</b>	<b>302 781 \$</b>

## Notes annexes propres au Fonds Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (suite)

	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
<b>Passif au 31 décembre 2023</b>						
Instruments financiers dérivés	(844) \$	(174) \$	(77) \$	(797) \$	(407) \$	(2 299) \$
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(1 514)	(1 514)
Montants à payer	0	0	0	0	(59 293)	(59 293)
<b>Total - Passif</b>	<b>(844) \$</b>	<b>(174) \$</b>	<b>(77) \$</b>	<b>(797) \$</b>	<b>(61 214) \$</b>	<b>(63 106) \$</b>
<b>Actif au 31 décembre 2022</b>						
Placements, à la juste valeur	91 419 \$	9 447 \$	18 267 \$	125 936 \$	2 \$	245 071 \$
Instruments financiers dérivés	873	558	202	207	685	2 525
Trésorerie et devises	0	0	0	0	2 251	2 251
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	14 849	14 849
Montants à recevoir	0	0	0	0	41 004	41 004
<b>Total - Actif</b>	<b>92 292 \$</b>	<b>10 005 \$</b>	<b>18 469 \$</b>	<b>126 143 \$</b>	<b>58 791 \$</b>	<b>305 700 \$</b>
<b>Passif au 31 décembre 2022</b>						
Instruments financiers dérivés	(9 242) \$	(65) \$	(89) \$	(475) \$	(708) \$	(10 579) \$
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(480)	(480)
Montants à payer	0	0	0	0	(66 299)	(66 299)
<b>Total - Passif</b>	<b>(9 242) \$</b>	<b>(65) \$</b>	<b>(89) \$</b>	<b>(475) \$</b>	<b>(67 487) \$</b>	<b>(77 358) \$</b>

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si les taux d'intérêt en vigueur avaient progressé ou reculé de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 9 360 \$ ou 3,9 % (7 575 \$, ou 3,3 %, au 31 décembre 2022). La sensibilité du Fonds à la variation des taux d'intérêt a été estimée d'après la durée moyenne pondérée des instruments de créance. Dans les faits, les résultats des opérations peuvent différer et la différence peut être importante.

### AUTRE RISQUE DE PRIX

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'était pas exposé à l'autre risque de prix de façon importante, car il détenait surtout des titres de créance.

### RISQUE DE LIQUIDITÉ

Les tableaux ci-dessous font état des passifs du Fonds, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, par date de paiement contractuel : moins de trois mois, de trois mois à un an ou plus d'un an, selon le cas.

	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Total
<b>Passif courant au 31 décembre 2023</b>				
Instruments financiers dérivés	1 251 \$	174 \$	874 \$	2 299 \$
Achats de placements à payer	58 902	0	0	58 902
Dépôts de contreparties	1 514	0	0	1 514
Montants à payer pour les parts rachetées	325	0	0	325
Distributions à payer	26	0	0	26
Frais de gestion à payer	40	0	0	40
<b>Total - Passif</b>	<b>62 058 \$</b>	<b>174 \$</b>	<b>874 \$</b>	<b>63 106 \$</b>
<b>Passif courant au 31 décembre 2022</b>				
Instruments financiers dérivés	10 515 \$	64 \$	0 \$	10 579 \$
Achats de placements à payer	65 999	0	0	65 999
Montants à payer pour l'intérêt sur les swaps	1	0	0	1
Dépôts de contreparties	480	0	0	480
Montants à payer pour les parts rachetées	214	0	0	214
Distributions à payer	26	0	0	26
Frais de gestion à payer	59	0	0	59
<b>Total - Passif</b>	<b>77 294 \$</b>	<b>64 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>77 358 \$</b>

## RISQUE DE CRÉDIT

Les tableaux ci-dessous résument la composition des notations des instruments financiers du Fonds.

	Au 31 décembre 2023	Au 31 décembre 2022
Catégorie investissement	93 %	91 %
Inférieur à la catégorie investissement	7 %	9 %
Sans notation	0 %	0 %
Total (% des placements et des instruments financiers dérivés)	100 %	100 %

Les notations sont fournies par Standard & Poor's Ratings Services (S&P), Moody's Investors Services, Inc. (Moody's), Fitch Ratings, Inc. (Fitch) ou DBRS Limited (DBRS). Lorsqu'il existe plus d'une notation pour un titre, la plus élevée a été retenue. Si la notation d'un instrument n'est pas fournie par l'une de ces agences, un titre reçoit une notation interne. Les notations inférieures à la catégorie investissement sont celles inférieures à Baa3 selon Moody's, à BAA- selon la notation interne, à BBB- selon S&P et Fitch, et à BBBL selon DBRS.

## États de la situation financière Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 déc. 2023	31 déc. 2022
<b>Actif :</b>		
Actif courant :		
<i>Placements, à la juste valeur</i>		
Placements dans des titres <sup>†</sup>	109 646 \$	120 553 \$
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	128	80
Hors cote	1 747	506
Trésorerie	530	648
Dépôts auprès de contreparties	2 046	2 334
Devises	349	365
Montants à recevoir pour les placements vendus	37 078	19 368
Montants à recevoir au titre du revenu provenant de swaps	0	1
Montants à recevoir pour les parts vendues	94	12
Intérêts et dividendes à recevoir	506	696
Autres actifs	6	0
	152 130	144 563
<b>Passif :</b>		
Passif courant :		
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	36	92
Hors cote	372	2 731
Achats de placements à payer	70 452	24 311
Dépôts de contreparties	1 236	0
Montants à payer pour les parts rachetées	54	126
Impôts et taxes à payer	1	10
Frais de gestion à payer	49	63
	72 200	27 333
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>79 930 \$</b>	<b>117 230 \$</b>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A	9 561 \$	11 976 \$
Nombre de parts rachetables - série A	1 019	1 311
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	9,38 \$	9,13 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F	20 973 \$	26 144 \$
Nombre de parts rachetables - série F	2 238	2 864
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	9,37 \$	9,13 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I	27 804 \$	53 151 \$
Nombre de parts rachetables - série I	3 076	5 993
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	9,04 \$	8,87 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série M	11 711 \$	12 827 \$
Nombre de parts rachetables - série M	1 250	1 408
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série M	9,37 \$	9,11 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série O	5 939 \$	7 454 \$
Nombre de parts rachetables - série O	633	817
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série O	9,38 \$	9,13 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A (\$ US)	633 \$	902 \$
Nombre de parts rachetables - série A (\$ US)	51	73
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A (\$ US)	12,55 \$	12,43 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A (\$ US)	9,47 USD	9,18 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F (\$ US)	1 821 \$	2 730 \$
Nombre de parts rachetables - série F (\$ US)	146	220
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F (\$ US)	12,50 \$	12,41 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F (\$ US)	9,44 USD	9,17 USD

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I (\$ US)	17 \$	16 \$
Nombre de parts rachetables - série I (\$ US)	1	1
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I (\$ US)	14,31 \$	13,79 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I (\$ US)	10,80 USD	10,18 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série M (\$ US)	1 471 \$	2 030 \$
Nombre de parts rachetables - série M (\$ US)	119	166
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série M (\$ US)	12,35 \$	12,26 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série M (\$ US)	9,32 USD	9,05 USD
† Comprend les prises en pension de :	12 600 \$	17 400 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États du résultat global Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Revenus :</b>		
<b>Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés</b>		
Intérêts à distribuer	5 219 \$	5 663 \$
Revenu (perte) sur instruments dérivés	(968)	(347)
Gain (perte) net réalisé à la vente de placements	(1 894)	(2 206)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	790	(803)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés hors cote	(1 347)	(1 937)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements en portefeuille	1 259	(5 594)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(234)	(1 755)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés hors cote	3 435	(2 686)
Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés	6 260	(9 665)
<b>Autres revenus (pertes)</b>		
Gain (perte) net réalisé sur opérations en devises	(744)	337
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente à la conversion des actifs et des passifs libellés en devises	1 173	(71)
Autres revenus (pertes)	429	266
Total - Revenus (pertes)	6 689	(9 399)
<b>Charges :</b>		
Frais de gestion	595	859
Frais liés au CEI	1	1
Charges d'intérêts	20	12
Coûts de transaction	5	8
Impôt sur les gains en capital	(9)	3
Autre	0	4
Total - Charges	612	887
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	6 077 \$	(10 286) \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série</b>		
Série A	635 \$	(1 213) \$
Série F	1 497	(2 850)
Série I	2 520	(4 140)
Série M	798	(1 313)
Série O	388	(649)
Série A (\$ US)	33	(14)
Série F (\$ US)	108	(40)
Série I (\$ US)	1	0
Série M (\$ US)	97	(67)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part</b>		
Série A	0,56 \$	(0,80) \$
Série F	0,62	(0,77)
Série I	0,65	(0,61)
Série M	0,62	(0,77)
Série O	0,57	(0,75)
Série A (\$ US)	0,55	(0,16)
Série F (\$ US)	0,59	(0,15)
Série I (\$ US)	0,85	0,07
Série M (\$ US)	0,64	(0,28)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

---

(CETTE PAGE EST INTENTIONNELLEMENT LAISSÉE EN BLANC)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

	Exercice clos le 31 déc. 2023				
	Série A	Série F	Série I	Série M	Série O
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	11 976 \$	26 144 \$	53 151 \$	12 827 \$	7 454 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	635	1 497	2 520	798	388
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>					
Provenant du revenu net de placement	(366)	(893)	(1 768)	(474)	(223)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(366)	(893)	(1 768)	(474)	(223)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>					
Produit de la vente de parts rachetables	1 226	5 017	10 848	3 679	1 262
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	330	600	1 768	259	216
Coût des parts rachetables rachetées	(4 240)	(11 392)	(38 715)	(5 378)	(3 158)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(2 684)	(5 775)	(26 099)	(1 440)	(1 680)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(2 415)	(5 171)	(25 347)	(1 116)	(1 515)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	9 561 \$	20 973 \$	27 804 \$	11 711 \$	5 939 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>					
Parts rachetables vendues	133	546	1 214	398	138
Parts émises au réinvestissement des distributions	36	65	200	28	23
Parts rachetables rachetées	(461)	(1 237)	(4 331)	(584)	(345)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(292)	(626)	(2 917)	(158)	(184)
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	1 311	2 864	5 993	1 408	817
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	1 019	2 238	3 076	1 250	633

	Exercice clos le 31 déc. 2022				
	Série A	Série F	Série I	Série M	Série O
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	17 625 \$	42 907 \$	72 314 \$	19 074 \$	9 225 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 213)	(2 850)	(4 140)	(1 313)	(649)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>					
Provenant du revenu net de placement	(320)	(965)	(2 311)	(454)	(191)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(320)	(965)	(2 311)	(454)	(191)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>					
Produit de la vente de parts rachetables	1 815	7 211	45 275	3 423	802
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	293	640	2 311	264	176
Coût des parts rachetables rachetées	(6 224)	(20 799)	(60 298)	(8 167)	(1 909)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(4 116)	(12 948)	(12 712)	(4 480)	(931)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(5 649)	(16 763)	(19 163)	(6 247)	(1 771)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	11 976 \$	26 144 \$	53 151 \$	12 827 \$	7 454 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>					
Parts rachetables vendues	190	755	4 939	357	85
Parts émises au réinvestissement des distributions	31	69	256	28	19
Parts rachetables rachetées	(653)	(2 204)	(6 562)	(867)	(200)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(432)	(1 380)	(1 367)	(482)	(96)
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	1 743	4 244	7 360	1 890	913
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	1 311	2 864	5 993	1 408	817

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

Exercice clos le 31 déc. 2023

Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Série I (\$ US)	Série M (\$ US)	Total
902 \$	2 730 \$	16 \$	2 030 \$	117 230 \$
33	108	1	97	6 077
(26)	(93)	0	(75)	(3 918)
(26)	(93)	0	(75)	(3 918)
14	298	0	0	22 344
25	65	0	62	3 325
(315)	(1 287)	0	(643)	(65 128)
(276)	(924)	0	(581)	(39 459)
(269)	(909)	1	(559)	(37 300)
633 \$	1 821 \$	17 \$	1 471 \$	79 930 \$
1	25	0	0	S.O.
2	5	0	5	S.O.
(25)	(104)	0	(52)	S.O.
(22)	(74)	0	(47)	S.O.
73	220	1	166	S.O.
51	146	1	119	S.O.

Exercice clos le 31 déc. 2022

Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Série I (\$ US)	Série M (\$ US)	Total
1 177 \$	3 863 \$	16 \$	3 970 \$	170 171 \$
(14)	(40)	0	(67)	(10 286)
(24)	(92)	0	(80)	(4 437)
(24)	(92)	0	(80)	(4 437)
87	433	0	33	59 079
22	73	0	59	3 838
(346)	(1 507)	0	(1 885)	(101 135)
(237)	(1 001)	0	(1 793)	(38 218)
(275)	(1 133)	0	(1 940)	(52 941)
902 \$	2 730 \$	16 \$	2 030 \$	117 230 \$
7	35	0	3	S.O.
2	6	0	5	S.O.
(28)	(122)	0	(155)	S.O.
(19)	(81)	0	(147)	S.O.
92	301	1	313	S.O.
73	220	1	166	S.O.

## Tableaux des flux de trésorerie Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)

(en milliers*)	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6 077 \$	(10 286) \$
<b>Ajustements au titre du rapprochement de l'augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et des entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation :</b>		
Achats de titres	(4 331 646)	(7 005 927)
Produit de la vente de placements	4 370 834	7 048 799
(Augmentation) diminution des dépôts auprès de contreparties	288	1 018
(Augmentation) diminution des montants à recevoir au titre du revenu provenant de swaps	1	0
(Augmentation) diminution des intérêts et des dividendes à recevoir	190	(64)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	452	(2 592)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés hors cote	(1 512)	(1 879)
(Augmentation) diminution des autres actifs	(6)	0
Augmentation (diminution) des dépôts de contreparties	1 236	(851)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(14)	(35)
Augmentation (diminution) des impôts et taxes à payer	(9)	8
Produit (paiements) au titre des opérations en devises	416	256
<i>(Gain) perte nette réalisée</i>		
Placements	1 894	2 206
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(790)	803
Instruments financiers dérivés hors cote	1 347	1 937
Opérations en devises	744	(337)
<i>Variation nette de la (plus-value) moins-value latente</i>		
Placements	(1 259)	5 594
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	234	1 755
Instruments financiers dérivés hors cote	(3 435)	2 686
Conversion de passifs et d'actifs libellés en devises	(1 173)	71
Amortissement net des primes (des escomptes) sur les placements	(485)	(632)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation</b>	<b>43 384</b>	<b>42 530</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement :</b>		
Produit de la vente de parts rachetables**	14 623	51 843
Montant payé au titre du rachat de parts rachetables**	(57 561)	(94 678)
Distributions en trésorerie versées aux porteurs de parts rachetables	(593)	(599)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement</b>	<b>(43 531)</b>	<b>(43 434)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des devises</b>	<b>(147)</b>	<b>(904)</b>
<b>Trésorerie (découvert) et devises :</b>		
Ouverture de l'exercice	1 013	1 907
Gain (perte) de change sur la trésorerie	13	10
Clôture de l'exercice	879 \$	1 013 \$
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie :</b>		
Intérêts payés liés aux activités de financement	16 \$	12 \$
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	4 909 \$	4 974 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

\*\* Ne comprend pas les transferts hors trésorerie entre les séries.

# Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)

31 décembre 2023

(en milliers\*, sauf le nombre d'actions, de contrats, de parts ou d'onces, selon le cas)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES 137,2 %</b>			
<b>ARGENTINE 1,0 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 1,0 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement de l'Argentine</b>			
0,750 %, échéant le 9 juill. 2030	187 USD	130 \$	95 \$
1,000 %, échéant le 9 juill. 2029	35	26	19
3,500 %, échéant le 9 juill. 2041	340	173	154
3,625 %, échéant le 9 juill. 2035	1 082	712	483
<b>Obligations du Trésor de l'Argentine, BONCER</b>			
4,000 %, échéant le 14 oct. 2024	8 820 ARS	15	19
<b>Provincia de Buenos Aires</b>			
129,126 %, échéant le 12 avr. 2025	710	6	1
Total - Argentine		1 062	771
<b>BELGIQUE 0,2 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
<b>Sofina SA</b>			
1,000 %, échéant le 23 sept. 2028	100 EUR	148	124
Total - Belgique		148	124
<b>CANADA 0,3 %</b>			
<b>PRÊTS AVEC PARTICIPATION ET CESSION 0,3 %</b>			
<b>Air Canada</b>			
% à déterminer, échéant le 11 août 2028	197 USD	246	262
Total - Canada		246	262
<b>ÎLES CAÏMANS 4,6 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 3,8 %</b>			
<b>Elevation CLO Ltd.</b>			
6,590 %, échéant le 25 oct. 2030	217 USD	269	287
<b>Halseypoint CLO Ltd.</b>			
6,777 %, échéant le 20 juill. 2031	624	780	826
<b>LCM LP</b>			
6,528 %, échéant le 19 juill. 2027	104	133	138
<b>Nassau Ltd.</b>			
6,805 %, échéant le 15 oct. 2029	100	132	133
<b>OSD CLO Ltd.</b>			
6,534 %, échéant le 17 avr. 2031	531	680	701
<b>OZLM Ltd.</b>			
6,644 %, échéant le 17 oct. 2029	334	431	442
<b>Stratus CLO Ltd.</b>			
6,577 %, échéant le 28 décembre 2029	211	271	278
6,627 %, échéant le 29 décembre 2029	207	267	273
		2 963	3 078
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,8 %</b>			
<b>Avolon Holdings Funding Ltd.</b>			
2,528 %, échéant le 18 nov. 2027	23	29	27
<b>MGM China Holdings Ltd.</b>			
4,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2027	200	238	252
<b>Sands China Ltd.</b>			
5,650 %, échéant le 8 août 2028	300	389	395
		656	674
Total - Îles Caïmans		3 619	3 752

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>CHYPRE 0,3 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,3 %</b>			
<b>Atrium Finance PLC</b>			
2,625 %, échéant le 5 sept. 2027	200 EUR	305 \$	228 \$
Total - Chypre		305	228
<b>DANEMARK 0,2 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
<b>GN Store Nord AS</b>			
0,875 %, échéant le 25 nov. 2024	100 EUR	142	140
Total - Danemark		142	140
<b>FINLANDE 0,3 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,3 %</b>			
<b>Balder Finland Oyj</b>			
1,000 %, échéant le 18 janv. 2027	200 EUR	284	248
Total - Finlande		284	248
<b>FRANCE 2,0 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 2,0 %</b>			
<b>Accor SA</b>			
2,375 %, échéant le 29 nov. 2028	200 EUR	284	280
<b>Altice France SA</b>			
4,250 %, échéant le 15 oct. 2029	200	297	234
<b>BNP Paribas SA</b>			
1,904 %, échéant le 30 sept. 2028	500 USD	612	589
<b>BPCE SA</b>			
2,125 %, échéant le 13 oct. 2046 <sup>h)</sup>	200 EUR	290	238
<b>Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement</b>			
0,625 %, échéant le 16 sept. 2028	100	149	127
<b>TDF Infrastructure SASU</b>			
1,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2029	100	141	128
Total - France		1 773	1 596
<b>ALLEMAGNE 0,5 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>			
<b>Deutsche Bank AG</b>			
1,625 %, échéant le 20 janv. 2027	100 EUR	145	137
<b>Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide</b>			
2,125 %, échéant le 9 juill. 2027	200	317	285
Total - Allemagne		462	422
<b>IRLANDE 2,3 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 2,0 %</b>			
<b>Accunia European CLO DAC</b>			
4,915 %, échéant le 15 juill. 2030	243 EUR	367	356
<b>Ares European CLO DAC</b>			
5,122 %, échéant le 21 oct. 2033	250	388	362
<b>Avoca CLO DAC</b>			
4,655 %, échéant le 15 juill. 2030	98	140	142
<b>Man GLG Euro CLO DAC</b>			
4,835 %, échéant le 15 janv. 2030	184	269	268
<b>Toro European CLO DAC</b>			
4,812 %, échéant le 15 févr. 2034	300	436	433
		1 600	1 561

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,3 %</b>			
<b>AerCap Ireland Capital DAC</b> 3,000 %, échéant le 29 oct. 2028	200 USD	247 \$	242 \$
Total - Irlande		1 847	1 803
<b>ITALIE 1,8 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,8 %</b>			
<b>Aeroporti di Roma SpA</b> 1,750 %, échéant le 30 juill. 2031	200 EUR	297	253
<b>AMCO - Asset Management Co. SpA</b> 2,250 %, échéant le 17 juill. 2027	100	154	139
<b>Intesa Sanpaolo SpA</b> 4,000 %, échéant le 23 sept. 2029	300 USD	395	362
<b>Mundys SpA</b> 1,875 %, échéant le 12 févr. 2028	200 EUR	294	270
<b>UniCredit SpA</b> 2,569 %, échéant le 22 sept. 2026	350 USD	462	436
Total - Italie		1 602	1 460
<b>JAPON 0,3 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,3 %</b>			
<b>Mizuho Financial Group, Inc.</b> 2,564 %, échéant le 13 sept. 2031	200 USD	254	216
Total - Japon		254	216
<b>JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES 0,2 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
<b>Gatwick Funding Ltd.</b> 2,500 %, échéant le 15 avr. 2032	100 GBP	171	149
Total - Jersey, îles anglo-normandes		171	149
<b>LUXEMBOURG 1,5 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,5 %</b>			
<b>Acef Holding SCA</b> 1,250 %, échéant le 26 avr. 2030	100 EUR	143	118
<b>Aroundtown SA</b> 5,375 %, échéant le 21 mars 2029	300 USD	397	328
<b>CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund</b> 0,900 %, échéant le 12 oct. 2029	100 EUR	144	122
<b>Constellation Oil Services Holding SA (3,000 % en trésorerie ou 4,000 % en titres à rendement réinvesti)</b> 3,000 %, échéant le 31 décembre 2026 <sup>b)</sup>	103 USD	99	100
<b>CPI Property Group SA</b> 1,500 %, échéant le 27 janv. 2031	100 EUR	152	77
<b>Logicor Financing SARL</b> 1,625 %, échéant le 17 janv. 2030	100	142	125
<b>SELP Finance SARL</b> 3,750 %, échéant le 10 août 2027	200	261	293
Total - Luxembourg		1 338	1 163
<b>MEXICO 0,7 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,3 %</b>			
<b>Petroleos Mexicanos</b> 5,950 %, échéant le 28 janv. 2031	100 USD	131	106
10,000 %, échéant le 7 févr. 2033	100	130	133
		261	239

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,4 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement du Mexique</b>			
2,750 %, échéant le 27 nov. 2031 <sup>b)</sup>	4 172 MXN	286 \$	287 \$
4,000 %, échéant le 30 nov. 2028 <sup>b)</sup>	719	56	55
		342	342
Total - Mexique		603	581
<b>MULTINATIONAL 0,7 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,7 %</b>			
<b>Delta Air Lines, Inc.</b> 4,750 %, échéant le 20 oct. 2028	200 USD	283	261
<b>NXP BV</b> 5,000 %, échéant le 15 janv. 2033	200	260	265
Total - Multinational		543	526
<b>PAYS-BAS 1,2 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,2 %</b>			
<b>CTP NV</b> 0,625 %, échéant le 27 sept. 2026	100 EUR	150	132
1,500 %, échéant le 27 sept. 2031	100	149	114
<b>LeasePlan Corp. NV</b> 2,875 %, échéant le 24 oct. 2024	300 USD	394	389
<b>NE Property BV</b> 2,000 %, échéant le 20 janv. 2030	200 EUR	283	235
<b>Sagax Euro Mtn NL BV</b> 0,750 %, échéant le 26 janv. 2028	100	154	125
Total - Pays-Bas		1 130	995
<b>PÉROU 0,3 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,3 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement du Pérou</b>			
5,940 %, échéant le 12 févr. 2029	600 PEN	234	215
Total - Pérou		234	215
<b>ROUMANIE 0,1 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,1 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement de la Roumanie</b>			
1,750 %, échéant le 13 juill. 2030	100 EUR	147	119
Total - Roumanie		147	119
<b>SLOVÉNIE 0,2 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
<b>Nova Kreditna Banka Maribor dd</b> 1,875 %, échéant le 27 janv. 2025	100 EUR	141	146
Total - Slovénie		141	146
<b>AFRIQUE DU SUD 3,3 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 3,3 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement de l'Afrique du Sud</b>			
4,850 %, échéant le 30 sept. 2029	200 USD	265	249
10,500 %, échéant le 21 décembre 2026	31 900 ZAR	2 954	2 419
Total - Afrique du Sud		3 219	2 668
<b>ESPAGNE 0,2 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
<b>Grifols SA</b> 3,875 %, échéant le 15 oct. 2028	100 EUR	145	134
Total - Espagne		145	134

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>SUISSE 0,8 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,8 %</b>			
<b>KAF Kaerntner Ausgleichszahlungs-Fonds</b>			
0,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2049	286 EUR	406 \$	30 \$
<b>UBS Group AG</b>			
4,965 %, échéant le 16 janv. 2026	200	193	293
6,327 %, échéant le 22 décembre 2027	250 USD	337	342
Total - Suisse		936	665

<b>TURQUIE 0,8 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,8 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement de la Turquie</b>			
5,750 %, échéant le 11 mai 2047	100 USD	106	104
6,350 %, échéant le 10 août 2024	400	541	534
Total - Turquie		647	638

<b>ROYAUME-UNI 3,4 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 2,3 %</b>			
<b>Annington Funding PLC</b>			
2,308 %, échéant le 6 oct. 2032	100 GBP	171	132
<b>Barclays PLC</b>			
6,375 %, échéant le 15 décembre 2025 <sup>g), h)</sup>	200	323	322
8,000 %, échéant le 15 juin 2024 <sup>g), h)</sup>	200 USD	266	264
<b>HSBC Holdings PLC</b>			
6,254 %, échéant le 9 mars 2034	200	272	282
<b>INEOS Quattro Finance 2 PLC</b>			
2,500 %, échéant le 15 janv. 2026	100 EUR	154	142
<b>Lloyds Banking Group PLC</b>			
3,750 %, échéant le 18 mars 2028	200 USD	255	254
<b>TP ICAP Finance PLC</b>			
2,625 %, échéant le 18 nov. 2028	100 GBP	166	141
<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>			
4,250 %, échéant le 15 janv. 2030	100	168	148
<b>Workspace Group PLC</b>			
2,250 %, échéant le 11 mars 2028	100	176	145
		1 951	1 830

<b>PRÊTS AVEC PARTICIPATION ET CESSION 0,4 %</b>			
<b>BCP V Modular Services Holdings Ltd.</b>			
% à déterminer, échéant le 15 décembre 2028	200 EUR	288	280

<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 0,7 %</b>			
<b>Towd Point Mortgage Funding</b>			
6,365 %, échéant le 20 oct. 2051	342 GBP	606	578
Total - Royaume-Uni		2 845	2 688

<b>ÉTATS-UNIS 92,7 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 25,1 %</b>			
<b>Ameriquest Mortgage Securities, Inc., certificats à flux identiques adossés à des actifs</b>			
5,940 %, échéant le 25 nov. 2035	149 USD	196	192
6,490 %, échéant le 25 sept. 2034	79	105	103
<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>			
6,100 %, échéant le 25 févr. 2036	184	244	243
6,205 %, échéant le 25 sept. 2035	98	97	129
6,325 %, échéant le 25 juill. 2034	179	238	230
6,420 %, échéant le 25 oct. 2037	397	437	495

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>CIT Mortgage Loan Trust</b>			
6,970 %, échéant le 25 oct. 2037	397 USD	527 \$	521 \$
<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>			
5,730 %, échéant le 25 mars 2037	306	332	350
<b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust</b>			
4,347 %, échéant le 25 oct. 2046	9	10	11
5,730 %, échéant le 25 décembre 2036	196	242	236
6,415 %, échéant le 25 févr. 2036	780	841	1 017
<b>Fremont Home Loan Trust</b>			
6,010 %, échéant le 25 févr. 2036	1 000	956	1 128
6,085 %, échéant le 25 nov. 2035	2 000	2 094	2 324
<b>GE-WMC Mortgage Securities Trust</b>			
5,770 %, échéant le 25 août 2036	420	371	232
<b>GSAMP Trust</b>			
5,560 %, échéant le 25 janv. 2037	472	429	361
<b>Home Equity Asset Trust</b>			
6,265 %, échéant le 25 nov. 2035	51	55	66
6,505 %, échéant le 25 août 2035	904	1 035	1 155
<b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b>			
6,130 %, échéant le 25 mars 2036	400	386	483
<b>HSI Asset Securitization Corp. Trust</b>			
6,250 %, échéant le 25 janv. 2036	400	489	437
<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>			
5,690 %, échéant le 25 nov. 2036	643	461	264
<b>MASTR Specialized Loan Trust</b>			
5,990 %, échéant le 25 févr. 2036	383	434	488
<b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>			
5,770 %, échéant le 25 août 2037	111	90	76
<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>			
5,630 %, échéant le 25 sept. 2036	1 176	1 020	664
6,010 %, échéant le 25 décembre 2034	360	464	429
<b>Morgan Stanley Home Equity Loan Trust</b>			
5,990 %, échéant le 25 avr. 2036	1 330	1 386	1 270
<b>Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust</b>			
6,270 %, échéant le 25 févr. 2037	990	721	385
<b>Option One Mortgage Loan Trust, certificats adossés à des actifs</b>			
6,160 %, échéant le 25 nov. 2035	1 591	1 684	1 989
<b>Park Place Securities, Inc., certificats à flux identiques adossés à des actifs</b>			
6,295 %, échéant le 25 juill. 2035	1 000	1 024	1 192
<b>Renaissance Home Equity Loan Trust</b>			
5,612 %, échéant le 25 avr. 2037	3 708	2 823	1 332
<b>Residential Asset Mortgage Products Trust</b>			
5,910 %, échéant le 25 décembre 2035	547	598	660
<b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b>			
5,750 %, échéant le 25 juill. 2036	974	1 008	1 057
<b>Structured Asset Investment Loan Trust</b>			
6,445 %, échéant le 25 janv. 2035	421	534	505
		21 331	20 024

## ACTIONS

<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,0 %</b>			
<b>Constellation Oil, B<sup>o</sup></b>			
	112 394	16	16

VALEUR  
NOMINALE  
(EN MILLIERS)

<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 10,3 %</b>			
<b>Alaska Airlines, fiducie à flux identiques</b>			
4,800 %, échéant le 15 févr. 2029	76 USD	105	99
<b>Allegiant Travel Co.</b>			
7,250 %, échéant le 15 août 2027	100	127	130

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>American Airlines, fiducie à flux identiques</b>							
2,875 %, échéant le 11 janv. 2036	95 USD	117 \$	107 \$				
3,250 %, échéant le 15 avr. 2030	135	178	156				
3,600 %, échéant le 22 mars 2029	129	162	160				
<b>American Homes 4 Rent LP</b>							
4,250 %, échéant le 15 févr. 2028	400	494	515				
<b>American Tower Corp.</b>							
0,400 %, échéant le 15 févr. 2027	100 EUR	147	133				
<b>Bank of America Corp.</b>							
2,651 %, échéant le 11 mars 2032	200 USD	254	224				
<b>Blue Owl Finance LLC</b>							
3,125 %, échéant le 10 juin 2031	100	119	109				
<b>Carnival Holdings Bermuda Ltd.</b>							
10,375 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2028	100	135	144				
<b>Charter Communications Operating LLC</b>							
3,900 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2052	300	346	268				
<b>Cloud Software Group, Inc.</b>							
6,500 %, échéant le 31 mars 2029	100	112	126				
<b>Coty, Inc.</b>							
4,750 %, échéant le 15 janv. 2029	100	127	127				
Credit Suisse AG AT1 Claim	200	0	32				
<b>DISH DBS Corp.</b>							
5,250 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2026	200	250	228				
<b>DISH Network Corp.</b>							
11,750 %, échéant le 15 nov. 2027	100	137	138				
<b>Enact Holdings, Inc.</b>							
6,500 %, échéant le 15 août 2025	100	132	132				
<b>Exela Intermediate LLC (11,500 % en titres à rendement réinvesti)</b>							
11,500 %, échéant le 15 avr. 2026 <sup>b)</sup>	62	103	15				
<b>Ford Motor Co.</b>							
3,250 %, échéant le 12 févr. 2032	100	124	110				
<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>							
3,250 %, échéant le 15 sept. 2025	100 EUR	163	145				
4,675 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2024	100	143	147				
5,125 %, échéant le 16 juin 2025	200 USD	272	262				
<b>Frontier Communications Holdings LLC</b>							
8,750 %, échéant le 15 mai 2030	100	130	136				
<b>Global Payments, Inc.</b>							
5,300 %, échéant le 15 août 2029	100	129	134				
<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>							
2,947 %, échéant le 24 févr. 2028	300	381	374				
4,005 %, échéant le 23 avr. 2029	250	314	319				
<b>Kennedy-Wilson, Inc.</b>							
4,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2030	200	252	215				
<b>National Health Investors, Inc.</b>							
3,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2031	200	253	212				
<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>							
3,250 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2031	300	379	345				
4,400 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2032	200	253	245				
<b>Park Intermediate Holdings LLC</b>							
4,875 %, échéant le 15 mai 2029	200	242	246				
<b>Penske Truck Leasing Co. LP</b>							
4,450 %, échéant le 29 janv. 2026	400	533	518				
<b>Provident Funding Associates LP</b>							
6,375 %, échéant le 15 juin 2025	100	134	122				
<b>U.S. Foods, Inc.</b>							
4,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2030	200	251	247				
<b>United Airlines, Inc.</b>							
4,625 %, échéant le 15 avr. 2029	400	509	496				
<b>Venture Global Calcasieu Pass LLC</b>							
6,250 %, échéant le 15 janv. 2030	200 USD	268 \$	264 \$				
<b>VICI Properties LP</b>							
4,125 %, échéant le 15 août 2030	300	394	363				
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b>							
3,526 %, échéant le 24 mars 2028	300	379	379				
<b>Wynn Las Vegas LLC</b>							
5,250 %, échéant le 15 mai 2027	100	131	129				
		8 679	8 251				
<b>PRÊTS AVEC PARTICIPATION ET CESSIION 2,3 %</b>							
<b>Charter Communications Operating LLC</b>							
% à déterminer, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2027	93	121	123				
<b>Hertz Corp.</b>							
8,720 %, échéant le 30 juin 2028	100	121	132				
<b>Hilton Domestic Operating Co., Inc.</b>							
7,455 %, échéant le 8 nov. 2030	533	739	709				
<b>Lifepoint Health, Inc.</b>							
11,168 %, échéant le 16 nov. 2028	570	773	754				
<b>United Airlines, Inc.</b>							
9,220 %, échéant le 21 avr. 2028	78	98	104				
		1 852	1 822				
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX 0,1 %</b>							
<b>Golden State Tobacco Securitization Corp. (Californie), obligations-recettes, série 2021</b>							
3,850 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2050	90	114	111				
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 5,8 %</b>							
<b>Fiducie de prêts hypothécaires à taux variable</b>							
4,820 %, échéant le 25 sept. 2035	3	3	3				
<b>Banc of America Funding Trust</b>							
5,792 %, échéant le 20 févr. 2047	146	183	199				
5,852 %, échéant le 20 juill. 2036	147	181	191				
<b>BCAP LLC Trust</b>							
4,502 %, échéant le 27 mars 2037	44	46	48				
<b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>							
4,492 %, échéant le 25 nov. 2036	50	48	34				
4,730 %, échéant le 25 sept. 2035	18	18	14				
<b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>							
5,500 %, échéant le 25 avr. 2035	273	325	259				
5,682 %, échéant le 20 juill. 2046	275	263	293				
5,890 %, échéant le 25 juill. 2046	2	2	2				
6,000 %, échéant le 25 avr. 2037	175	195	130				
6,500 %, échéant le 25 juin 2036	165	180	104				
<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>							
5,930 %, échéant le 25 mai 2035	223	244	237				
7,884 %, échéant le 20 févr. 2036	18	19	21				
<b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b>							
6,050 %, échéant le 25 mars 2032	14	15	17				
<b>Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust</b>							
6,421 %, échéant le 25 oct. 2037	190	228	154				
<b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>							
5,927 %, échéant le 19 décembre 2035	65	74	81				
<b>IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust</b>							
6,250 %, échéant le 25 nov. 2037	141	153	84				
<b>JP Morgan Alternative Loan Trust</b>							
5,830 %, échéant le 25 juin 2037	315	312	219				

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>JP Morgan Mortgage Trust</b>			
5,347 %, échéant le 25 oct. 2035	22 USD	24 \$	28 \$
<b>Lehman XS Trust</b>			
5,830 %, échéant le 25 juill. 2037	66	56	80
<b>MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust</b>			
4,506 %, échéant le 25 mai 2034	27	30	33
<b>Mellon Residential Funding Corp., certificats à flux identiques de titres hypothécaires</b>			
6,176 %, échéant le 15 nov. 2031	5	6	7
<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>			
4,015 %, échéant le 25 août 2034	13	16	16
4,118 %, échéant le 25 décembre 2037	274	308	248
<b>New Residential Mortgage Loan Trust</b>			
2,750 %, échéant le 25 juill. 2059	336	450	421
4,500 %, échéant le 25 mai 2058	133	183	170
<b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>			
5,791 %, échéant le 25 oct. 2037	190	236	212
6,175 %, échéant le 25 sept. 2037	320	358	291
<b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b>			
6,500 %, échéant le 25 mars 2032	8	9	10
<b>Fiducie de placements en actifs hypothécaires structurés</b>			
5,910 %, échéant le 25 mai 2036	63	60	66
<b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>			
5,080 %, échéant le 25 oct. 2046	15	17	19
<b>Towd Point Mortgage Trust</b>			
2,900 %, échéant le 25 oct. 2059	547	726	682
6,470 %, échéant le 25 mai 2058	97	129	131
<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>			
4,185 %, échéant le 25 décembre 2046	51	52	58
4,485 %, échéant le 25 août 2036	36	36	43
6,412 %, échéant le 25 août 2042	8	8	10
6,512 %, échéant le 25 oct. 2046	34	35	40
		5 228	4 655
<b>ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX AMÉRICAINS 43,3 %</b>			
<b>Fannie Mae</b>			
0,748 %, échéant le 25 mai 2048 <sup>a)</sup>	504	231	84
<b>Freddie Mac</b>			
0,697 %, échéant le 15 juill. 2047 <sup>a)</sup>	254	65	43
<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, à déterminer</b>			
3,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2054	600	686	703
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	2 500	3 011	3 042
4,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	2 400	3 000	3 011
4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	1 600	2 056	2 057
5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2054 - 1 <sup>er</sup> févr. 2054	15 700	20 718	20 591

**NOTES À L'INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE :**

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

a) Coupon détaché.

b) Titre à rendement réinvesti.

c) Titre n'ayant produit aucun revenu au cours des douze derniers mois.

d) Titre à coupon zéro.

e) Coupon représentant un rendement à l'échéance.

f) Le montant du capital du titre est indexé selon l'inflation.

g) Titre perpétuel; la date indiquée, le cas échéant, est la prochaine date de remboursement anticipé.

h) Titre convertible conditionnel.

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
5,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	1 100 USD	1 457 \$	1 464 \$
6,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	1 400	1 896	1 884
6,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	1 300	1 778	1 765
		34 898	34 644
<b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR DES ÉTATS-UNIS 5,8 %</b>			
<b>Titres du Trésor des É.-U. indexés sur l'inflation<sup>h)</sup></b>			
0,625 %, échéant le 15 juill. 2032	1 377	1 684	1 667
1,125 %, échéant le 15 janv. 2033	1 239	1 569	1 555
1,375 %, échéant le 15 juill. 2033	1 114	1 445	1 433
		4 698	4 655
Total - États-Unis		76 816	74 178
<b>INSTRUMENTS À COURT TERME 17,3 %</b>			
<b>PRISES EN PENSION<sup>i)</sup> 15,8 %</b>			
		12 600	12 600
<b>BILLETS À COURT TERME 0,0 %</b>			
<b>Obligations du Trésor de l'Argentine, BONCER</b>			
3,750 %, échéant le 20 mai 2024	8 580 ARS	14	12
<b>BONS DU TRÉSOR DU CANADA 0,6 %</b>			
5,021 %, échéant le 18 janv. 2024 <sup>d), e)</sup>	412 \$	411	411
5,131 %, échéant le 4 janv. 2024 <sup>d), e)</sup>	31	31	31
		442	442
<b>BONS DU TRÉSOR DE LA HONGRIE 0,3 %</b>			
10,900 %, échéant le 4 janv. 2024 <sup>d), e)</sup>	59 000 HUF	226	225
<b>BONS DU TRÉSOR DES ÉTATS-UNIS 0,6 %</b>			
5,350 %, échéant le 29 févr. 2024 <sup>d), e)</sup>	57 USD	75	75
5,468 %, échéant le 4 janv. 2024 <sup>d), e)</sup>	64	87	85
5,480 %, échéant le 4 janv. 2024 <sup>d), e)</sup>	242	332	320
		494	480
Total - Placements à court terme		13 776	13 759
Total - Placements dans des titres		114 435	109 646
<b>Total - Placements 137,2 %</b>		<b>114 435 \$</b>	<b>109 646 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés<sup>j), k)</sup> 1,8 %</b>		(16)	1 467
<b>Passifs, moins les autres actifs (39,0) %</b>			(31 183)
<b>Total de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables 100,0 %</b>			<b>79 930 \$</b>

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada) (suite)

### EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

#### i) PRISES EN PENSION :

Contrepartie	Taux de financement	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du capital	Garanti par	Garanties (reçues)	Prises en pension, à la valeur	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>
TOR	4,980 %	29 déc. 2023	2 janv. 2024	12 600 \$	Obligation du gouvernement du Canada, 4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2025	(12 869) \$	12 600 \$	12 607 \$
<b>Total - Prises en pension de titres</b>						<b>(12 869) \$</b>	<b>12 600 \$</b>	<b>12 607 \$</b>

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et des autres opérations de financement et des garanties données/(reçues).

#### j) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE

##### CONTRATS À TERME :

Description	Type	Mois de l'échéance	Nombre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	Marge de variation	
					Actif	Passif
Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada à 10 ans, mars	Position longue	Mars 2024	4	11 \$	0 \$	0 \$
Contrats à terme Euro-Bobl, mars	Position courte	Mars 2024	16	(45)	11	0
Contrats à terme Euro-Bund, mars	Position courte	Mars 2024	11	(67)	23	0
Contrats à terme Euro-Schatz, mars	Position courte	Mars 2024	10	(10)	1	(1)
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 2 ans, mars	Position courte	Mars 2024	18	(49)	0	(2)
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 5 ans, mars	Position longue	Mars 2024	12	36	0	0
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position courte	Mars 2024	101	(456)	17	0
Contrats à terme Ultra sur obligations à long terme du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position courte	Mars 2024	40	(72)	15	0
Contrats à terme sur obligations à long terme du Trésor des É.-U., mars	Position courte	Mars 2024	31	(367)	21	0
Contrats à terme Ultra sur obligations à long terme du Trésor des É.-U., mars	Position courte	Mars 2024	7	(104)	8	0
Contrats à terme sur obligations du Royaume-Uni à long terme, mars	Position courte	Mars 2024	9	(106)	17	0
<b>Total des contrats à terme</b>				<b>(1 229) \$</b>	<b>113 \$</b>	<b>(3) \$</b>

##### SWAPS :

##### SWAPS SUR DÉFAILLANCE DE TITRES DE SOCIÉTÉS - PROTECTION À LA VENTE<sup>1)</sup>

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>3)</sup>	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste Valeur <sup>4)</sup>	Marge de variation	
						Actif	Passif
Boeing Co.	1,000 %	20 déc. 2026	100 USD	2 \$	2 \$	0 \$	0 \$
British Telecommunications PLC	1,000	20 déc. 2024	300 EUR	(2)	4	0	0
				<b>0 \$</b>	<b>6 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>

##### SWAPS SUR DÉFAILLANCE D'INDICES DE CRÉDIT - PROTECTION À L'ACHAT<sup>2)</sup>

Indice/tranches	Taux (à payer) fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>3)</sup>	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste Valeur <sup>4)</sup>	Marge de variation	
						Actif	Passif
Indice CDX.HY-34 à 5 ans	(5,000) %	20 juin 2025	89 USD	0 \$	(5) \$	0 \$	0 \$
Indice CDX.HY-36 à 5 ans	(5,000)	20 juin 2026	2 037	71	(172)	0	0
				<b>71 \$</b>	<b>(177) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>

<sup>1)</sup> Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, le Fonds soit i) versera à l'acheteur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et prendra livraison de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) paiera un montant net de règlement, sous forme de trésorerie, de titres ou d'autres obligations livrables, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence.

<sup>2)</sup> Si le Fonds est acheteur de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, le Fonds soit i) recevra de la part du vendeur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et livrera l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) recevra un montant net de règlement, sous forme de trésorerie, de titres ou d'autres obligations livrables, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence.

<sup>3)</sup> Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait devoir payer en tant que vendeur de protection de crédit ou recevoir en tant qu'acheteur de protection de crédit en cas d'incident de crédit, conformément aux dispositions du swap en question.

<sup>4)</sup> Les cours et les valeurs résultantes des swaps sur défaillance permettent de suivre l'évolution du risque de paiement/rendement et déterminent la probabilité qu'un passif (ou un actif) attendu sur le dérivé de crédit soit réalisé si le swap est dénoué ou si le notionnel est vendu à la clôture de la période. L'augmentation des justes valeurs en termes absolus, lorsque comparées aux valeurs notionnelles du swap, indique un affaiblissement du niveau de solvabilité de l'instrument référencé sous-jacent et une plus grande probabilité de défaillance ou de risque de défaillance, ou de survenance d'autres incidents de crédit définis dans les dispositions de l'accord.

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	Marge de variation		
							Actif	Passif	
À payer	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	4,500 %	20 mars 2034	700 GBP	94 \$	124 \$	0 \$	(10) \$	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,920	17 oct. 2024	200 USD	(2)	(4)	0	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,018	24 oct. 2024	200	(2)	(4)	0	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,973	27 oct. 2024	200	(2)	(4)	0	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,841	31 oct. 2024	200	(3)	(5)	0	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	0,500	16 juin 2026	6 700	(537)	(758)	0	(3)	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,250	21 juin 2027	2 000	(30)	(37)	0	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,827	3 juill. 2028	2 500	(201)	(237)	1	0	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	0,750	30 mars 2031	1 200	286	302	0	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,853	18 mai 2032	1 200	(172)	(185)	0	(1)	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,000	21 juin 2033	900	(10)	45	1	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,800	30 août 2033	200	8	7	0	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,900	30 août 2033	100	5	5	0	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,950	13 sept. 2033	100	5	5	0	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,165	27 sept. 2033	100	8	7	0	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,150	12 oct. 2033	100	8	7	0	0	
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,450	1 <sup>er</sup> nov. 2033	100	12	11	0	0	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,250	22 nov. 2033	200	(16)	(17)	0	0	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,842	26 déc. 2033	100	(3)	(4)	0	0	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,854	29 déc. 2033	100	(3)	(4)	0	0	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,750	2 janv. 2034	100	(2)	(3)	0	0	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,810	2 janv. 2034	100	(3)	(4)	0	0	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,750	21 déc. 2052	1 400	153	530	7	0	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,999	3 juill. 2053	500	127	162	3	0	
À payer	CDI en BRL à un an	9,628	2 janv. 2026	9 300 BRL	0	0	0	(2)	
À payer	CDI en BRL à un an	10,231	4 janv. 2027	1 100	(7)	(7)	0	0	
À payer	CDI en BRL à un an	11,023	4 janv. 2027	3 800	4	4	0	(1)	
À payer	CDI en BRL à un an	11,115	4 janv. 2027	1 100	2	2	0	0	
À payer	CDI en BRL à un an	11,126	4 janv. 2027	1 300	2	2	0	0	
À payer	CDI en BRL à un an	11,847	4 janv. 2027	5 900	47	47	0	(1)	
À payer	EURIBOR en EUR à 3 mois	2,250	28 avr. 2024	400 EUR	(2)	(3)	0	0	
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	4,750	20 déc. 2033	1 900 AUD	27	17	1	0	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,000	20 mars 2034	900 EUR	75	62	0	(14)	
À payer	Indice CAONREPO	4,000	21 juin 2025	4 400 \$	9	(10)	2	0	
À recevoir	Indice CAONREPO	3,500	1 <sup>er</sup> juin 2032	400	(10)	(15)	0	(1)	
						(133) \$	38 \$	15 \$	(33) \$
<b>Total des swaps</b>						<b>(62) \$</b>	<b>(133) \$</b>	<b>15 \$</b>	<b>(33) \$</b>

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée.

## k) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE

## CONTRATS DE CHANGE À TERME :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
BOA	Janv. 2024	387 866 COP	101 USD	2 \$	0 \$
	Janv. 2024	56 097 HUF	154	0	(9)
	Janv. 2024	96 USD	387 866 COP	5	0
	Janv. 2024	279	1 170 PLN	25	0
	Févr. 2024	3	19 CNY	0	0
	Mars 2024	100	387 866 COP	0	(2)
CBK	Mars 2024	26	2 215 INR	0	0
	Janv. 2024	173 \$	101 GBP	0	(3)
	Janv. 2024	1 364	1 013 USD	0	(22)
	Janv. 2024	3 502 HUF	10	0	0
	Janv. 2024	2 204 MXN	126	0	(5)
	Janv. 2024	19 097 USD	25 953 \$	651	0
	Janv. 2024	56	976 MXN	2	0
	Janv. 2024	90	1 648 ZAR	0	0
	Janv. 2024	14 942 ZAR	808 USD	0	(10)
	Févr. 2024	329 USD	1 688 BRL	24	0
Mars 2024	790 PEN	210 USD	0	(4)	

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada) (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
GLM	Janv. 2024	1 241 \$	919 USD	0 \$	(24) \$
	Janv. 2024	1 033 GBP	1 778 \$	33	0
	Janv. 2024	18 969 USD	25 777	646	0
	Janv. 2024	195	3 422 MXN	7	0
	Janv. 2024	5 671 ZAR	308 USD	0	(3)
	Févr. 2024	3 BRL	1	0	0
	Févr. 2024	153 USD	4 665 TRY	0	(1)
	Mars 2024	58	1 813	0	(1)
JPM	Janv. 2024	37 703 HUF	107 USD	0	(2)
	Janv. 2024	2 411 PLN	551	0	(81)
	Févr. 2024	20 USD	607 TRY	0	0
	Mars 2024	216 SGD	163 USD	0	(2)
	Mars 2024	50 USD	360 CNH	1	0
	Mars 2024	21	1 779 INR	0	0
MBC	Janv. 2024	118 \$	89 USD	0	0
	Janv. 2024	104 562 HUF	285	0	(20)
	Janv. 2024	1 085 PLN	270	0	(8)
	Janv. 2024	151 USD	205 \$	5	0
	Févr. 2024	70 CNY	10 USD	0	0
	Févr. 2024	28 USD	840 TRY	0	0
	Mars 2024	42	1 319	0	0
	Janv. 2024	16 537 HUF	47 USD	0	(1)
MYI	Janv. 2024	13 789 ZAR	719	0	(45)
	Févr. 2024	5 USD	39 CNY	0	0
	Avril 2024	0	5 MXN	0	0
RBC	Janv. 2024	298 \$	332 AUD	2	0
SCX	Janv. 2024	45	31 EUR	0	0
	Janv. 2024	1 340	145 900 JPY	32	0
	Janv. 2024	498	372 USD	0	(5)
	Janv. 2024	5 355 EUR	7 990 \$	156	0
	Janv. 2024	4 301 USD	5 747	49	(1)
	Janv. 2024	3	889 HUF	0	0
	Mars 2024	111	9 304 INR	0	0
	Janv. 2024	9 GBP	15 \$	0	0
	Janv. 2024	43 USD	37 584 CLP	0	0
	Janv. 2024	1 343	1 796 \$	16	0
TOR	Janv. 2024	691	263 000 HUF	86	0
				<b>1 742 \$</b>	<b>(249) \$</b>

### CONTRATS DE CHANGE À TERME EN COURS, EN \$ US, SÉRIE COUVERTE<sup>†</sup> :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
CBK	Janv. 2024	1 547 \$	1 139 USD	0 \$	(38) \$
GLM	Janv. 2024	1 518	1 118	0	(38)
	Janv. 2024	63 USD	84 \$	1	0
MYI	Janv. 2024	1 289 \$	949 USD	0	(31)
	Janv. 2024	4 USD	5 \$	0	0
SCX	Janv. 2024	192	257	3	0
TOR	Janv. 2024	35 \$	26 USD	0	0
				<b>4 \$</b>	<b>(107) \$</b>
<b>Total des contrats de change à terme</b>				<b>1 746 \$</b>	<b>(356) \$</b>

<sup>†</sup> Le Fonds offre des séries en \$ US, couvertes, et utilise des techniques et des instruments pour réduire l'exposition au dollar canadien, en totalité ou en partie. Il est impossible de garantir que les séries \$ US, couvertes, seront couvertes en tout temps ni que la technique de couverture sera efficace.

### OPTIONS VENDUES :

#### OPTIONS SUR SWAP DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Valeur notionnelle <sup>1)</sup>	Primes (reçues)	Juste valeur
BOA	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,288 %	19 janv. 2024	100	(1) \$	(1) \$
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,738	19 janv. 2024	100	0	0
CBK	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,235	22 janv. 2024	100	(1)	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,685	22 janv. 2024	100	0	0

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Valeur notionnelle <sup>1)</sup>	Primes (reçues)	Juste valeur	
GLM	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,648	4 janv. 2024	100	0	(2)	
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,560	5 janv. 2024	100	(1)	(1)	
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,594	5 janv. 2024	100	(1)	(2)	
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,010	5 janv. 2024	100	(1)	0	
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,044	5 janv. 2024	100	0	0	
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,300	16 janv. 2024	100	(1)	(1)	
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,750	16 janv. 2024	100	(1)	0	
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,285	19 janv. 2024	100	(1)	(1)	
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,735	19 janv. 2024	100	(1)	0	
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,215	22 janv. 2024	100	0	0	
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,665	22 janv. 2024	100	0	(1)	
	JPM	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,600	12 janv. 2024	100	(1)	(2)
		Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,050	12 janv. 2024	100	(1)	0
		Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,350	18 janv. 2024	100	(1)	(1)
Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans		LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,750	18 janv. 2024	100	(1)	0	
Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans		LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,170	29 janv. 2024	100	0	0	
Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,620	29 janv. 2024	100	0	(1)		
							<b>(13) \$</b>	<b>(13) \$</b>	

## OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Valeur notionnelle <sup>1)</sup>	Primes (reçues)	Juste valeur
BOA	Achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, hors cote, à déterminer, 5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2054	97,891 USD	9 janv. 2024	200	(1) \$	(3) \$
<b>Total - options vendues</b>					<b>(14) \$</b>	<b>(16) \$</b>

<sup>1)</sup> La valeur notionnelle représente le nombre de contrats.

## SWAPS :

SWAPS SUR DÉFAILLANCE D'ÉMISSIONS SOUVERAINES – PROTECTION À LA VENTE<sup>2)</sup>

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>3)</sup>	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Swaps, à la valeur <sup>4)</sup>	
							Actif	Passif
CBK	Obligations internationales du gouvernement du Brésil	1,000 %	20 déc. 2024	100 USD	(2) \$	3 \$	1 \$	0 \$
<b>Total des swaps</b>					<b>(2) \$</b>	<b>3 \$</b>	<b>1 \$</b>	<b>0 \$</b>

<sup>2)</sup> Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, le Fonds soit i) versera à l'acheteur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et prendra livraison de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) paiera un montant net de règlement, sous forme de trésorerie, de titres ou d'autres obligations livrables, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence.

<sup>3)</sup> Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait devoir payer en tant que vendeur de protection de crédit ou recevoir en tant qu'acheteur de protection de crédit en cas d'incident de crédit, conformément aux dispositions du swap en question.

<sup>4)</sup> Les cours et les valeurs résultantes des swaps sur défaillance permettent de suivre l'évolution du risque de paiement/rendement et déterminent la probabilité qu'un passif (ou un actif) attendu sur le dérivé de crédit soit réalisé si le swap est dénoué ou si le notionnel est vendu à la clôture de la période. L'augmentation des justes valeurs en termes absolus, lorsque comparées aux valeurs notionnelles du swap, indique un affaiblissement du niveau de solvabilité de l'instrument référencé sous-jacent et une plus grande probabilité de défaillance ou de risque de défaillance, ou de survenance d'autres incidents de crédit définis dans les dispositions de l'accord.

**Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues).**

## Notes annexes propres au Fonds Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

### SOMMAIRE DES EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA) TOR	12 607 \$	0 \$	0 \$	12 607 \$	(12 869) \$	(262) \$
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement</b>	<b>12 607 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA) TOR	17 408 \$	0 \$	0 \$	17 408 \$	(17 747) \$	(339) \$
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement</b>	<b>17 408 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

<sup>2)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux emprunts et autres opérations de financement ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2023 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0 \$	113 \$	15 \$	128 \$	0 \$	(3) \$	(33) \$	(36) \$

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2022 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs <sup>1)</sup>			Juste valeur	Marge de variation des passifs <sup>1)</sup>		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0 \$	64 \$	16 \$	80 \$	0 \$	(43) \$	(49) \$	(92) \$

<sup>1)</sup> À la clôture de la période, il y avait une marge de variation des actifs non réglée de 1 \$ et une marge de variation des passifs non réglée de (1) \$ pour les swaps liquidés.

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
BOA	32 \$	0 \$	0 \$	32 \$	(11) \$	(4) \$	0 \$	(15) \$	17 \$	(27) \$	(10) \$
CBK	677	0	1	678	(82)	0	0	(82)	596	(398)	198
GLM	687	0	0	687	(67)	(8)	0	(75)	612	(389)	223
JPM	1	0	0	1	(85)	(4)	0	(89)	(88)	0	(88)
MBC	5	0	0	5	(28)	0	0	(28)	(23)	0	(23)
MYI	0	0	0	0	(77)	0	0	(77)	(77)	75	(2)
SCX	242	0	0	242	(6)	0	0	(6)	236	0	236
TOR	102	0	0	102	0	0	0	0	102	0	102
<b>Total - Hors cote</b>	<b>1 746 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>1 \$</b>	<b>1 747 \$</b>	<b>(356) \$</b>	<b>(16) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(372) \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	(8) \$	0 \$	0 \$	(8) \$	(8) \$	0 \$	(8) \$
BOA	28	148	0	176	(562)	(270)	0	(832)	(656)	371	(285)
BOM	7	0	0	7	(161)	0	0	(161)	(154)	363	209
CBK	125	0	0	125	(52)	0	0	(52)	73	0	73
GLM	83	0	0	83	(317)	(815)	0	(1 132)	(1 049)	873	(176)
GST	0	0	0	0	0	0	(3)	(3)	(3)	0	(3)
JPM	0	0	0	0	(1)	(9)	0	(10)	(10)	0	(10)
MBC	5	0	0	5	(82)	0	0	(82)	(77)	0	(77)
MYI	12	0	0	12	(3)	0	0	(3)	9	50	59
RBC	9	0	0	9	(32)	0	0	(32)	(23)	(390)	(413)
SCX	69	0	0	69	(131)	0	0	(131)	(62)	0	(62)
TOR	20	0	0	20	(285)	0	0	(285)	(265)	395	130
<b>Total - Hors cote</b>	<b>358 \$</b>	<b>148 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>506 \$</b>	<b>(1 634) \$</b>	<b>(1 094) \$</b>	<b>(3) \$</b>	<b>(2 731) \$</b>			

<sup>1)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux instruments financiers dérivés hors cote ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

## ÉVALUATIONS DE LA JUSTE VALEUR

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2023 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Argentine				
Émissions souveraines	0 \$	771 \$	0 \$	771 \$
Belgique				
Obligations et billets de sociétés	0	124	0	124
Canada				
Prêts avec participation et cession	0	262	0	262
Îles Caïmans				
Titres adossés à des actifs	0	3 078	0	3 078
Obligations et billets de sociétés	0	674	0	674
Chypre				
Obligations et billets de sociétés	0	228	0	228
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0	140	0	140
Finlande				
Obligations et billets de sociétés	0	248	0	248
France				
Obligations et billets de sociétés	0	1 596	0	1 596

## Notes annexes propres au Fonds Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada) (suite)

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	422 \$	0 \$	422 \$
Irlande				
Titres adossés à des actifs	0	1 561	0	1 561
Obligations et billets de sociétés	0	242	0	242
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0	1 460	0	1 460
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	216	0	216
Jersey, îles Anglo-Normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	149	0	149
Luxembourg				
Obligations et billets de sociétés	0	1 163	0	1 163
Mexique				
Obligations et billets de sociétés	0	239	0	239
Émissions souveraines	0	342	0	342
Multinational				
Obligations et billets de sociétés	0	526	0	526
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	995	0	995
Pérou				
Émissions souveraines	0	215	0	215
Roumanie				
Émissions souveraines	0	119	0	119
Slovénie				
Obligations et billets de sociétés	0	146	0	146
Afrique du Sud				
Émissions souveraines	0	2 668	0	2 668
Espagne				
Obligations et billets de sociétés	0	134	0	134
Suisse				
Obligations et billets de sociétés	0	635	30	665
Turquie				
Émissions souveraines	0	638	0	638
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	1 830	0	1 830
Prêts avec participation et cession	0	280	0	280
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	578	0	578
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	19 958	66	20 024
Actions ordinaires	0	0	16	16
Obligations et billets de sociétés	0	8 251	0	8 251
Prêts avec participation et cession	0	1 822	0	1 822
Obligations et billets municipaux	0	111	0	111
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	4 559	96	4 655
Organismes gouvernementaux américains	0	34 644	0	34 644
Obligations du Trésor américain	0	4 655	0	4 655
Instruments à court terme				
Prises en pension	0	12 600	0	12 600
Billets à court terme	0	12	0	12
Bons du Trésor du Canada	0	442	0	442
Bons du Trésor de la Hongrie	0	225	0	225
Bons du Trésor des États-Unis	0	480	0	480
Total - Placements	0 \$	109 438 \$	208 \$	109 646 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	52	76	0	128
Hors cote	0	1 747	0	1 747
	52 \$	1 823 \$	0 \$	1 875 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(1)	(35)	0	(36)
Hors cote	0	(372)	0	(372)
	(1) \$	(407) \$	0 \$	(408) \$
Total - Instruments financiers dérivés	51 \$	1 416 \$	0 \$	1 467 \$
Totaux	51 \$	110 854 \$	208 \$	111 113 \$

**Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2022 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :**

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Argentine				
Émissions souveraines	0 \$	646 \$	0 \$	646 \$
Australie				
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	88	0	88
Belgique				
Obligations et billets de sociétés	0	113	0	113
Bermudes				
Obligations et billets de sociétés	0	333	0	333
Canada				
Titres du gouvernement fédéral	0	19 018	0	19 018
Prêts avec participation et cession	0	268	0	268
Îles Caïmans				
Titres adossés à des actifs	0	5 341	0	5 341
Obligations et billets de sociétés	0	646	0	646
Prêts avec participation et cession	0	135	0	135
Chypre				
Obligations et billets de sociétés	0	203	0	203
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0	131	0	131
Finlande				
Obligations et billets de sociétés	0	217	0	217
France				
Obligations et billets de sociétés	0	1 949	0	1 949
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	1 502	0	1 502
Hong Kong				
Obligations et billets de sociétés	0	337	0	337
Irlande				
Titres adossés à des actifs	0	2 094	0	2 094
Obligations et billets de sociétés	0	227	0	227
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0	2 451	0	2 451
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	1 052	0	1 052
Jersey, îles Anglo-Normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	131	0	131
Luxembourg				
Obligations et billets de sociétés	0	1 944	0	1 944
Mexique				
Obligations et billets de sociétés	0	103	0	103
Multinational				
Obligations et billets de sociétés	0	512	0	512
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	1 130	0	1 130
Pérou				
Émissions souveraines	0	393	0	393
Roumanie				
Émissions souveraines	0	101	0	101
Slovénie				
Obligations et billets de sociétés	0	131	0	131
Afrique du Sud				
Émissions souveraines	0	3 587	0	3 587
Espagne				
Obligations et billets de sociétés	0	402	0	402
Titres privilégiés	0	284	0	284
Suisse				
Obligations et billets de sociétés	0	1 828	30	1 858
Turquie				
Émissions souveraines	0	629	0	629
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	4 134	0	4 134
Prêts avec participation et cession	0	271	0	271
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	819	0	819

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0 \$	22 342 \$	0 \$	22 342 \$
Actions ordinaires	0	0	16	16
Obligations et billets de sociétés	0	8 944	0	8 944
Prêts avec participation et cession	0	3 313	0	3 313
Obligations et billets municipaux	0	120	0	120
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	5 386	0	5 386
Organismes gouvernementaux américains	0	7 488	0	7 488
Instruments à court terme				
Prises en pension	0	17 400	0	17 400
Bons du Trésor de l'Argentine	0	123	0	123
Bons du Trésor de la Hongrie	0	189	0	189
Bons du Trésor des États-Unis	0	2 052	0	2 052
Total - Placements	0 \$	120 507 \$	46 \$	120 553 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	31	48	0	79
Hors cote	0	506	0	506
	31 \$	554 \$	0 \$	585 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(31)	(60)	0	(91)
Hors cote	0	(2 731)	0	(2 731)
	(31) \$	(2 791) \$	0 \$	(2 822) \$
Total - Instruments financiers dérivés	0 \$	(2 237) \$	0 \$	(2 237) \$
Totaux	0 \$	118 270 \$	46 \$	118 316 \$

Il n'y a eu aucun transfert significatif entre les niveaux 1, 2 ou 3 pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

#### CONCENTRATION DU PORTEFEUILLE

Le portefeuille de placements du Fonds est concentré dans les segments suivants :

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Argentine	1,0 %	0,5 %
Australie	0,0 %	0,1 %
Belgique	0,2 %	0,1 %
Bermudes	0,0 %	0,3 %
Canada	0,3 %	16,4 %
Îles Caïmans	4,6 %	5,3 %
Chypre	0,3 %	0,2 %
Danemark	0,2 %	0,1 %
Finlande	0,3 %	0,2 %
France	2,0 %	1,7 %
Allemagne	0,5 %	1,3 %
Hong Kong	0,0 %	0,3 %
Irlande	2,3 %	2,0 %
Italie	1,8 %	2,1 %
Japon	0,3 %	0,9 %
Jersey, îles Anglo-Normandes	0,2 %	0,1 %
Luxembourg	1,5 %	1,7 %
Mexique	0,7 %	0,1 %
Multinational	0,7 %	0,4 %
Pays-Bas	1,2 %	1,0 %
Pérou	0,3 %	0,3 %
Roumanie	0,1 %	0,1 %
Slovénie	0,2 %	0,1 %

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Afrique du Sud	3,3 %	3,1 %
Espagne	0,2 %	0,5 %
Suisse	0,8 %	1,6 %
Turquie	0,8 %	0,5 %
Royaume-Uni	3,4 %	4,4 %
États-Unis	92,7 %	40,6 %
Instruments à court terme	17,3 %	16,8 %
Instruments financiers dérivés	1,8 %	(1,9) %
Passifs, moins les autres actifs	(39,0) %	(0,9) %
Total (% de l'actif net)	100,0 %	100,0 %

## RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

### RISQUE DE CHANGE

Les tableaux ci-dessous indiquent l'exposition globale au risque de change, sauf celui afférent à la monnaie fonctionnelle du Fonds.

Au 31 décembre 2023	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Peso argentin	41 \$	0 \$	41 \$	Peso argentin	282 \$	0 \$	282 \$
Dollar australien	30	300	330	Dollar australien	89	307	396
Réal brésilien	0	459	459	Réal brésilien	0	764	764
Livre sterling	2 624	(1 590)	1 034	Livre sterling	3 676	(2 417)	1 259
Peso chilien	0	56	56	Peso chilien	0	0	0
Yuan renminbi chinois (continental)	3	(2)	1	Yuan renminbi chinois (continental)	74	30	104
Yuan renminbi chinois (Offshore)	(1)	67	66	Yuan renminbi chinois (Offshore)	(1)	0	(1)
Peso colombien	0	130	130	Peso colombien	0	104	104
Euro	8 262	(8 573)	(311)	Euro	8 891	(10 550)	(1 659)
Forint hongrois	225	172	397	Forint hongrois	189	(188)	1
Roupie indienne	0	211	211	Roupie indienne	0	0	0
Yen japonais	589	1 372	1 961	Yen japonais	602	1 265	1 867
Peso mexicain	280	171	451	Peso mexicain	(64)	(12)	(76)
Nouveau sol péruvien	277	(282)	(5)	Nouveau sol péruvien	441	(510)	(69)
Zloty polonais	0	(783)	(783)	Zloty polonais	0	(1 164)	(1 164)
Rouble russe	0	0	0	Rouble russe	0	0	0
Dollar de Singapour	1	(217)	(216)	Dollar de Singapour	3	0	3
Rand sud-africain	2 427	(2 369)	58	Rand sud-africain	3 356	(2 612)	744
Nouvelle livre turque	0	395	395	Nouvelle livre turque	0	0	0
Dollar américain	61 948	(52 207)	9 741	Dollar américain	74 777	(64 238)	10 539
	76 706 \$	(62 690) \$	14 016 \$		92 315 \$	(79 221) \$	13 094 \$

Les tableaux ci-dessous résument le risque de change lié aux séries en \$ US, couvertes, qui est compensé par des contrats de change à terme.

Au 31 décembre 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, en \$ US, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en \$ US, série couverte	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, en \$ US, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en \$ US, série couverte	Exposition nette
	3 942 \$	(3 940) \$	2 \$		5 678 \$	(5 678) \$	0 \$

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport aux autres monnaies, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté d'environ 701 \$ (655 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport au dollar américain, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables des séries couvertes aurait diminué ou augmenté d'environ 0 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt. Ils incluent les instruments financiers du Fonds à la juste valeur, classés en fonction de la date d'échéance. Certains actifs ou passifs figurant dans l'état de la situation financière, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, ont été regroupés pour permettre la présentation ci-dessous.

<b>Actif au 31 décembre 2023</b>	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Placements, à la juste valeur	13 747 \$	1 240 \$	13 920 \$	80 723 \$	16 \$	109 646 \$
Instruments financiers dérivés	1 746	0	2	13	114	1 875
Trésorerie et devises	0	0	0	0	879	879
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	2 046	2 046
Montants à recevoir	0	0	0	0	37 678	37 678
Autres actifs	0	0	0	0	6	6
<b>Total - Actif</b>	<b>15 493 \$</b>	<b>1 240 \$</b>	<b>13 922 \$</b>	<b>80 736 \$</b>	<b>40 739 \$</b>	<b>152 130 \$</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2023</b>	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Instruments financiers dérivés	(356) \$	0 \$	(7) \$	(26) \$	(19) \$	(408) \$
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(1 236)	(1 236)
Montants à payer	0	0	0	0	(70 556)	(70 556)
<b>Total - Passif</b>	<b>(356) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(7) \$</b>	<b>(26) \$</b>	<b>(71 811) \$</b>	<b>(72 200) \$</b>

  

<b>Actif au 31 décembre 2022</b>	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Placements, à la juste valeur	38 760 \$	792 \$	17 755 \$	62 946 \$	300 \$	120 553 \$
Instruments financiers dérivés	326	32	0	16	212	586
Trésorerie et devises	0	0	0	0	1 013	1 013
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	2 334	2 334
Montants à recevoir	0	0	0	0	20 077	20 077
<b>Total - Actif</b>	<b>39 086 \$</b>	<b>824 \$</b>	<b>17 755 \$</b>	<b>62 962 \$</b>	<b>23 936 \$</b>	<b>144 563 \$</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2022</b>	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Instruments financiers dérivés	(1 601) \$	(38) \$	(23) \$	(19) \$	(1 142) \$	(2 823) \$
Montants à payer	0	0	0	0	(24 510)	(24 510)
<b>Total - Passif</b>	<b>(1 601) \$</b>	<b>(38) \$</b>	<b>(23) \$</b>	<b>(19) \$</b>	<b>(25 652) \$</b>	<b>(27 333) \$</b>

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si les taux d'intérêt en vigueur avaient progressé ou reculé de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 2 392 \$ ou 3,0 % (3 400 \$, ou 2,9 %, au 31 décembre 2022). La sensibilité du Fonds à la variation des taux d'intérêt a été estimée d'après la durée moyenne pondérée des instruments de créance. Dans les faits, les résultats des opérations peuvent différer et la différence peut être importante.

AUTRE RISQUE DE PRIX

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'était pas exposé à l'autre risque de prix de façon importante, car il détenait surtout des titres de créance.

RISQUE DE LIQUIDITÉ

Les tableaux ci-dessous font état des passifs du Fonds, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, par date de paiement contractuel : moins de trois mois, de trois mois à un an ou plus d'un an, selon le cas.

<b>Passif courant au 31 décembre 2023</b>	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Total
Instruments financiers dérivés	375 \$	0 \$	33 \$	408 \$
Achats de placements à payer	70 452	0	0	70 452
Dépôts de contreparties	1 236	0	0	1 236
Montants à payer pour les parts rachetées	54	0	0	54
Impôts et taxes à payer	1	0	0	1
Frais de gestion à payer	49	0	0	49
<b>Total - Passif</b>	<b>72 167 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>33 \$</b>	<b>72 200 \$</b>

<b>Passif courant au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	2 791 \$	32 \$	0 \$	2 823 \$
Achats de placements à payer	24 311	0	0	24 311
Montants à payer pour les parts rachetées	126	0	0	126
Impôts et taxes à payer	10	0	0	10
Frais de gestion à payer	63	0	0	63
<b>Total - Passif</b>	<b>27 301 \$</b>	<b>32 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>27 333 \$</b>

## RISQUE DE CRÉDIT

Les tableaux ci-dessous résument la composition des notations des instruments financiers du Fonds.

	<b>Au 31 décembre 2023</b>	<b>Au 31 décembre 2022</b>
Catégorie investissement	76 %	71 %
Inférieur à la catégorie investissement	24 %	29 %
Sans notation	0 %	0 %
Total (% des placements et des instruments financiers dérivés)	100 %	100 %

Les notations sont fournies par Standard & Poor's Ratings Services (S&P), Moody's Investors Services, Inc. (Moody's), Fitch Ratings, Inc. (Fitch) ou DBRS Limited (DBRS). Lorsqu'il existe plus d'une notation pour un titre, la plus élevée a été retenue. Si la notation d'un instrument n'est pas fournie par l'une de ces agences, un titre reçoit une notation interne. Les notations inférieures à la catégorie investissement sont celles inférieures à Baa3 selon Moody's, à BAA- selon la notation interne, à BBB- selon S&P et Fitch, et à BBBL selon DBRS.

## États de la situation financière Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
<b>Actif :</b>		
Actif courant :		
<i>Placements, à la juste valeur</i>		
Placements dans des titres <sup>†</sup>	380 619 USD	360 659 USD
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	158	73
Hors cote	8 837	2 818
Trésorerie	650	481
Dépôts auprès de contreparties	967	4 405
Devises	707	502
Montants à recevoir pour les placements vendus	16 291	29 746
Montants à recevoir pour les parts vendues	176	1 629
Intérêts et dividendes à recevoir	3 878	3 455
	412 283	403 768
<b>Passif :</b>		
Passif courant :		
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	58	24
Hors cote	349	6 020
Achats de placements à payer	24 208	45 454
Dépôts de contreparties	6 722	606
Montants à payer pour les parts rachetées	295	1 270
Distributions à payer	277	410
Frais de gestion à payer	164	186
	32 073	53 970
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>380 210 USD</b>	<b>349 798 USD</b>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A (\$ US)	680 USD	914 USD
Nombre de parts rachetables - série A (\$ US)	74	102
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A (\$ US)	9,28 USD	8,97 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F (\$ US)	5 669 USD	7 090 USD
Nombre de parts rachetables - série F (\$ US)	611	791
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F (\$ US)	9,28 USD	8,97 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I (\$ US)	13 USD	12 USD
Nombre de parts rachetables - série I (\$ US)	1	1
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I (\$ US)	9,28 USD	8,97 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série M (\$ US)	9 115 USD	5 932 USD
Nombre de parts rachetables - série M (\$ US)	982	662
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série M (\$ US)	9,28 USD	8,97 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série O (\$ US)	2 406 USD	6 106 USD
Nombre de parts rachetables - série O (\$ US)	259	681
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série O (\$ US)	9,28 USD	8,97 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A	19 785 USD	21 077 USD
Nombre de parts rachetables - série A	2 958	3 302
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	6,69 USD	6,38 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	8,86 \$	8,64 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F	62 972 USD	77 546 USD
Nombre de parts rachetables - série F	9 416	12 149
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	6,69 USD	6,38 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	8,86 \$	8,64 \$

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I	144 277 USD	109 981 USD
Nombre de parts rachetables - série I	21 573	17 231
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	6,69 USD	6,38 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	8,86 \$	8,64 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série M	113 499 USD	96 981 USD
Nombre de parts rachetables - série M	16 971	15 193
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série M	6,69 USD	6,38 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série M	8,86 \$	8,64 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série O	11 128 USD	12 172 USD
Nombre de parts rachetables - série O	1 664	1 907
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série O	6,69 USD	6,38 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série O	8,86 \$	8,64 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série FNB	10 666 USD	11 987 USD
Nombre de parts rachetables - série FNB	850	1 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série FNB	12,55 USD	11,99 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série FNB	16,63 \$	16,23 \$
† Comprend les prises en pension de :	19 600 USD	24 400 USD

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États du résultat global Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	Exercice clos le 31 décembre 2023	Exercice clos le 31 décembre 2022
<b>Revenus :</b>		
<b>Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés</b>		
Intérêts à distribuer	16 971 USD	15 457 USD
Revenu (perte) sur dividendes	27	66
Revenu (perte) sur instruments dérivés	(193)	502
Gain (perte) net réalisé à la vente de placements	(25 852)	(29 078)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(1 450)	4 821
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés hors cote	(3 103)	(18 061)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	37 876	(71 889)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(535)	(584)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés hors cote	11 631	(6 417)
Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés	35 372	(105 183)
<b>Autres revenus (pertes)</b>		
Gain (perte) net réalisé sur opérations en devises	(338)	1 651
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente à la conversion des actifs et des passifs libellés en devises	(1)	(55)
Autres revenus (pertes)	(339)	1 596
Total - Revenus (pertes)	35 033	(103 587)
<b>Charges :</b>		
Frais de gestion	2 025	2 679
Frais liés au CEI	2	3
Charges d'intérêts	120	25
Retenues d'impôts	40	59
Coûts de transaction	1	1
Total - Charges	2 188	2 767
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	32 845 USD	(106 354) USD
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série</b>		
Série A (\$ US)	48 USD	(282) USD
Série F (\$ US)	423	(3 335)
Série I (\$ US)	1	(2)
Série M (\$ US)	734	(3 608)
Série O (\$ US)	82	(1 553)
Série A	1 577	(7 397)
Série F	5 518	(30 862)
Série I	13 656	(20 151)
Série M	9 043	(30 035)
Série O	851	(4 693)
Série FNB	912	(4 436)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part</b>		
Série A (\$ US)	0,53 USD	(2,07) USD
Série F (\$ US)	0,62	(2,21)
Série I (\$ US)	0,73	(1,74)
Série M (\$ US)	1,04	(2,39)
Série O (\$ US)	0,14	(1,90)
Série A	0,49	(2,01)
Série F	0,49	(2,05)
Série I	0,75	(1,63)
Série M	0,51	(1,92)
Série O	0,45	(2,06)
Série FNB	1,00	(3,79)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

---

(CETTE PAGE EST INTENTIONNELLEMENT LAISSÉE EN BLANC)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

	Exercice clos le 31 décembre 2023				
	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Série I (\$ US)	Série M (\$ US)	Série O (\$ US)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	914 USD	7 090 USD	12 USD	5 932 USD	6 106 USD
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	48	423	1	734	82
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>					
Provenant du revenu net de placement	(26)	(231)	(1)	(253)	(172)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(26)	(231)	(1)	(253)	(172)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>					
Produit de la vente de parts rachetables	337	1 920	0	4 947	666
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	21	136	1	177	168
Coût des parts rachetables rachetées	(614)	(3 669)	0	(2 422)	(4 444)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(256)	(1 613)	1	2 702	(3 610)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(234)	(1 421)	1	3 183	(3 700)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	680 USD	5 669 USD	13 USD	9 115 USD	2 406 USD
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>					
Parts rachetables vendues	38	213	0	569	73
Parts émises au réinvestissement des distributions	2	15	0	20	19
Parts rachetables rachetées	(68)	(408)	0	(269)	(514)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(28)	(180)	0	320	(422)
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	102	791	1	662	681
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	74	611	1	982	259

	Exercice clos le 31 décembre 2022				
	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Série I (\$ US)	Série M (\$ US)	Série O (\$ US)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	1 831 USD	21 598 USD	15 USD	25 370 USD	9 807 USD
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(282)	(3 335)	(2)	(3 608)	(1 553)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>					
Provenant du revenu net de placement	(35)	(463)	(1)	(480)	(234)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(35)	(463)	(1)	(480)	(234)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>					
Produit de la vente de parts rachetables	233	3 926	0	4 153	890
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	28	250	0	192	208
Coût des parts rachetables rachetées	(861)	(14 886)	0	(19 695)	(3 012)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(600)	(10 710)	0	(15 350)	(1 914)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(917)	(14 508)	(3)	(19 438)	(3 701)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	914 USD	7 090 USD	12 USD	5 932 USD	6 106 USD
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>					
Parts rachetables vendues	22	392	0	421	90
Parts émises au réinvestissement des distributions	3	26	0	20	22
Parts rachetables rachetées	(88)	(1 567)	0	(2 058)	(312)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(63)	(1 149)	0	(1 617)	(200)
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	165	1 940	1	2 279	881
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	102	791	1	662	681

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

**Exercice clos le 31 déc. 2023**

Série A	Série F	Série I	Série M	Série O	Série FNB	Total
21 077 USD	77 546 USD	109 981 USD	96 981 USD	12 172 USD	11 987 USD	349 798 USD
1 577	5 518	13 656	9 043	851	912	32 845
(667)	(2 705)	(5 428)	(4 484)	(409)	(426)	(14 802)
(667)	(2 705)	(5 428)	(4 484)	(409)	(426)	(14 802)
6 112	27 029	95 409	44 084	3 980	2 378	186 862
550	1 677	5 432	2 675	320	0	11 157
(8 864)	(46 093)	(74 773)	(34 800)	(5 786)	(4 185)	(185 650)
(2 202)	(17 387)	26 068	11 959	(1 486)	(1 807)	12 369
(1 292)	(14 574)	34 296	16 518	(1 044)	(1 321)	30 412
19 785 USD	62 972 USD	144 277 USD	113 499 USD	11 128 USD	10 666 USD	380 210 USD
947	4 188	15 068	6 817	614	200	S.O.
86	261	846	417	50	0	S.O.
(1 377)	(7 182)	(11 572)	(5 456)	(907)	(350)	S.O.
(344)	(2 733)	4 342	1 778	(243)	(150)	S.O.
3 302	12 149	17 231	15 193	1 907	1 000	S.O.
2 958	9 416	21 573	16 971	1 664	850	S.O.

**Exercice clos le 31 déc. 2022**

Série A	Série F	Série I	Série M	Série O	Série FNB	Total
36 106 USD	161 791 USD	81 709 USD	170 277 USD	24 893 USD	29 774 USD	563 171 USD
(7 397)	(30 862)	(20 151)	(30 035)	(4 693)	(4 436)	(106 354)
(748)	(3 600)	(3 853)	(4 002)	(487)	(582)	(14 485)
(748)	(3 600)	(3 853)	(4 002)	(487)	(582)	(14 485)
6 759	42 803	95 334	46 278	1 478	2 310	204 164
609	2 001	3 854	2 229	361	0	9 732
(14 252)	(94 587)	(46 912)	(87 766)	(9 380)	(15 079)	(306 430)
(6 884)	(49 783)	52 276	(39 259)	(7 541)	(12 769)	(92 534)
(15 029)	(84 245)	28 272	(73 296)	(12 721)	(17 787)	(213 373)
21 077 USD	77 546 USD	109 981 USD	96 981 USD	12 172 USD	11 987 USD	349 798 USD
940	5 929	13 755	6 873	206	200	S.O.
87	284	558	318	52	0	S.O.
(1 964)	(13 057)	(6 674)	(11 989)	(1 273)	(1 050)	S.O.
(937)	(6 844)	7 639	(4 798)	(1 015)	(850)	S.O.
4 239	18 993	9 592	19 991	2 922	1 850	S.O.
3 302	12 149	17 231	15 193	1 907	1 000	S.O.

## Tableaux des flux de trésorerie Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada)

(en milliers*)	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	32 845 USD	(106 354) USD
<b>Ajustements au titre du rapprochement de l'augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et des entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation :</b>		
Achats de titres	(4 467 527)	(2 602 239)
Produit de la vente de placements	4 452 548	2 708 496
(Augmentation) diminution des dépôts auprès de contreparties	3 438	(2 265)
(Augmentation) diminution des intérêts et des dividendes à recevoir	(423)	1 449
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(2 036)	4 147
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés hors cote	(3 162)	(18 494)
Augmentation (diminution) des dépôts de contreparties	6 116	606
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(22)	(185)
Produit des opérations de vente à découvert	0	645
Paiements au titre des opérations de vente à découvert	0	(645)
Produit (paiements) au titre des opérations en devises	(304)	1 639
<i>(Gain) perte nette réalisée</i>		
Placements	25 852	29 078
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	1 450	(4 821)
Instruments financiers dérivés hors cote	3 103	18 061
Opérations en devises	338	(1 651)
<i>Variation nette de la (plus-value) moins-value latente</i>		
Placements	(37 876)	71 889
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	535	584
Instruments financiers dérivés hors cote	(11 631)	6 417
Conversion de passifs et d'actifs libellés en devises	1	55
Amortissement net des primes (des escomptes) sur les placements	(748)	(431)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation</b>	<b>2 497</b>	<b>105 981</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement :</b>		
Produit de la vente de parts rachetables**	156 587	166 957
Montant payé au titre du rachat de parts rachetables**	(154 897)	(269 432)
Distributions en trésorerie versées aux porteurs de parts rachetables	(3 778)	(4 821)
Produit des accords cadres sur transactions à livrer	68 343	98 308
Paiements au titre des accords cadres sur transactions à livrer	(68 343)	(98 308)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement</b>	<b>(2 088)</b>	<b>(107 296)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des devises</b>	<b>409</b>	<b>(1 315)</b>
<b>Trésorerie (découvert) et devises :</b>		
Ouverture de l'exercice	983	2 341
Gain (perte) de change sur la trésorerie	(35)	(43)
Clôture de l'exercice	1 357 USD	983 USD
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie :</b>		
Intérêts payés liés aux activités de financement	109 USD	23 USD
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	15 754 USD	16 440 USD
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	29 USD	64 USD

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

\*\* Ne comprend pas les transferts hors trésorerie entre les séries.

(en milliers \$, sauf le nombre d'actions, de contrats, de parts ou d'onces, selon le cas)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES 100,1 %</b>							
<b>AUSTRALIE 1,0 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,0 %</b>							
<b>Commonwealth Bank of Australia</b> 3,743 %, échéant le 12 sept. 2039 <sup>b)</sup>	2 100 USD	2 100 USD	1 657 USD				
<b>Northern Star Resources Ltd.</b> 6,125 %, échéant le 11 avr. 2033	900	891	905				
<b>Santos Finance Ltd.</b> 3,649 %, échéant le 29 avr. 2031	800	802	697				
6,875 %, échéant le 19 sept. 2033	100	99	106				
<b>Transurban Finance Co. Pty. Ltd.</b> 2,450 %, échéant le 16 mars 2031	325	325	271				
Total - Australie		<u>4 217</u>	<u>3 636</u>				
<b>BERMUDES 0,1 %</b>							
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 0,0 %</b>							
<b>MAPS Ltd.</b> 4,212 %, échéant le 15 mai 2043	190 USD	190	171				
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %</b>							
<b>Arch Capital Group Ltd.</b> 3,635 %, échéant le 30 juin 2050	245	246	187				
Total - Bermudes		<u>436</u>	<u>358</u>				
<b>BRÉSIL 0,2 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>							
<b>CSN Resources SA</b> 4,625 %, échéant le 10 juin 2031	700 USD	700	573				
Total - Brésil		<u>700</u>	<u>573</u>				
<b>CANADA 2,7 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 2,7 %</b>							
<b>Air Canada Pass-Through Trust</b> 3,300 %, échéant le 15 juill. 2031	1 860 USD	1 860	1 673				
3,700 %, échéant le 15 juill. 2027	255	250	242				
<b>Brookfield Finance, Inc.</b> 3,625 %, échéant le 15 févr. 2052	600	599	428				
4,700 %, échéant le 20 sept. 2047	800	794	697				
<b>Enbridge, Inc.</b> 6,250 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2078	2 400	2 400	2 223				
<b>Fairfax Financial Holdings Ltd.</b> 2,750 %, échéant le 29 mars 2028	1 100 EUR	1 193	1 161				
3,950 %, échéant le 3 mars 2031	3 300 \$	2 644	2 346				
4,850 %, échéant le 17 avr. 2028	500 USD	499	493				
<b>Great-West Lifeco, Inc.</b> 2,981 %, échéant le 8 juill. 2050	300 \$	190	176				
<b>Macmillan Bloedel Pembroke LP</b> 7,700 %, échéant le 15 févr. 2026	900 USD	1 145	941				
Total - Canada		<u>11 574</u>	<u>10 380</u>				
<b>ÎLES CAÏMANS 3,2 %</b>							
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 1,6 %</b>							
<b>Allegro CLO Ltd.</b> 6,827 %, échéant le 20 juill. 2032	1 000 USD	1 000	998				
<b>American Money Management Corp. CLO Ltd.</b> 6,581 %, échéant le 10 nov. 2030	487	486	486				
<b>Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.</b> 6,757 %, échéant le 20 janv. 2032	598	598	598				
<b>CIFC Funding Ltd.</b> 6,864 %, échéant le 17 oct. 2031	500 USD	500 USD	500 USD				
<b>Elmwood CLO Ltd.</b> 6,717 %, échéant le 20 oct. 2034	500	500	501				
<b>GoldenTree Loan Management U.S. CLO Ltd.</b> 6,587 %, échéant le 20 nov. 2030	855	854	855				
<b>Marathon CLO Ltd.</b> 6,943 %, échéant le 15 nov. 2031	1 000	1 000	1 000				
<b>METAL LLC</b> 4,581 %, échéant le 15 oct. 2042	469	469	291				
<b>TWC CLO Ltd.</b> 6,610 %, échéant le 25 avr. 2031	428	425	428				
<b>Voya CLO Ltd.</b> 6,744 %, échéant le 17 oct. 2032	500	500	501				
		<u>6 332</u>	<u>6 158</u>				
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES 0,0 %</b>							
<b>Sunac China Holdings Ltd. (1,000 % en titres à rendement réinvesti)</b> 1,000 %, échéant le 30 sept. 2032 <sup>b)</sup>	13	2	1				
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,6 %</b>							
<b>Alibaba Group Holding Ltd.</b> 2,125 %, échéant le 9 févr. 2031	800	799	663				
<b>Avolon Holdings Funding Ltd.</b> 2,528 %, échéant le 18 nov. 2027	565	566	501				
2,875 %, échéant le 15 févr. 2025	200	200	193				
6,375 %, échéant le 4 mai 2028	200	201	204				
<b>Kaisa Group Holdings Ltd.</b> 9,375 %, échéant le 30 juin 2024 <sup>^</sup>	650	635	24				
11,700 %, échéant le 11 nov. 2025 <sup>^</sup>	250	244	9				
<b>Melco Resorts Finance Ltd.</b> 4,875 %, échéant le 6 juin 2025	1 300	1 281	1 262				
<b>MGM China Holdings Ltd.</b> 4,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2027	550	567	524				
5,250 %, échéant le 18 juin 2025	300	311	295				
<b>Sands China Ltd.</b> 5,650 %, échéant le 8 août 2028	700	759	695				
<b>Seagate HDD Cayman</b> 4,125 %, échéant le 15 janv. 2031	145	150	130				
9,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> décembre 2032	204	414	233				
<b>Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % en trésorerie ou 6,000 % en titres à rendement réinvesti)</b> 5,000 %, échéant le 30 sept. 2026 <sup>b)</sup>	18	2	2				
<b>Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % en trésorerie ou 6,250 % en titres à rendement réinvesti)</b> 5,250 %, échéant le 30 sept. 2027 <sup>b)</sup>	18	2	1				
<b>Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % en trésorerie ou 6,500 % en titres à rendement réinvesti)</b> 5,500 %, échéant le 30 sept. 2027 <sup>b)</sup>	35	4	3				
<b>Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % en trésorerie ou 6,750 % en titres à rendement réinvesti)</b> 5,750 %, échéant le 30 sept. 2028 <sup>b)</sup>	53	5	2				
<b>Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % en trésorerie ou 7,000 % en titres à rendement réinvesti)</b> 6,000 %, échéant le 30 sept. 2029 <sup>b)</sup>	53	8	3				
<b>Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % en trésorerie ou 7,250 % en titres à rendement réinvesti)</b> 6,250 %, échéant le 30 sept. 2030 <sup>b)</sup>	25	2	1				
<b>Tencent Music Entertainment Group</b> 2,000 %, échéant le 3 sept. 2030	200	194	163				

## Inventaire du portefeuille Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Wynn Macau Ltd.</b>			
4,875 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2024	300 USD	300 USD	296 USD
5,500 %, échéant le 15 janv. 2026	700	711	684
		<u>7 355</u>	<u>5 888</u>
Total - Îles Caïmans		<u>13 689</u>	<u>12 047</u>
<b>CHILI 0,1 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,1 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement du Chili</b>			
4,000 %, échéant le 31 janv. 2052	600 USD	594	495
Total - Chili		<u>594</u>	<u>495</u>
<b>CHINE 0,2 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
<b>SF Holding Investment Ltd.</b>			
2,875 %, échéant le 20 févr. 2030	900 USD	891	796
Total - Chine		<u>891</u>	<u>796</u>
<b>DANEMARK 0,1 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %</b>			
<b>Nykredit Realkredit AS</b>			
1,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2053	2 028 DKK	307	238
Total - Danemark		<u>307</u>	<u>238</u>
<b>FRANCE 0,2 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
<b>Société Générale SA</b>			
1,488 %, échéant le 14 déc. 2026	300 USD	300	276
6,691 %, échéant le 10 janv. 2034	400	402	423
Total - France		<u>702</u>	<u>699</u>
<b>ALLEMAGNE 0,5 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>			
<b>Deutsche Bank AG</b>			
1,750 %, échéant le 19 nov. 2030	2 100 EUR	2 512	2 018
Total - Allemagne		<u>2 512</u>	<u>2 018</u>
<b>INDE 0,2 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
<b>Adani Electricity Mumbai Ltd.</b>			
3,949 %, échéant le 12 févr. 2030	262 USD	262	215
<b>Indian Railway Finance Corp. Ltd.</b>			
3,249 %, échéant le 13 févr. 2030	600	600	543
Total - Inde		<u>862</u>	<u>758</u>
<b>IRLANDE 0,4 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
<b>AerCap Ireland Capital DAC</b>			
3,400 %, échéant le 29 oct. 2033	250 USD	242	215
<b>Perrigo Finance Unlimited Co.</b>			
4,650 %, échéant le 15 juin 2030	400	397	364
		<u>639</u>	<u>579</u>
<b>PRÊTS AVEC PARTICIPATION ET CESSION 0,2 %</b>			
<b>Setanta Aircraft Leasing DAC</b>			
7,610 %, échéant le 5 nov. 2028	700	698	703
Total - Irlande		<u>1 337</u>	<u>1 282</u>

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>ITALIE 0,1 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %</b>			
<b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b>			
1,875 %, échéant le 9 janv. 2026	500 EUR	601 USD	525 USD
Total - Italie		<u>601</u>	<u>525</u>
<b>JAPON 1,7 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,7 %</b>			
<b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b>			
2,048 %, échéant le 17 juill. 2030	700 USD	700	589
5,422 %, échéant le 22 févr. 2029	900	900	917
5,441 %, échéant le 22 févr. 2034	500	500	517
5,475 %, échéant le 22 févr. 2031	500	500	513
<b>Nippon Life Insurance Co.</b>			
6,250 %, échéant le 13 sept. 2053	200	200	210
<b>Nomura Holdings, Inc.</b>			
2,329 %, échéant le 22 janv. 2027	600	600	550
<b>Renesas Electronics Corp.</b>			
2,170 %, échéant le 25 nov. 2026	500	487	457
<b>Sumitomo Life Insurance Co.</b>			
4,000 %, échéant le 14 sept. 2077	300	283	282
<b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>			
3,202 %, échéant le 17 sept. 2029 <sup>h)</sup>	1 200	1 200	1 092
5,710 %, échéant le 13 janv. 2030	1 400	1 400	1 455
Total - Japon		<u>6 770</u>	<u>6 582</u>
<b>JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES 0,2 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 0,2 %</b>			
<b>Goldentree Loan Management U.S. CLO Ltd.</b>			
7,027 %, échéant le 20 janv. 2034	800 USD	800	800
Total - Jersey, Îles anglo-normandes		<u>800</u>	<u>800</u>
<b>LUXEMBOURG 0,1 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %</b>			
<b>Adecoagro SA</b>			
6,000 %, échéant le 21 sept. 2027	200 USD	200	194
<b>Constellation Oil Services Holding SA (3,000 % en trésorerie ou 4,000 % en titres à rendement réinvesti)</b>			
3,000 %, échéant le 31 déc. 2026 <sup>b)</sup>	155	116	112
<b>Corestate Capital Holding SA (8,000 % en trésorerie ou 9,000 % en titres à rendement réinvesti)</b>			
8,000 %, échéant le 31 déc. 2026 <sup>a,b)</sup>	43 EUR	51	25
<b>Greensaif Pipelines Bidco SARL</b>			
6,129 %, échéant le 23 févr. 2038	200 USD	200	209
Total - Luxembourg		<u>567</u>	<u>540</u>
<b>MEXICO 0,6 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %</b>			
<b>Banco Mercantil del Norte SA</b>			
7,500 %, échéant le 27 juin 2029 <sup>g,l,h)</sup>	200 USD	200	189
<b>Industrias Penoles SAB de CV</b>			
4,150 %, échéant le 12 sept. 2029	200	212	187
4,750 %, échéant le 6 août 2050	200	200	161
		<u>612</u>	<u>537</u>

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,5 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement du Mexique</b>			
2,750 %, échéant le 27 nov. 2031 <sup>h</sup>	17 565 MXN	850 USD	913 USD
3,000 %, échéant le 3 déc. 2026 <sup>h</sup>	7 984	434	437
4,000 %, échéant le 30 nov. 2028 <sup>h</sup>	7 984	426	460
		<u>1 710</u>	<u>1 810</u>
Total - Mexique		<u>2 322</u>	<u>2 347</u>

**MULTINATIONAL 0,0 %****OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,0 %**

<b>Delta Air Lines, Inc.</b>			
4,750 %, échéant le 20 oct. 2028	100 USD	100	98
Total - Multinational		<u>100</u>	<u>98</u>

**PAYS-BAS 0,8 %****OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,8 %**

<b>EDP Finance BV</b>			
6,300 %, échéant le 11 oct. 2027	800 USD	799	840
<b>ING Groep NV</b>			
4,875 %, échéant le 16 mai 2029 <sup>g, h</sup>	1 400	1 400	1 162
<b>OCI NV</b>			
6,700 %, échéant le 16 mars 2033	500	499	511
<b>Prosus NV</b>			
4,193 %, échéant le 19 janv. 2032	800	800	691
Total - Pays-Bas		<u>3 498</u>	<u>3 204</u>

**PANAMA 0,0 %****OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,0 %**

<b>Carnival Corp.</b>			
7,000 %, échéant le 15 août 2029	115 USD	115	120
Total - Panama		<u>115</u>	<u>120</u>

**PÉROU 0,1 %****OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %**

<b>Banco de Credito del Peru SA</b>			
4,650 %, échéant le 17 sept. 2024	1 700 PEN	509	446
Total - Pérou		<u>509</u>	<u>446</u>

**PORTO RICO 0,1 %****OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %**

<b>Popular, Inc.</b>			
7,250 %, échéant le 13 mars 2028	500 USD	498	515
Total - Porto Rico		<u>498</u>	<u>515</u>

**ROUMANIE 0,1 %****ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,1 %**

<b>Obligations internationales du gouvernement de la Roumanie</b>			
3,750 %, échéant le 7 févr. 2034	300 EUR	336	286
Total - Roumanie		<u>336</u>	<u>286</u>

**ARABIE SAOUDITE 0,4 %****ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,4 %**

<b>Obligations internationales du gouvernement de l'Arabie saoudite</b>			
5,000 %, échéant le 18 janv. 2053	1 500 USD	1 390	1 416
Total - Arabie saoudite		<u>1 390</u>	<u>1 416</u>

**AFRIQUE DU SUD 0,4 %****OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %**

<b>AngloGold Ashanti Holdings PLC</b>			
3,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2030	200 USD	199 USD	174 USD

**ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,3 %****Obligations internationales du gouvernement de l'Afrique du Sud**

8,000 %, échéant le 31 janv. 2030	8 400 ZAR	524	423
8,875 %, échéant le 28 févr. 2035	15 000	862	692
		<u>1 386</u>	<u>1 115</u>
Total - Afrique du Sud		<u>1 585</u>	<u>1 289</u>

**ESPAGNE 0,1 %****OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %**

<b>Cellnex Finance Co. SA</b>			
3,875 %, échéant le 7 juill. 2041	700 USD	691	543
Total - Espagne		<u>691</u>	<u>543</u>

**SUISSE 1,0 %****OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,0 %**

<b>Credit Suisse AG</b>			
7,500 %, échéant le 15 févr. 2028	1 400 USD	1 397	1 534
<b>UBS AG</b>			
5,125 %, échéant le 15 mai 2024 <sup>h</sup>	500	551	497
<b>UBS Group AG</b>			
3,091 %, échéant le 14 mai 2032	250	157	213
4,375 %, échéant le 10 févr. 2031 <sup>g, h</sup>	1 500	1 503	1 188
6,246 %, échéant le 22 sept. 2029	500	500	522
Total - Suisse		<u>4 108</u>	<u>3 954</u>

**ÉMIRATS ARABES UNIS 0,3 %****OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,3 %**

<b>DAE Sukuk Difc Ltd.</b>			
3,750 %, échéant le 15 févr. 2026	1 000 USD	994	963
Total - Émirats arabes unis		<u>994</u>	<u>963</u>

**ROYAUME-UNI 4,6 %****OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 4,5 %**

<b>Barclays PLC</b>			
5,501 %, échéant le 9 août 2028	2 700 USD	2 733	2 714
6,224 %, échéant le 9 mai 2034	200	200	207
<b>Ferguson Finance PLC</b>			
3,250 %, échéant le 2 juin 2030	200	199	179
<b>HSBC Holdings PLC</b>			
3,973 %, échéant le 22 mai 2030	300	300	280
5,402 %, échéant le 11 août 2033	3 500	3 500	3 517
5,875 %, échéant le 28 sept. 2026 <sup>g, h</sup>	200 GBP	265	243
<b>Imperial Brands Finance PLC</b>			
6,125 %, échéant le 27 juill. 2027	1 000 USD	1 022	1 027
<b>Lloyds Bank PLC</b>			
0,000 %, échéant le 2 avr. 2032	1 200	985	776
<b>Lloyds Banking Group PLC</b>			
5,985 %, échéant le 7 août 2027	200	200	204
<b>National Grid PLC</b>			
5,809 %, échéant le 12 juin 2033	400	400	421
<b>NatWest Group PLC</b>			
4,892 %, échéant le 18 mai 2029	5 000	5 000	4 915

## Inventaire du portefeuille Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Standard Chartered PLC</b> 3,603 %, échéant le 12 janv. 2033	600 USD	600 USD	498 USD				
<b>TP ICAP Finance PLC</b> 2,625 %, échéant le 18 nov. 2028	1 000 GBP	1 333	1 068				
<b>Vodafone Group PLC</b> 7,000 %, échéant le 4 avr. 2079	100 USD	100	103				
<b>Weir Group PLC</b> 2,200 %, échéant le 13 mai 2026	900	898	837				
		<u>17 735</u>	<u>16 989</u>				
	ACTIONS						
<b>TITRES PRIVILÉGIÉS 0,1 %</b>							
<b>Nationwide Building Society</b> 10,250 %	2 068	434	344				
Total - Royaume-Uni		<u>18 169</u>	<u>17 333</u>				
	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)						
<b>ÉTATS-UNIS 75,4 %</b>							
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 1,1 %</b>							
<b>ABFC Trust</b> 5,690 %, échéant le 25 janv. 2037	72 USD	49 USD	42 USD				
<b>BDS Ltd.</b> 7,492 %, échéant le 19 août 2038	400	399	402				
<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b> 5,530 %, échéant le 25 juill. 2045	33	25	22				
<b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust</b> 6,220 %, échéant le 25 mars 2034	40	39	40				
<b>Fremont Home Loan Trust</b> 5,530 %, échéant le 25 janv. 2037	37	23	17				
5,810 %, échéant le 25 févr. 2036	234	207	222				
<b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b> 5,660 %, échéant le 25 avr. 2037	1 233	878	797				
5,790 %, échéant le 25 avr. 2037	385	299	330				
<b>Labrador Aviation Finance Ltd.</b> 4,300 %, échéant le 15 janv. 2042	1 143	1 124	977				
<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b> 5,700 %, échéant le 25 févr. 2037	63	37	20				
<b>Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust</b> 5,520 %, échéant le 25 nov. 2036	25	14	8				
<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b> 6,190 %, échéant le 25 avr. 2037	234	143	66				
<b>Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.</b> 5,102 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2035	500	500	510				
<b>Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust</b> 5,710 %, échéant le 25 août 2036	1 037	643	617				
		<u>4 380</u>	<u>4 070</u>				
	ACTIONS						
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,0 %</b>							
<b>Constellation Oil, B<sup>d</sup></b>	168 354	18	18				
<b>Stearns Holding LLC, B<sup>d</sup></b>	24 918	44	0				
		<u>62</u>	<u>18</u>				
	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 53,2 %</b>							
<b>AbbVie, Inc.</b> 4,250 %, échéant le 21 nov. 2049	1 100 USD	942	981				
<b>Adventist Health System</b> 5,430 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2032	200	200	204				
<b>AES Corp.</b> 5,450 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2028	1 100 USD	1 093 USD	1 119 USD				
<b>Alaska Airlines, fiducie à flux identiques</b> 4,800 %, échéant le 15 févr. 2029	229	232	223				
<b>Alexandria Real Estate Equities, Inc.</b> 3,550 %, échéant le 15 mars 2052	1 100	1 095	805				
<b>Ally Financial, Inc.</b> 6,700 %, échéant le 14 févr. 2033	900	880	902				
6,848 %, échéant le 3 janv. 2030	400	400	411				
6,992 %, échéant le 13 juin 2029	200	200	207				
<b>AMC Networks, Inc.</b> 4,250 %, échéant le 15 févr. 2029	700	700	535				
<b>American Airlines, fiducie à flux identiques</b> 3,200 %, échéant le 15 déc. 2029	472	440	431				
3,575 %, échéant le 15 juill. 2029	467	431	436				
4,000 %, échéant le 15 janv. 2027	78	78	75				
<b>American Electric Power Co., Inc.</b> 5,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2033	1 400	1 409	1 459				
<b>American Homes 4 Rent LP</b> 4,250 %, échéant le 15 févr. 2028	2 300	2 195	2 235				
<b>American Tower Corp.</b> 2,100 %, échéant le 15 juin 2030	1 200	975	1 007				
2,700 %, échéant le 15 avr. 2031	500	499	430				
3,700 %, échéant le 15 oct. 2049	500	531	380				
3,950 %, échéant le 15 mars 2029	500	550	478				
5,250 %, échéant le 15 juill. 2028	400	399	407				
5,650 %, échéant le 15 mars 2033	1 200	1 195	1 248				
<b>Amgen, Inc.</b> 5,650 %, échéant le 2 mars 2053	3 800	3 836	4 001				
<b>Antares Holdings LP</b> 3,750 %, échéant le 15 juill. 2027	500	495	451				
7,950 %, échéant le 11 août 2028	400	399	414				
<b>Appalachian Power Co.</b> 6,375 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2036	282	344	304				
<b>Ares Finance Co. LLC</b> 3,250 %, échéant le 15 juin 2030	500	499	442				
<b>Ares Management Corp.</b> 6,375 %, échéant le 10 nov. 2028	400	399	420				
<b>Arizona Public Service Co.</b> 2,650 %, échéant le 15 sept. 2050	100	100	62				
3,350 %, échéant le 15 mai 2050	250	249	178				
<b>AT&amp;T, Inc.</b> 2,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2031	1 600	1 331	1 403				
3,650 %, échéant le 15 sept. 2059	1 911	1 682	1 371				
5,400 %, échéant le 15 févr. 2034	1 000	978	1 032				
<b>Aviation Capital Group LLC</b> 6,250 %, échéant le 15 avr. 2028	900	893	919				
<b>Bank of America Corp.</b> 2,687 %, échéant le 22 avr. 2032	700	700	591				
2,884 %, échéant le 22 oct. 2030	3 600	3 721	3 197				
4,571 %, échéant le 27 avr. 2033	1 100	1 100	1 049				
5,288 %, échéant le 25 avr. 2034	4 300	4 300	4 312				
5,872 %, échéant le 15 sept. 2034	200	200	209				
<b>BAT Capital Corp.</b> 2,726 %, échéant le 25 mars 2031	300	300	252				
3,557 %, échéant le 15 août 2027	316	316	302				
<b>Bayer U.S. Finance LLC</b> 6,375 %, échéant le 21 nov. 2030	1 200	1 195	1 236				
<b>BGC Group, Inc.</b> 4,375 %, échéant le 15 déc. 2025	700	652	672				
8,000 %, échéant le 25 mai 2028	100	97	104				

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Black Hills Corp.</b>							
2,500 %, échéant le 15 juin 2030	500 USD	498 USD	421 USD				
6,150 %, échéant le 15 mai 2034	100	99	104				
<b>Blackstone Holdings Finance Co. LLC</b>							
2,800 %, échéant le 30 sept. 2050	200	199	125				
3,500 %, échéant le 10 sept. 2049	1 300	1 287	946				
<b>Blue Owl Finance LLC</b>							
4,375 %, échéant le 15 févr. 2032	200	198	175				
<b>Boeing Co.</b>							
3,250 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2028	800	800	759				
3,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2031	800	799	743				
<b>Booz Allen Hamilton, Inc.</b>							
5,950 %, échéant le 4 août 2033	100	99	106				
<b>Broadcom, Inc.</b>							
3,137 %, échéant le 15 nov. 2035	307	307	252				
3,187 %, échéant le 15 nov. 2036	850	849	689				
3,419 %, échéant le 15 avr. 2033	100	101	88				
<b>Caesars Entertainment, Inc.</b>							
7,000 %, échéant le 15 févr. 2030	400	400	410				
<b>Cantor Fitzgerald LP</b>							
4,500 %, échéant le 14 avr. 2027	500	498	480				
7,200 %, échéant le 12 déc. 2028	200	200	205				
<b>Carlyle Finance Subsidiary LLC</b>							
3,500 %, échéant le 19 sept. 2029	1 100	1 098	1 030				
<b>Centene Corp.</b>							
2,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> août 2031	400	327	332				
<b>Charles Schwab Corp.</b>							
5,643 %, échéant le 19 mai 2029	500	500	513				
6,196 %, échéant le 17 nov. 2029	600	600	630				
<b>Charter Communications Operating LLC</b>							
3,750 %, échéant le 15 févr. 2028	2 100	2 082	1 984				
5,125 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juill. 2049	500	499	407				
5,375 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2047	1 450	1 536	1 234				
<b>Cheniere Corpus Christi Holdings LLC</b>							
5,125 %, échéant le 30 juin 2027	500	564	503				
<b>Cheniere Energy, Inc.</b>							
4,625 %, échéant le 15 oct. 2028	2 000	1 828	1 954				
<b>Cigna Group</b>							
4,375 %, échéant le 15 oct. 2028	1 100	1 029	1 092				
<b>Citigroup, Inc.</b>							
2,561 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2032	1 800	1 800	1 502				
2,572 %, échéant le 3 juin 2031	2 500	2 500	2 137				
6,270 %, échéant le 17 nov. 2033	800	800	856				
<b>Citizens Bank NA</b>							
5,284 %, échéant le 26 janv. 2026	250	239	242				
<b>Cleveland Electric Illuminating Co.</b>							
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2028	2 000	2 135	1 875				
<b>CNA Financial Corp.</b>							
5,500 %, échéant le 15 juin 2033	600	580	619				
<b>Commonwealth Edison Co.</b>							
3,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2050	1 200	1 198	837				
<b>Community Health Systems, Inc.</b>							
4,750 %, échéant le 15 févr. 2031	200	200	158				
<b>ConocoPhillips Co.</b>							
5,050 %, échéant le 15 sept. 2033	1 000	998	1 028				
<b>Constellation Energy Generation LLC</b>							
5,600 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2028	500	500	515				
5,800 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2033	600	614	631				
<b>Continental Resources, Inc.</b>							
2,268 %, échéant le 15 nov. 2026	1 900	1 900	1 749				
<b>Corebridge Financial, Inc.</b>							
3,900 %, échéant le 5 avr. 2032	1 600 USD	1 598 USD	1 447 USD				
<b>Corporate Office Properties LP</b>							
2,250 %, échéant le 15 mars 2026	100	99	93				
<b>Credit Acceptance Corp.</b>							
9,250 %, échéant le 15 déc. 2028	200	200	213				
<b>Credit Suisse AG AT1 Claim</b>							
	3 800	0	456				
<b>CVS Health Corp.</b>							
5,050 %, échéant le 25 mars 2048	1 300	1 488	1 217				
5,250 %, échéant le 30 janv. 2031	100	100	103				
<b>Dell International LLC</b>							
5,300 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2029	1 500	1 736	1 546				
<b>Delta Air Lines Pass-Through Trust</b>							
2,000 %, échéant le 10 déc. 2029	954	873	847				
<b>Diamond Sports Group LLC</b>							
5,375 %, échéant le 15 août 2026 <sup>^</sup>	600	595	31				
<b>Dominion Energy, Inc.</b>							
5,375 %, échéant le 15 nov. 2032	200	199	206				
<b>Duke Energy Ohio, Inc.</b>							
5,650 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2053	3 100	3 206	3 254				
<b>Enel Finance America LLC</b>							
7,100 %, échéant le 14 oct. 2027	200	198	214				
<b>Energy Transfer LP</b>							
4,400 %, échéant le 15 mars 2027	750	762	734				
5,300 %, échéant le 15 avr. 2047	1 800	1 538	1 654				
5,550 %, échéant le 15 févr. 2028	300	300	306				
<b>EnLink Midstream LLC</b>							
6,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> sept. 2030	600	594	613				
<b>Entergy Arkansas LLC</b>							
5,150 %, échéant le 15 janv. 2033	300	299	306				
<b>Entergy Corp.</b>							
2,800 %, échéant le 15 juin 2030	900	893	793				
<b>EPR Properties</b>							
4,950 %, échéant le 15 avr. 2028	300	266	285				
<b>Equifax, Inc.</b>							
5,100 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2028	400	399	404				
<b>Equinix, Inc.</b>							
3,000 %, échéant le 15 juill. 2050	600	590	408				
<b>Equitable Holdings, Inc.</b>							
5,594 %, échéant le 11 janv. 2033	200	200	206				
<b>Essex Portfolio LP</b>							
4,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2029	250	259	239				
<b>Expedia Group, Inc.</b>							
2,950 %, échéant le 15 mars 2031	27	27	24				
<b>Extra Space Storage LP</b>							
2,200 %, échéant le 15 oct. 2030	200	199	167				
3,900 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2029	100	100	95				
<b>Fidelity National Financial, Inc.</b>							
2,450 %, échéant le 15 mars 2031	200	199	166				
<b>Flex Intermediate Holdco LLC</b>							
3,363 %, échéant le 30 juin 2031	1 300	1 300	1 065				
<b>FMR LLC</b>							
5,150 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2043	500	539	468				
<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>							
7,350 %, échéant le 6 mars 2030	200	208	215				
<b>Fortress Transportation &amp; Infrastructure Investors LLC</b>							
7,875 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2030	300	298	313				
<b>FS KKR Capital Corp.</b>							
7,875 %, échéant le 15 janv. 2029	500	497	530				

## Inventaire du portefeuille Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Georgia Power Co.</b>				<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>			
3,700 %, échéant le 30 janv. 2050	2 100 USD	2 203 USD	1 663 USD	2,083 %, échéant le 22 avr. 2026	600 USD	564 USD	575 USD
<b>Global Atlantic Fin Co.</b>				2,580 %, échéant le 22 avr. 2032	1 900	1 900	1 608
3,125 %, échéant le 15 juin 2031	700	699	574	4,565 %, échéant le 14 juin 2030	3 700	3 700	3 623
<b>Global Payments, Inc.</b>				6,070 %, échéant le 22 oct. 2027	1 000	1 000	1 029
2,900 %, échéant le 15 mai 2030	300	299	264	<b>JPMorgan Chase Bank NA</b>			
3,200 %, échéant le 15 août 2029	200	174	181	5,110 %, échéant le 8 déc. 2026	750	750	757
<b>GLP Capital LP</b>				<b>Kentucky Utilities Co.</b>			
4,000 %, échéant le 15 janv. 2031	100	104	90	5,450 %, échéant le 15 avr. 2033	400	399	416
5,250 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2025	900	919	897	<b>Kilroy Realty LP</b>			
5,375 %, échéant le 15 avr. 2026	300	300	298	4,750 %, échéant le 15 déc. 2028	200	176	191
5,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2028	200	203	202	<b>Kinder Morgan, Inc.</b>			
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>				5,200 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2033	2 200	2 193	2 188
3,691 %, échéant le 5 juin 2028	400	415	382	<b>KKR Group Finance Co. LLC</b>			
<b>Golub Capital BDC, Inc.</b>				3,625 %, échéant le 25 févr. 2050	500	497	360
7,050 %, échéant le 5 déc. 2028	500	495	525	<b>Las Vegas Sands Corp.</b>			
<b>Goodman U.S. Finance Three LLC</b>				3,500 %, échéant le 18 août 2026	2 200	2 203	2 098
3,700 %, échéant le 15 mars 2028	1 500	1 494	1 398	<b>Lazard Group LLC</b>			
<b>Guardian Life Insurance Co. of America</b>				3,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2027	1 600	1 593	1 515
3,700 %, échéant le 22 janv. 2070	800	777	548	<b>Lockheed Martin Corp.</b>			
<b>Haleon U.S. Capital LLC</b>				5,200 %, échéant le 15 févr. 2055	1 000	990	1 051
3,375 %, échéant le 24 mars 2029	500	496	473	<b>Marriott International, Inc.</b>			
<b>Hanover Insurance Group, Inc.</b>				2,750 %, échéant le 15 oct. 2033	600	599	495
2,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> sept. 2030	200	200	164	4,900 %, échéant le 15 avr. 2029	300	296	302
<b>HAT Holdings LLC</b>				<b>Massachusetts Institute of Technology</b>			
8,000 %, échéant le 15 juin 2027	400	400	417	3,885 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juill. 2116	1 500	1 514	1 180
<b>HCA, Inc.</b>				<b>Massachusetts Mutual Life Insurance Co.</b>			
5,250 %, échéant le 15 juin 2049	800	881	745	3,729 %, échéant le 15 oct. 2070	195	188	134
<b>Healthcare Realty Holdings LP</b>				<b>MDC Holdings, Inc.</b>			
2,000 %, échéant le 15 mars 2031	300	298	240	3,966 %, échéant le 6 août 2061	500	500	326
<b>Hess Corp.</b>				<b>Microsoft Corp.</b>			
7,300 %, échéant le 15 août 2031	900	1 048	1 038	4,500 %, échéant le 15 juin 2047	200	173	196
<b>Host Hotels &amp; Resorts LP</b>				<b>MidAmerican Energy Co.</b>			
3,500 %, échéant le 15 sept. 2030	1 400	1 388	1 250	4,250 %, échéant le 15 juill. 2049	600	553	524
4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2026	100	100	98	<b>Midwest Connector Capital Co. LLC</b>			
<b>Howard Midstream Energy Partners LLC</b>				3,900 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2024	600	610	597
8,875 %, échéant le 15 juill. 2028	200	200	210	<b>Morgan Stanley</b>			
<b>Hudson Pacific Properties LP</b>				1,794 %, échéant le 13 févr. 2032	3 200	3 200	2 557
4,650 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2029	100	74	81	2,475 %, échéant le 21 janv. 2028	1 500	1 500	1 393
5,950 %, échéant le 15 févr. 2028	200	166	177	5,123 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2029	400	400	402
<b>Humana, Inc.</b>				5,250 %, échéant le 21 avr. 2034	500	500	500
2,150 %, échéant le 3 févr. 2032	700	699	576	<b>MPLX LP</b>			
5,875 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2033	200	199	213	5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2033	2 000	1 972	1 960
<b>Hyundai Capital America</b>				<b>MSCI, Inc.</b>			
5,500 %, échéant le 30 mars 2026	400	399	402	3,250 %, échéant le 15 août 2033	100	80	84
<b>IHG Finance LLC</b>				<b>Mutual of Omaha Cos. Global Funding</b>			
4,375 %, échéant le 28 nov. 2029	400 EUR	436	458	5,450 %, échéant le 12 déc. 2028	400	400	409
<b>Illumina, Inc.</b>				<b>Neuberger Berman Group LLC</b>			
5,750 %, échéant le 13 déc. 2027	900 USD	899	924	4,875 %, échéant le 15 avr. 2045	1 640	1 404	1 360
<b>Invitation Homes Operating Partnership LP</b>				<b>Nevada Power Co.</b>			
4,150 %, échéant le 15 avr. 2032	100	89	92	6,000 %, échéant le 15 mars 2054	797	809	876
5,450 %, échéant le 15 août 2030	300	297	303	<b>Newmont Corp.</b>			
<b>Jabil, Inc.</b>				5,750 %, échéant le 15 nov. 2041	100	131	104
5,450 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2029	200	199	204	<b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b>			
<b>Jefferies Financial Group, Inc.</b>				4,800 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2077	800	800	694
5,875 %, échéant le 21 juill. 2028	475	472	487	<b>NextEra Energy Operating Partners LP</b>			
<b>JetBlue Pass-Through Trust</b>				7,250 %, échéant le 15 janv. 2029	200	200	210
4,000 %, échéant le 15 mai 2034	1 688	1 688	1 549	<b>NGPL PipeCo LLC</b>			
				4,875 %, échéant le 15 août 2027	300	331	295

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Norfolk Southern Corp.</b>							
5,350 %, échéant le 1 <sup>er</sup> août 2054	400 USD	398 USD	416 USD				
5,950 %, échéant le 15 mars 2064	200	199	223				
<b>NVR, Inc.</b>							
3,000 %, échéant le 15 mai 2030	1 700	1 817	1 516				
<b>Occidental Petroleum Corp.</b>							
8,875 %, échéant le 15 juill. 2030	1 400	1 612	1 640				
<b>Oglethorpe Power Corp.</b>							
4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2047	1 000	802	849				
<b>OneMain Finance Corp.</b>							
7,875 %, échéant le 15 mars 2030	400	398	412				
<b>ONEOK Partners LP</b>							
6,125 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2041	100	113	105				
6,200 %, échéant le 15 sept. 2043	100	118	105				
<b>ONEOK, Inc.</b>							
6,100 %, échéant le 15 nov. 2032	600	600	638				
6,350 %, échéant le 15 janv. 2031	300	299	321				
<b>Oracle Corp.</b>							
2,875 %, échéant le 25 mars 2031	3 000	2 995	2 659				
3,600 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2050	500	548	371				
4,650 %, échéant le 6 mai 2030	1 600	1 577	1 595				
<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>							
2,950 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2026	700	723	663				
3,000 %, échéant le 15 juin 2028	1 200	1 194	1 095				
3,300 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2027	1 400	1 396	1 308				
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> août 2050	600	596	416				
4,550 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juill. 2030	700	779	667				
<b>Pacific Life Insurance Co.</b>							
4,300 %, échéant le 24 oct. 2067	2 800	2 798	2 226				
<b>PacifiCorp</b>							
5,350 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2053	1 400	1 400	1 349				
<b>Pennsylvania Electric Co.</b>							
4,150 %, échéant le 15 avr. 2025	300	331	294				
<b>Philip Morris International, Inc.</b>							
5,375 %, échéant le 15 févr. 2033	200	198	205				
5,750 %, échéant le 17 nov. 2032	200	200	210				
<b>Piedmont Natural Gas Co., Inc.</b>							
3,350 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2050	600	598	417				
<b>Protective Life Global Funding</b>							
1,737 %, échéant le 21 sept. 2030	1 400	1 399	1 135				
<b>Provident Funding Associates LP</b>							
6,375 %, échéant le 15 juin 2025	100	100	92				
<b>Puget Energy, Inc.</b>							
4,100 %, échéant le 15 juin 2030	300	299	275				
<b>Quanta Services, Inc.</b>							
2,900 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2030	300	299	263				
<b>Regency Centers LP</b>							
3,700 %, échéant le 15 juin 2030	400	399	372				
<b>Revvity, Inc.</b>							
3,300 %, échéant le 15 sept. 2029	400	362	363				
<b>Rexford Industrial Realty LP</b>							
5,000 %, échéant le 15 juin 2028	400	396	400				
<b>RTX Corp.</b>							
5,375 %, échéant le 27 févr. 2053	600	609	610				
6,100 %, échéant le 15 mars 2034	1 000	998	1 086				
<b>Sabine Pass Liquefaction LLC</b>							
4,500 %, échéant le 15 mai 2030	300	299	293				
<b>Sabra Health Care LP</b>							
3,900 %, échéant le 15 oct. 2029	700	689	631				
<b>San Diego Gas &amp; Electric Co.</b>							
5,350 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2053	1 425	1 410	1 445				
<b>Santander Holdings USA, Inc.</b>							
2,490 %, échéant le 6 janv. 2028	400 USD	400 USD	367 USD				
6,499 %, échéant le 9 mars 2029	2 400	2 400	2 482				
<b>SCE Recovery Funding LLC</b>							
5,112 %, échéant le 14 déc. 2049	100	100	99				
<b>Southern California Edison Co.</b>							
3,650 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2050	1 100	1 175	853				
4,700 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2027	1 400	1 397	1 409				
5,300 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2028	200	200	205				
5,950 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2032	600	596	645				
<b>Southern California Gas Co.</b>							
5,200 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2033	900	898	926				
<b>Southern Co. Gas Capital Corp.</b>							
4,400 %, échéant le 30 mai 2047	1 132	1 276	964				
<b>Southwest Gas Corp.</b>							
5,450 %, échéant le 23 mars 2028	1 000	999	1 023				
<b>Southwestern Electric Power Co.</b>							
6,200 %, échéant le 15 mars 2040	300	374	320				
<b>Spirit AeroSystems, Inc.</b>							
4,600 %, échéant le 15 juin 2028	1 000	998	886				
<b>Spirit Airlines Pass-Through Trust</b>							
4,100 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2029	845	853	777				
<b>Spirit Realty LP</b>							
4,450 %, échéant le 15 sept. 2026	400	391	393				
<b>Stryker Corp.</b>							
4,850 %, échéant le 8 déc. 2028	500	500	506				
<b>Synchrony Bank</b>							
5,625 %, échéant le 23 août 2027	500	500	492				
<b>System Energy Resources, Inc.</b>							
6,000 %, échéant le 15 avr. 2028	700	686	716				
<b>T-Mobile USA, Inc.</b>							
2,250 %, échéant le 15 nov. 2031	300	300	250				
2,550 %, échéant le 15 févr. 2031	2 100	2 191	1 810				
3,750 %, échéant le 15 avr. 2027	1 000	1 108	970				
3,875 %, échéant le 15 avr. 2030	300	332	285				
5,050 %, échéant le 15 juill. 2033	300	301	302				
5,750 %, échéant le 15 janv. 2054	600	598	635				
<b>Take-Two Interactive Software, Inc.</b>							
4,000 %, échéant le 14 avr. 2032	200	200	190				
<b>Tapestry, Inc.</b>							
7,700 %, échéant le 27 nov. 2030	300	313	316				
<b>Targa Resources Corp.</b>							
6,125 %, échéant le 15 mars 2033	1 000	999	1 053				
6,500 %, échéant le 15 févr. 2053	400	391	433				
<b>Trimble, Inc.</b>							
6,100 %, échéant le 15 mars 2033	100	100	107				
<b>U.S. Bancorp</b>							
6,787 %, échéant le 26 oct. 2027	800	800	836				
<b>U.S. Foods, Inc.</b>							
4,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2030	500	500	466				
<b>United Airlines, fiducie à flux identiques</b>							
2,875 %, échéant le 7 avr. 2030	138	140	123				
3,700 %, échéant le 1 <sup>er</sup> sept. 2031	1 519	1 519	1 331				
4,000 %, échéant le 11 oct. 2027	161	158	153				
5,800 %, échéant le 15 janv. 2036	200	200	204				
<b>UnitedHealth Group, Inc.</b>							
5,200 %, échéant le 15 avr. 2063	3 100	3 120	3 168				
<b>Venture Global Calcasieu Pass LLC</b>							
3,875 %, échéant le 15 août 2029	600	600	545				
3,875 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2033	1 500	1 500	1 273				

## Inventaire du portefeuille Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Venture Global LNG, Inc.</b>						
8,125 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2028	600 USD	600 USD	606 USD			
9,875 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2032	600	616	625			
<b>Verizon Communications, Inc.</b>						
3,875 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2052	1 200	949	973			
5,050 %, échéant le 9 mai 2033	100	100	102			
<b>VICI Properties LP</b>						
4,500 %, échéant le 15 janv. 2028	300	297	286			
4,625 %, échéant le 15 juin 2025	200	200	197			
5,125 %, échéant le 15 mai 2032	500	499	488			
<b>Vistra Operations Co. LLC</b>						
6,950 %, échéant le 15 oct. 2033	300	304	316			
<b>VMware, Inc.</b>						
3,900 %, échéant le 21 août 2027	1 600	1 600	1 553			
<b>Warnermedia Holdings, Inc.</b>						
5,050 %, échéant le 15 mars 2042	650	650	573			
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b>						
2,188 %, échéant le 30 avr. 2026	600	566	575			
2,393 %, échéant le 2 juin 2028	100	90	92			
4,808 %, échéant le 25 juill. 2028	900	850	894			
5,389 %, échéant le 24 avr. 2034	4 200	4 200	4 221			
5,574 %, échéant le 25 juill. 2029	1 500	1 500	1 532			
<b>Western Midstream Operating LP</b>						
6,150 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2033	1 300	1 307	1 352			
<b>Westinghouse Air Brake Technologies Corp.</b>						
4,700 %, échéant le 15 sept. 2028	400	400	396			
<b>Weyerhaeuser Co.</b>						
6,875 %, échéant le 15 déc. 2033	100	129	110			
7,375 %, échéant le 15 mars 2032	57	79	66			
<b>Williams Cos., Inc.</b>						
5,650 %, échéant le 15 mars 2033	2 000	2 031	2 091			
<b>Zoetis, Inc.</b>						
2,000 %, échéant le 15 mai 2030	1 000	785	862			
		<u>214 498</u>	<u>202 063</u>			
<b>PRÊTS AVEC PARTICIPATION ET CESSION 0,1 %</b>						
<b>Charter Communications Operating LLC</b> % à déterminer, échéant le 7 déc. 2030	400	398	399			
<b>Diamond Sports Group LLC</b> % à déterminer - 15,420 %, échéant le 25 mai 2026	106	98	81			
		<u>496</u>	<u>480</u>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 2,1 %</b>						
<b>American Home Mortgage Assets Trust</b>						
5,680 %, échéant le 25 oct. 2046	145	97	77			
<b>Angel Oak Mortgage Trust</b>						
4,800 %, échéant le 25 nov. 2067	1 000	959	973			
<b>AOA Mortgage Trust</b>						
6,351 %, échéant le 15 oct. 2038	700	652	634			
<b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>						
5,224 %, échéant le 25 nov. 2034	1	1	1			
<b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>						
5,790 %, échéant le 25 janv. 2047	87	67	71			
<b>BX Commercial Mortgage Trust</b>						
6,176 %, échéant le 15 avr. 2034	900	859	865			
<b>BX Trust</b>						
6,111 %, échéant le 15 avr. 2039	665	614	646			
6,376 %, échéant le 15 oct. 2036	1 000	955	979			
<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>						
6,277 %, échéant le 25 sept. 2035	1	1	1			
<b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>						
6,112 %, échéant le 20 nov. 2035	1 306 USD	1 114 USD	1 111 USD			
<b>Credit Suisse Mortgage Capital Trust</b>						
3,599 %, échéant le 27 mai 2037	928	572	632			
<b>MAD Mortgage Trust</b>						
3,188 %, échéant le 15 août 2034	525	496	472			
<b>NYO Commercial Mortgage Trust</b>						
6,571 %, échéant le 15 nov. 2038	900	821	833			
<b>PRPM Trust</b>						
6,221 %, échéant le 25 nov. 2068	500	500	502			
<b>Residential Asset Securitization Trust</b>						
6,000 %, échéant le 25 août 2036	526	431	253			
<b>Fiducie de placements en actifs hypothécaires structurés</b>						
5,910 %, échéant le 25 mai 2046	146	84	51			
<b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>						
5,080 %, échéant le 25 oct. 2046	34	31	31			
		<u>8 254</u>	<u>8 132</u>			
				ACTIONS		
<b>TITRES PRIVILÉGIÉS 0,8 %</b>						
<b>CoBank ACB</b>						
6,250 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2026 <sup>g)</sup>	1 000 000	1 000	975			
<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>						
5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> août 2024 <sup>g)</sup>	2 000 000	2 052	1 973			
		<u>3 052</u>	<u>2 948</u>			
				VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)		
<b>ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX AMÉRICAINS 7,7 %</b>						
<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme</b>						
2,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2052	182 USD	180	149			
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2052 - 1 <sup>er</sup> juill. 2053	3 437	3 197	3 155			
4,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2052 - 1 <sup>er</sup> juill. 2053	13 295	12 772	12 579			
4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2052 - 1 <sup>er</sup> juin 2053	3 220	3 138	3 123			
5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2053 - 1 <sup>er</sup> juill. 2053	2 183	2 135	2 161			
<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, à déterminer</b>						
6,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	8 000	8 105	8 123			
		<u>29 527</u>	<u>29 290</u>			
<b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR DES ÉTATS-UNIS 10,4 %</b>						
<b>Obligations du Trésor des États-Unis</b>						
2,500 %, échéant le 15 mai 2046	10 500	7 436	7 867			
2,750 %, échéant le 15 août 2047	10 800	7 701	8 414			
3,000 %, échéant le 15 mai 2047	4 500	3 419	3 677			
<b>Titres du Trésor des É.-U. indexés sur l'inflation<sup>h)</sup></b>						
0,250 %, échéant le 15 janv. 2025	649	627	631			
0,750 %, échéant le 15 févr. 2045	5 016	4 176	3 926			
2,375 %, échéant le 15 janv. 2025	653	645	648			
<b>Obligations du Trésor des États-Unis</b>						
2,750 %, échéant le 15 août 2032	4 200	3 708	3 847			
<b>Obligations à coupons détachés du Trésor des É.-U.</b>						
0,000 %, échéant le 15 févr. 2042 <sup>i)</sup>	6 400	2 510	2 897			
0,000 %, échéant le 15 mai 2046 <sup>h)</sup>	19 700	7 379	7 671			
		<u>37 601</u>	<u>39 578</u>			

ACTIONS	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>BONS DE SOUSCRIPTION 0,0 %</b>		
Guaranteed Rate, Inc., échéant le 31 déc. 2060	120	0 USD
Total - États-Unis	297 886	286 579
	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	
<b>ÎLES VIERGES (BRITANNIQUES) 0,0 %</b>		
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,0 %</b>		
Champion Path Holdings Ltd. 4,850 %, échéant le 27 janv. 2028	200 USD	172
Total - Îles Vierges (britanniques)	201	172
<b>INSTRUMENTS À COURT TERME 5,2 %</b>		
<b>PRISES EN PENSION<sup>i)</sup> 5,2 %</b>		
	19 600	19 600

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>BONS DU TRÉSOR DU CANADA 0,0 %</b>			
5,085 %, échéant le 15 févr. 2024 <sup>d), e)</sup>	36 \$	26 USD	27 USD
Total - Placements à court terme		19 626	19 627
Total - Placements dans des titres		398 587	380 619
<b>Total - Placements 100,1 %</b>		<b>398 587 USD</b>	<b>380 619 USD</b>
Instruments financiers dérivés <sup>i), k)</sup> 2,3 %		(38)	8 588
Passifs, moins les autres actifs (2,4) %			(8 997)
<b>Total de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables 100,0 %</b>			<b>380 210 USD</b>

**NOTES À L'INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE :**

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

^ Titre en défaillance.

a) Coupon détaché.

b) Titre à rendement réinvesti.

c) Titre n'ayant produit aucun revenu au cours des douze derniers mois.

d) Titre à coupon zéro.

e) Coupon représentant un rendement à l'échéance.

f) Le montant du capital du titre est indexé selon l'inflation.

g) Titre perpétuel; la date indiquée, le cas échéant, est la prochaine date de remboursement anticipé.

h) Titre convertible conditionnel.

**EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT****i) PRISES EN PENSION :**

Contrepartie	Taux de financement	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du capital	Garanti par	Garanties (reçues)	Prises en pension, à la valeur	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>
TDM	5,450 %	29 déc. 2023	2 janv. 2024	19 600 USD	Obligations du Trésor des États-Unis, 1,250 %, échéant le 31 mai 2028	(20 029) USD	19 600 USD	19 612 USD
<b>Total - Prises en pension de titres</b>						<b>(20 029) USD</b>	<b>19 600 USD</b>	<b>19 612 USD</b>

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

Le solde moyen des emprunts pendant la période close le 31 décembre 2023 était de (700) \$ à un taux d'intérêt pondéré moyen de 5,403 %. Les emprunts peuvent comprendre des mises en pension et des accords cadres sur transactions à livrer.

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et des autres opérations de financement et des garanties données/(reçues).

**j) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE****CONTRATS À TERME :**

Description	Type	Mois de l'échéance	Nombre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	Marge de variation Actif	Marge de variation Passif
Contrats à terme Ultra sur obligations à long terme du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position longue	Mars 2024	30	134 USD	0 USD	(3) USD
<b>Total des contrats à terme</b>				<b>134 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(3) USD</b>

## Inventaire du portefeuille Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada) (suite)

### SWAPS :

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Plus-value/ (moins-value) latente		Marge de variation	
					Juste valeur	Actif	Passif	
À recevoir	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	4,500 %	20 mars 2034	900 GBP	(92) USD	(120) USD	10 USD	0 USD
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,854	29 déc. 2033	300 USD	(9)	(10)	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,750	2 janv. 2034	200	(4)	(5)	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,810	2 janv. 2034	200	(5)	(6)	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,684	3 janv. 2034	100	(2)	(2)	0	(2)
À recevoir	EURIBOR en EUR à 3 mois	2,920	13 déc. 2028	400 EUR	(9)	(10)	2	0
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	4,500	20 sept. 2033	3 000 AUD	95	55	2	0
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	4,500	20 mars 2034	4 000	91	71	3	0
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,255	22 nov. 2028	100 EUR	(4)	(4)	0	0
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,179	29 nov. 2028	200	(7)	(7)	1	0
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	0,175	17 mars 2033	5 950	(1 238)	(1 432)	0	(53)
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	0,000	17 mars 2053	1 710	749	920	33	0
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	2,750	20 mars 2054	3 800	(434)	(395)	107	0
<b>Total des swaps</b>					<b>(869) USD</b>	<b>(945) USD</b>	<b>158 USD</b>	<b>(55) USD</b>

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée.

### k) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE

#### CONTRATS DE CHANGE À TERME :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
AZD	Janv. 2024	611 USD	923 AUD	18 USD	0 USD
BOA	Janv. 2024	611	923	19	0
	Janv. 2024	501	5 326 NOK	23	0
	Févr. 2024	350	1 721 BRL	4	0
	Mars 2024	127	10 641 INR	0	0
	Janv. 2024	635 AUD	420 USD	0	(13)
BPS	Janv. 2024	495 \$	365	0	(9)
	Janv. 2024	729 DKK	108	0	0
	Janv. 2024	183 EUR	198	0	(4)
	Janv. 2024	200 GBP	253	0	(1)
	Mars 2024	1 038 019 IDR	65	0	(2)
	Mars 2024	56 USD	858 989 IDR	0	0
	Mars 2024	442	36 960 INR	1	0
	Janv. 2024	967 DKK	142 USD	0	(1)
	Févr. 2024	44 USD	1 348 TRY	0	0
	Mars 2024	0	11 THB	0	0
BRC	Mars 2024	140	4 437 TRY	0	(1)
	Avril 2024	298	9 612	0	(4)
	Janv. 2024	101 \$	76 USD	0	0
	Janv. 2024	6 388 MXN	355	0	(20)
CBK	Janv. 2024	144 USD	190 \$	0	0
	Janv. 2024	120	1 288 NOK	6	0
	Janv. 2024	10 083 ZAR	530 USD	0	(21)
	Févr. 2024	390 USD	1 999 BRL	21	0
	Mars 2024	1 623 PEN	431 USD	0	(7)
	Janv. 2024	2 121 \$	1 565	0	(36)
	Janv. 2024	18 530 MXN	1 062	0	(25)
	Janv. 2024	6 213 ZAR	327	0	(12)
	Févr. 2024	3 BRL	1	0	0
	Mars 2024	99 USD	1 517 929 IDR	0	0
JPM	Mars 2024	75	2 350 TRY	0	(1)
	Mars 2024	36	560 745 IDR	0	0
	Mars 2024	133	11 078 INR	0	0
MBC	Janv. 2024	1 130 \$	835 USD	0	(18)
	Janv. 2024	21 GBP	27	0	0
	Mars 2024	44 USD	683 011 IDR	0	0
MYI	Janv. 2024	4 158 EUR	4 570 USD	0	(21)
	Janv. 2024	540 USD	722 \$	5	0
	Janv. 2024	4 266 ZAR	222 USD	0	(11)
	Mars 2024	803 USD	12 349 300 IDR	0	(1)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
RBC	Févr. 2024	332 BRL	65 USD	0 USD	(3) USD
	Avril 2024	6 MXN	0	0	0
SCX	Janv. 2024	945 GBP	1 196	0	(9)
	Janv. 2024	5 490 MXN	317	0	(5)
	Mars 2024	49 USD	751 719 IDR	0	0
	Mars 2024	288	24 118 INR	1	0
	Mars 2024	761	26 292 THB	15	0
				113 USD	(225) USD

#### CONTRATS DE CHANGE À TERME EN COURS, EN CAD, SÉRIE COUVERTE<sup>†</sup> :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
BOA	Janv. 2024	6	9 \$	0 USD	0 USD
BPS	Janv. 2024	929 \$	685 USD	0	(16)
	Janv. 2024	478 USD	650 \$	12	0
BRC	Janv. 2024	110 738	150 588	2 922	0
CBK	Janv. 2024	4 356 \$	3 250 USD	5	(42)
	Janv. 2024	1 530 USD	2 047 \$	15	0
GLM	Janv. 2024	1 113 \$	838 USD	0	(2)
	Janv. 2024	109 222 USD	148 427 \$	2 808	0
MBC	Janv. 2024	1 492 \$	1 106 USD	0	(21)
	Janv. 2024	27 338 USD	36 997 \$	586	0
MYI	Janv. 2024	109 951 USD	148 824 \$	2 376 USD	0 USD
				8 724 USD	(81) USD
				<b>8 837 USD</b>	<b>(306) USD</b>

#### Total des contrats de change à terme

**8 837 USD (306) USD**

<sup>†</sup> Le Fonds offre des séries en CAD, couvertes, et utilise des techniques et des instruments pour réduire l'exposition au dollar américain, en totalité ou en partie. Il est impossible de garantir que les séries CAD, couvertes, seront couvertes en tout temps ni que la technique de couverture sera efficace.

#### OPTIONS VENDUES :

#### OPTIONS SUR SWAP DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Valeur notionnelle <sup>1)</sup>	Primes (reçues)	Juste valeur
BOA	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,288 %	19 janv. 2024	100	0 USD	0 USD
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,738	19 janv. 2024	100	0	0
BPS	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,494	8 janv. 2024	200	(1)	(2)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,994	8 janv. 2024	200	(1)	0
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,545	16 janv. 2024	300	(1)	(4)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,995	16 janv. 2024	300	(1)	0
CBK	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,235	22 janv. 2024	300	(1)	(1)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,685	22 janv. 2024	300	(1)	(1)
GLM	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,648	4 janv. 2024	300	(1)	(5)
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,560	5 janv. 2024	300	(2)	(3)
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,594	5 janv. 2024	300	(2)	(4)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,010	5 janv. 2024	300	(2)	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,044	5 janv. 2024	300	(2)	0
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,300	16 janv. 2024	300	(1)	(1)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,750	16 janv. 2024	300	(1)	0
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,285	19 janv. 2024	200	(1)	(1)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,735	19 janv. 2024	200	(1)	0
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,215	22 janv. 2024	300	(1)	(1)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,665	22 janv. 2024	300	(1)	(1)
JPM	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,600	12 janv. 2024	200	(1)	(3)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,050	12 janv. 2024	200	(1)	0
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,350	18 janv. 2024	200	(1)	(1)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,750	18 janv. 2024	200	(1)	0
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,205	22 janv. 2024	200	(1)	(1)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,655	22 janv. 2024	200	(1)	(1)
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,170	29 janv. 2024	200	(1)	(1)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,620	29 janv. 2024	200	(1)	(1)
MYC	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,670	4 janv. 2024	300	(1)	(5)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,120	4 janv. 2024	300	(1)	0

## Inventaire du portefeuille Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada) (suite)

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Valeur notionnelle <sup>1)</sup>	Primes (reçues)	Juste valeur
MYC	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,455 %	8 janv. 2024	300	(2) USD	(2) USD
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,475	8 janv. 2024	200	(1)	(1)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,955	8 janv. 2024	300	(1)	0
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	3,975	8 janv. 2024	200	(1)	0
	Achat - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À recevoir	3,600	12 janv. 2024	200	(1)	(3)
	Vente - swap de taux d'intérêt hors cote, 10 ans	LIBOR en USD à 3 mois	À payer	4,050	12 janv. 2024	200	(1)	0
<b>Total - options vendues</b>							<b>(38) USD</b>	<b>(43) USD</b>

<sup>1)</sup> La valeur notionnelle représente le nombre de contrats.

**Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues).**

(en milliers\*)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

**SOMMAIRE DES EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA) TDM	19 612 USD	0 USD	0 USD	19 612 USD	(20 029) USD	(417) USD
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement <sup>3)</sup></b>	<b>19 612 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA) TOR	24 412 USD	0 USD	0 USD	24 412 USD	(25 110) USD	(698) USD
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement <sup>3)</sup></b>	<b>24 412 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>			

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

<sup>2)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux emprunts et autres opérations de financement ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords cadres ».

<sup>3)</sup> Les emprunts se sont établis entre 0 USD et 16 306 USD pour la période close le 31 décembre 2023 (entre 0 USD et 14 497 USD pour la période close le 31 décembre 2022).

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE - SOMMAIRE**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2023 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
<b>Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>158 USD</b>	<b>158 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(3) USD</b>	<b>(55) USD</b>	<b>(58) USD</b>

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2022 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
<b>Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée</b>	<b>0 USD</b>	<b>2 USD</b>	<b>71 USD</b>	<b>73 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(9) USD</b>	<b>(15) USD</b>	<b>(24) USD</b>

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE - SOMMAIRE**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	18 USD	0 USD	0 USD	18 USD	0 USD	0 USD	0 USD	0 USD	18 USD	0 USD	18 USD
BOA	46	0	0	46	0	0	0	0	46	0	46
BPS	13	0	0	13	(45)	(6)	0	(51)	(38)	0	(38)
BRC	2 922	0	0	2 922	(6)	0	0	(6)	2 916	(3 410)	(494)
CBK	47	0	0	47	(90)	(2)	0	(92)	(45)	0	(45)
GLM	2 808	0	0	2 808	(76)	(16)	0	(92)	2 716	(3 128)	(412)
JPM	0	0	0	0	0	(8)	0	(8)	(8)	0	(8)
MBC	586	0	0	586	(39)	0	0	(39)	547	(649)	(102)
MYC	0	0	0	0	0	(11)	0	(11)	(11)	0	(11)
MYI	2 381	0	0	2 381	(33)	0	0	(33)	2 348	(2 650)	(302)
RBC	0	0	0	0	(3)	0	0	(3)	(3)	0	(3)
SCX	16	0	0	16	(14)	0	0	(14)	2	0	2
<b>Total - Hors cote</b>	<b>8 837 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>8 837 USD</b>	<b>(306) USD</b>	<b>(43) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(349) USD</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	9 USD	0 USD	0 USD	9 USD	0 USD	0 USD	0 USD	0 USD	9 USD	0 USD	9 USD
BOA	14	1 467	0	1 481	(182)	(2 578)	0	(2 760)	(1 279)	1 552	273
BOM	0	0	0	0	(409)	0	0	(409)	(409)	0	(409)
BPS	15	690	0	705	(8)	(1 189)	0	(1 197)	(492)	580	88
CBK	56	0	0	56	(51)	0	0	(51)	5	0	5
GLM	29	0	0	29	(24)	(96)	0	(120)	(91)	0	(91)
JPM	3	456	0	459	(93)	(800)	0	(893)	(434)	281	(153)
MBC	35	0	0	35	(298)	0	0	(298)	(263)	0	(263)
MYC	0	0	0	0	0	(12)	0	(12)	(12)	0	(12)
MYI	1	0	0	1	0	0	0	0	1	0	1
RBC	24	0	0	24	(38)	0	0	(38)	(14)	0	(14)
SCX	19	0	0	19	(242)	0	0	(242)	(223)	182	(41)
<b>Total - Hors cote</b>	<b>205 USD</b>	<b>2 613 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>2 818 USD</b>	<b>(1 345) USD</b>	<b>(4 675) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(6 020) USD</b>			

<sup>1)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux instruments financiers dérivés hors cote ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

**ÉVALUATIONS DE LA JUSTE VALEUR**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2023 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Australie				
Obligations et billets de sociétés	0 USD	3 636 USD	0 USD	3 636 USD
Bermudes				
Titres adossés à des actifs	0	171	0	171
Obligations et billets de sociétés	0	187	0	187
Brésil				
Obligations et billets de sociétés	0	573	0	573
Canada				
Obligations et billets de sociétés	0	10 380	0	10 380
Îles Caimans				
Titres adossés à des actifs	0	6 158	0	6 158
Obligations et billets convertibles	0	1	0	1

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
Obligations et billets de sociétés	0 USD	5 888 USD	0 USD	5 888 USD
Chili				
Émissions souveraines	0	495	0	495
Chine				
Obligations et billets de sociétés	0	796	0	796
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0	238	0	238
France				
Obligations et billets de sociétés	0	699	0	699
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	2 018	0	2 018
Inde				
Obligations et billets de sociétés	0	758	0	758
Irlande				
Obligations et billets de sociétés	0	579	0	579
Prêts avec participation et cession	0	703	0	703
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0	525	0	525
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	6 582	0	6 582
Jersey, îles Anglo-Normandes				
Titres adossés à des actifs	0	800	0	800
Luxembourg				
Obligations et billets de sociétés	0	540	0	540
Mexique				
Obligations et billets de sociétés	0	537	0	537
Émissions souveraines	0	1 810	0	1 810
Multinational				
Obligations et billets de sociétés	0	98	0	98
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	3 204	0	3 204
Panama				
Obligations et billets de sociétés	0	120	0	120
Pérou				
Obligations et billets de sociétés	0	446	0	446
Porto Rico				
Obligations et billets de sociétés	0	515	0	515
Roumanie				
Émissions souveraines	0	286	0	286
Arabie saoudite				
Émissions souveraines	0	1 416	0	1 416
Afrique du Sud				
Obligations et billets de sociétés	0	174	0	174
Émissions souveraines	0	1 115	0	1 115
Espagne				
Obligations et billets de sociétés	0	543	0	543
Suisse				
Obligations et billets de sociétés	0	3 954	0	3 954
Émirats arabes unis				
Obligations et billets de sociétés	0	963	0	963
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	16 989	0	16 989
Titres privilégiés	0	344	0	344
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	4 070	0	4 070
Actions ordinaires	0	0	18	18
Obligations et billets de sociétés	0	202 063	0	202 063
Prêts avec participation et cession	0	480	0	480
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	8 130	2	8 132
Titres privilégiés	0	2 948	0	2 948
Organismes gouvernementaux américains	0	29 290	0	29 290
Obligations du Trésor américain	0	39 578	0	39 578
Îles Vierges britanniques				
Obligations et billets de sociétés	0	172	0	172
Instruments à court terme				
Prises en pension	0	19 600	0	19 600
Bons du Trésor du Canada	0	27	0	27
Total - Placements	0 USD	380 599 USD	20 USD	380 619 USD

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0 USD	158 USD	0 USD	158 USD
Hors cote	0	8 837	0	8 837
	0 USD	8 995 USD	0 USD	8 995 USD
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	(58)	0	(58)
Hors cote	0	(349)	0	(349)
	0 USD	(407) USD	0 USD	(407) USD
Total - Instruments financiers dérivés	0 USD	8 588 USD	0 USD	8 588 USD
Totaux	0 USD	389 187 USD	20 USD	389 207 USD

**Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2022 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :**

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Australie				
Obligations et billets de sociétés	0 USD	2 527 USD	0 USD	2 527 USD
Bermudes				
Titres adossés à des actifs	0	714	0	714
Obligations et billets de sociétés	0	1 259	0	1 259
Brésil				
Obligations et billets de sociétés	0	2 139	0	2 139
Canada				
Obligations et billets de sociétés	0	14 401	0	14 401
Îles Caïmans				
Titres adossés à des actifs	0	282	0	282
Obligations et billets de sociétés	0	8 792	0	8 792
Chili				
Émissions souveraines	0	465	0	465
Chine				
Obligations et billets de sociétés	0	760	0	760
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0	1 099	0	1 099
Finlande				
Prêts avec participation et cession	0	566	0	566
France				
Obligations et billets de sociétés	0	751	0	751
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	2 012	0	2 012
Inde				
Obligations et billets de sociétés	0	1 636	0	1 636
Irlande				
Obligations et billets de sociétés	0	4 433	0	4 433
Prêts avec participation et cession	0	698	0	698
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0	3 330	0	3 330
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	3 988	0	3 988
Luxembourg				
Obligations et billets de sociétés	0	1 349	0	1 349
Prêts avec participation et cession	0	353	0	353
Maurice				
Obligations et billets de sociétés	0	1 074	0	1 074
Mexique				
Obligations et billets de sociétés	0	1 446	0	1 446
Multinational				
Obligations et billets de sociétés	0	94	0	94
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	3 995	0	3 995
Pérou				
Obligations et billets de sociétés	0	418	0	418
Roumanie				
Émissions souveraines	0	240	0	240

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
Afrique du Sud				
Obligations et billets de sociétés	0 USD	174 USD	0 USD	174 USD
Émissions souveraines	0	2 540	0	2 540
Espagne				
Obligations et billets de sociétés	0	480	0	480
Suisse				
Obligations et billets de sociétés	0	4 891	0	4 891
Émirats arabes unis				
Obligations et billets de sociétés	0	951	0	951
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	18 832	0	18 832
Titres privilégiés	0	765	0	765
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	3 788	0	3 788
Actions ordinaires	0	0	18	18
Obligations et billets de sociétés	0	123 419	0	123 419
Prêts avec participation et cession	0	816	0	816
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	7 859	0	7 859
Titres privilégiés	0	7 478	0	7 478
Organismes gouvernementaux américains	0	15 387	0	15 387
Obligations du Trésor américain	0	73 082	0	73 082
Îles Vierges britanniques				
Obligations et billets de sociétés	0	169	0	169
Instruments à court terme				
Billets de trésorerie	0	10 073	0	10 073
Prises en pension	0	24 400	0	24 400
Billets à court terme	0	2 000	0	2 000
Bons du Trésor du Canada	0	400	0	400
Bons du Trésor de la Hongrie	0	920	0	920
Bons du Trésor des États-Unis	0	3 396	0	3 396
Total - Placements	0 USD	360 641 USD	18 USD	360 659 USD
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	2	71	0	73
Hors cote	0	2 818	0	2 818
	2 USD	2 889 USD	0 USD	2 891 USD
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(4)	(20)	0	(24)
Hors cote	0	(6 020)	0	(6 020)
	(4) USD	(6 040)USD	0 USD	(6 044)USD
Total - Instruments financiers dérivés	(2) USD	(3 151)USD	0 USD	(3 153)USD
Totaux	(2) USD	357 490 USD	18 USD	357 506 USD

Il n'y a eu aucun transfert significatif entre les niveaux 1, 2 ou 3 pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

## CONCENTRATION DU PORTEFEUILLE

Le portefeuille de placements du Fonds est concentré dans les segments suivants :

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Australie	1,0 %	0,7 %
Bermudes	0,1 %	0,6 %
Bésil	0,2 %	0,6 %
Canada	2,7 %	4,1 %
Îles Caïmans	3,2 %	2,6 %
Chili	0,1 %	0,1 %
Chine	0,2 %	0,2 %
Danemark	0,1 %	0,3 %
Finlande	0,0 %	0,2 %
France	0,2 %	0,2 %

## Notes annexes propres au Fonds Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada) (suite)

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Allemagne	0,5 %	0,6 %
Inde	0,2 %	0,5 %
Irlande	0,4 %	1,5 %
Italie	0,1 %	1,0 %
Japon	1,7 %	1,1 %
Jersey, îles Anglo-Normandes	0,2 %	0,0 %
Luxembourg	0,1 %	0,5 %
Maurice	0,0 %	0,3 %
Mexique	0,6 %	0,4 %
Multinational	0,0 %	0,0 %
Pays-Bas	0,8 %	1,1 %
Panama	0,0 %	0,0 %
Pérou	0,1 %	0,1 %
Porto Rico	0,1 %	0,0 %
Roumanie	0,1 %	0,1 %
Arabie saoudite	0,4 %	0,0 %
Afrique du Sud	0,4 %	0,8 %
Espagne	0,1 %	0,1 %
Suisse	1,0 %	1,4 %
Émirats arabes unis	0,3 %	0,3 %
Royaume-Uni	4,6 %	5,6 %
États-Unis	75,4 %	66,3 %
Îles Vierges britanniques	0,0 %	0,0 %
Instruments à court terme	5,2 %	11,8 %
Instruments financiers dérivés	2,3 %	(0,9) %
Passifs, moins les autres actifs	(2,4) %	(2,2) %
Total (% de l'actif net)	100,0 %	100,0 %

## RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

## RISQUE DE CHANGE

Les tableaux ci-dessous indiquent l'exposition globale au risque de change, sauf celui afférent à la monnaie fonctionnelle du Fonds.

Au 31 décembre 2023	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Peso argentin	19 USD	0 USD	19 USD	Peso argentin	58 USD	0 USD	58 USD
Dollar australien	64	825	889	Dollar australien	0	0	0
Réal brésilien	0	696	696	Réal brésilien	0	0	0
Livre sterling	1 190	(1 527)	(337)	Livre sterling	4 339	(4 634)	(295)
Dollar canadien	(38 573)	(2 590)	(41 163)	Dollar canadien	(31 110)	(5 802)	(36 912)
Peso chilien	(79)	0	(79)	Peso chilien	(79)	0	(79)
Yuan renminbi chinois (continental)	314	0	314	Yuan renminbi chinois (continental)	314	0	314
Peso colombien	0	0	0	Peso colombien	0	815	815
Couronne danoise	267	(251)	16	Couronne danoise	627	(569)	58
Euro	4 622	(4 793)	(171)	Euro	5 053	(5 705)	(652)
Forint hongrois	(97)	0	(97)	Forint hongrois	824	(921)	(97)
Roupie indienne	0	991	991	Roupie indienne	0	0	0
Roupie indonésienne	0	1 019	1 019	Roupie indonésienne	0	592	592
Yen japonais	272	0	272	Yen japonais	271	0	271
Peso mexicain	3 297	(1 783)	1 514	Peso mexicain	1 504	23	1 527
Couronne norvégienne	53	651	704	Couronne norvégienne	0	819	819
Nouveau sol péruvien	453	(438)	15	Nouveau sol péruvien	424	(425)	(1)
Zloty polonais	(51)	0	(51)	Zloty polonais	(51)	0	(51)
Rouble russe	0	0	0	Rouble russe	0	0	0
Rand sud-africain	1 363	(1 123)	240	Rand sud-africain	2 935	(2 369)	566
Baht thaïlandais	0	776	776	Baht thaïlandais	0	0	0
Nouvelle livre turque	0	551	551	Nouvelle livre turque	0	0	0
	(26 886) USD	(6 996) USD	(33 882) USD		(14 891) USD	(18 176) USD	(33 067) USD

Les tableaux ci-dessous résument le risque de change lié aux séries en CAD, couvertes, qui est compensé par des contrats de change à terme.

Au 31 décembre 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables en CAD, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en CAD, série couverte	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables en CAD, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en CAD, série couverte	Exposition nette
	362 327 USD	(362 171) USD	156 USD		329 744 USD	(329 251) USD	493 USD

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar américain avait progressé ou reculé de 5 % par rapport aux autres monnaies, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté d'environ (1 694) USD [(1 653) USD au 31 décembre 2022]. Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar américain avait progressé ou reculé de 5 % par rapport au dollar canadien, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables des séries couvertes aurait diminué ou augmenté d'environ 8 USD (25 USD au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

## Notes annexes propres au Fonds Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada) (suite)

### RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt. Ils incluent les instruments financiers du Fonds à la juste valeur, classés en fonction de la date d'échéance. Certains actifs ou passifs figurant dans l'état de la situation financière, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, ont été regroupés pour permettre la présentation ci-dessous.

<b>Actif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	19 627 USD	1 860 USD	74 124 USD	281 699 USD	3 309 USD	380 619 USD
Instruments financiers dérivés	8 836	0	3	156	0	8 995
Trésorerie et devises	0	0	0	0	1 357	1 357
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	967	967
Montants à recevoir	0	0	0	0	20 345	20 345
<b>Total - Actif</b>	<b>28 463 USD</b>	<b>1 860 USD</b>	<b>74 127 USD</b>	<b>281 855 USD</b>	<b>25 978 USD</b>	<b>412 283 USD</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	(302) USD	(4) USD	0 USD	(55) USD	(46) USD	(407) USD
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(6 722)	(6 722)
Montants à payer	0	0	0	0	(24 944)	(24 944)
<b>Total - Passif</b>	<b>(302) USD</b>	<b>(4) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(55) USD</b>	<b>(31 712) USD</b>	<b>(32 073) USD</b>

  

<b>Actif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	41 948 USD	10 635 USD	49 687 USD	250 128 USD	8 261 USD	360 659 USD
Instruments financiers dérivés	200	5	22	49	2 615	2 891
Trésorerie et devises	0	0	0	0	983	983
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	4 405	4 405
Montants à recevoir	0	0	0	0	34 830	34 830
<b>Total - Actif</b>	<b>42 148 USD</b>	<b>10 640 USD</b>	<b>49 709 USD</b>	<b>250 177 USD</b>	<b>51 094 USD</b>	<b>403 768 USD</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	(1 345) USD	0 USD	(13) USD	0 USD	(4 686) USD	(6 044) USD
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(606)	(606)
Montants à payer	0	0	0	0	(47 320)	(47 320)
<b>Total - Passif</b>	<b>(1 345) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(13) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(52 612) USD</b>	<b>(53 970) USD</b>

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si les taux d'intérêt en vigueur avaient progressé ou reculé de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 26 525 USD, ou 7,0 % (23 189 USD, ou 6,6 %, au 31 décembre 2022). La sensibilité du Fonds à la variation des taux d'intérêt a été estimée d'après la durée moyenne pondérée des instruments de créance. Dans les faits, les résultats des opérations peuvent différer et la différence peut être importante.

### AUTRE RISQUE DE PRIX

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'était pas exposé à l'autre risque de prix de façon importante, car il détenait surtout des titres de créance.

### RISQUE DE LIQUIDITÉ

Les tableaux ci-dessous font état des passifs du Fonds, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, par date de paiement contractuel : moins de trois mois, de trois mois à un an ou plus d'un an, selon le cas.

<b>Passif courant au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	348 USD	4 USD	55 USD	407 USD
Achats de placements à payer	24 208	0	0	24 208
Dépôts de contreparties	6 722	0	0	6 722
Montants à payer pour les parts rachetées	295	0	0	295
Distributions à payer	277	0	0	277
Frais de gestion à payer	164	0	0	164
<b>Total - Passif</b>	<b>32 014 USD</b>	<b>4 USD</b>	<b>55 USD</b>	<b>32 073 USD</b>

<b>Passif courant au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	6 044 USD	0 USD	0 USD	6 044 USD
Achats de placements à payer	45 454	0	0	45 454
Dépôts de contreparties	606	0	0	606
Montants à payer pour les parts rachetées	1 270	0	0	1 270
Distributions à payer	410	0	0	410
Frais de gestion à payer	186	0	0	186
<b>Total - Passif</b>	<b>53 970 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>53 970 USD</b>

## RISQUE DE CRÉDIT

Les tableaux ci-dessous résument la composition des notations des instruments financiers du Fonds.

	<b>Au 31 décembre 2023</b>	<b>Au 31 décembre 2022</b>
Catégorie investissement	95 %	91 %
Inférieur à la catégorie investissement	5 %	9 %
Sans notation	0 %	0 %
Total (% des placements et des instruments financiers dérivés)	100 %	100 %

Les notations sont fournies par Standard & Poor's Ratings Services (S&P), Moody's Investors Services, Inc. (Moody's), Fitch Ratings, Inc. (Fitch) ou DBRS Limited (DBRS). Lorsqu'il existe plus d'une notation pour un titre, la plus élevée a été retenue. Si la notation d'un instrument n'est pas fournie par l'une de ces agences, un titre reçoit une notation interne. Les notations inférieures à la catégorie investissement sont celles inférieures à Baa3 selon Moody's, à BAA- selon la notation interne, à BBB- selon S&P et Fitch, et à BBBL selon DBRS.

## États de la situation financière Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 déc. 2023	31 déc. 2022
<b>Actif :</b>		
Actif courant :		
<i>Placements, à la juste valeur</i>		
Placements dans des titres <sup>‡</sup>	429 594 \$	532 970 \$
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Hors cote	10 750	461
Trésorerie	234	0
Dépôts auprès de contreparties	1 701	2 261
Devises	918	1 414
Montants à recevoir pour les parts vendues	437	66
Intérêts et dividendes à recevoir	2 333	2 058
Autres actifs	1	1
	445 968	539 231
<b>Passif :</b>		
Passif courant :		
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	28	0
Hors cote	2 453	3 415
Dépôts de contreparties	10 701	0
Montants à payer pour les parts rachetées	410	254
Distributions à payer	1 839	1 363
Découvert - montant à payer au dépositaire	0	1
Frais de gestion à payer	94	205
	15 525	5 238
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>430 443 \$</b>	<b>533 993 \$</b>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A	59 828 \$	94 464 \$
Nombre de parts rachetables - série A	6 348	10 063
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	9,42 \$	9,39 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F	84 577 \$	325 399 \$
Nombre de parts rachetables - série F	8 975	34 662
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	9,42 \$	9,39 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I	216 619 \$	28 610 \$
Nombre de parts rachetables - série I	22 986	3 047
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	9,42 \$	9,39 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série FNB	37 260 \$	42 787 \$
Nombre de parts rachetables - série FNB	1 950	2 250
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série FNB	19,11 \$	19,02 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A (\$ US)	21 303 \$	22 027 \$
Nombre de parts rachetables - série A (\$ US)	1 687	1 722
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A (\$ US)	12,63 \$	12,79 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A (\$ US)	9,53 USD	9,45 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F (\$ US)	10 856 \$	20 706 \$
Nombre de parts rachetables - série F (\$ US)	860	1 619
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F (\$ US)	12,63 \$	12,79 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F (\$ US)	9,53 USD	9,45 USD
<sup>‡</sup> Comprend les prises en pension de :	16 166 \$	25 455 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États du résultat global Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)

(en milliers \$, sauf pour les montants par part)

	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Revenus :</b>		
<b>Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés</b>		
Intérêts à distribuer	22 346 \$	16 666 \$
Gain (perte) net réalisé à la vente de placements	65	(5 900)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(37)	0
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés hors cote	(7 910)	(7 201)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	(2 262)	10 150
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(414)	0
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés hors cote	11 251	(4 848)
Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés	23 039	8 867
<b>Autres revenus (pertes)</b>		
Gain (perte) net réalisé sur opérations en devises	3 743	(6 794)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente à la conversion des actifs et des passifs libellés en devises	10	35
Autres revenus (pertes)	3 753	(6 759)
Total - Revenus (pertes)	26 792	2 108
<b>Charges :</b>		
Frais de gestion	1 356	2 652
Frais liés au CEI	3	3
Charges d'intérêts	179	85
Coûts de transaction	3	0
Total - Charges	1 541	2 740
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	25 251 \$	(632) \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série</b>		
Série A	4 241 \$	(1 183) \$
Série F	6 954	(2 418)
Série I	10 385	118
Série FNB	2 376	(289)
Série A (\$ US)	752	1 402
Série F (\$ US)	543	1 738
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part</b>		
Série A	0,48 \$	(0,09) \$
Série F	0,54	(0,06)
Série I	0,52	0,04
Série FNB	1,03	(0,11)
Série A (\$ US)	0,45	0,73
Série F (\$ US)	0,50	0,64

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

	Exercice clos le 31 déc. 2023						
	Série A	Série F	Série I	Série FNB	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	94 464 \$	325 399 \$	28 610 \$	42 787 \$	22 027 \$	20 706 \$	533 993 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	4 241	6 954	10 385	2 376	752	543	25 251
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>							
Provenant du revenu net de placement	(3 859)	(5 743)	(10 298)	(2 146)	(1 004)	(678)	(23 728)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(3 859)	(5 743)	(10 298)	(2 146)	(1 004)	(678)	(23 728)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>							
Produit de la vente de parts rachetables	11 401	81 709	207 128	9 577	4 258	1 706	315 779
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	2 721	3 638	1 110	0	119	561	8 149
Coût des parts rachetables rachetées	(49 140)	(327 380)	(20 316)	(15 334)	(4 849)	(11 982)	(429 001)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(35 018)	(242 033)	187 922	(5 757)	(472)	(9 715)	(105 073)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(34 636)	(240 822)	188 009	(5 527)	(724)	(9 850)	(103 550)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	59 828 \$	84 577 \$	216 619 \$	37 260 \$	21 303 \$	10 856 \$	430 443 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>							
Parts rachetables vendues	1 208	8 669	21 976	500	336	133	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	289	386	118	0	9	44	S.O.
Parts rachetables rachetées	(5 212)	(34 742)	(2 155)	(800)	(380)	(936)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(3 715)	(25 687)	19 939	(300)	(35)	(759)	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	10 063	34 662	3 047	2 250	1 722	1 619	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	6 348	8 975	22 986	1 950	1 687	860	S.O.

	Exercice clos le 31 déc. 2022						
	Série A	Série F	Série I	Série FNB	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	152 816 \$	446 309 \$	28 530 \$	53 884 \$	33 483 \$	52 297 \$	767 319 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 183)	(2 418)	118	(289)	1 402	1 738	(632)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>							
Provenant du revenu net de placement	(2 611)	(9 275)	(825)	(1 208)	(515)	(743)	(15 177)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(2 611)	(9 275)	(825)	(1 208)	(515)	(743)	(15 177)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>							
Produit de la vente de parts rachetables	41 682	136 672	43 520	3 879	1 137	19 878	246 768
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	1 840	2 663	823	0	139	624	6 089
Coût des parts rachetables rachetées	(98 080)	(248 552)	(43 556)	(13 479)	(13 619)	(53 088)	(470 374)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(54 558)	(109 217)	787	(9 600)	(12 343)	(32 586)	(217 517)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(58 352)	(120 910)	80	(11 097)	(11 456)	(31 591)	(233 326)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	94 464 \$	325 399 \$	28 610 \$	42 787 \$	22 027 \$	20 706 \$	533 993 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>							
Parts rachetables vendues	4 378	14 367	4 586	200	93	1 614	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	195	281	87	0	11	50	S.O.
Parts rachetables rachetées	(10 297)	(26 093)	(4 573)	(700)	(1 100)	(4 290)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(5 724)	(11 445)	100	(500)	(996)	(2 626)	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	15 787	46 107	2 947	2 750	2 718	4 245	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	10 063	34 662	3 047	2 250	1 722	1 619	S.O.

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## Tableaux des flux de trésorerie Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)

(en milliers*)	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	25 251 \$	(632) \$
<b>Ajustements au titre du rapprochement de l'augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et des entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation :</b>		
Achats de titres	(3 805 554)	(4 053 618)
Produit de la vente de placements	3 910 378	4 288 502
(Augmentation) diminution des dépôts auprès de contreparties	560	(2 260)
(Augmentation) diminution des intérêts et des dividendes à recevoir	(275)	56
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(423)	0
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés hors cote	(7 910)	(7 202)
(Augmentation) diminution des autres actifs	0	(1)
Augmentation (diminution) des dépôts de contreparties	10 701	(985)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(111)	(113)
Produit (paiements) au titre des opérations en devises	3 754	(6 775)
<i>(Gain) perte nette réalisée</i>		
Placements	(65)	5 900
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	37	0
Instruments financiers dérivés hors cote	7 910	7 201
Opérations en devises	(3 743)	6 794
<i>Variation nette de la (plus-value) moins-value latente</i>		
Placements	2 262	(10 150)
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	414	0
Instruments financiers dérivés hors cote	(11 251)	4 848
Conversion de passifs et d'actifs libellés en devises	(10)	(35)
Amortissement net des primes (des escomptes) sur les placements	(3 645)	(1 070)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation</b>	<b>128 280</b>	<b>230 460</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement :</b>		
Produit de la vente de parts rachetables**	103 538	211 080
Montant payé au titre du rachat de parts rachetables**	(216 975)	(435 400)
Distributions en trésorerie versées aux porteurs de parts rachetables	(15 103)	(8 264)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement</b>	<b>(128 540)</b>	<b>(232 584)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des devises</b>	<b>(260)</b>	<b>(2 124)</b>
<b>Trésorerie (découvert) et devises :</b>		
Ouverture de l'exercice	1 413	3 521
Gain (perte) de change sur la trésorerie	(1)	16
Clôture de l'exercice	1 152 \$	1 413 \$
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie :</b>		
Intérêts payés liés aux activités de financement	158 \$	85 \$
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	18 381 \$	15 661 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

\*\* Ne comprend pas les transferts hors trésorerie entre les séries.

## Inventaire du portefeuille Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf le nombre d'actions, de contrats, de parts ou d'onces, selon le cas)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES 99,8 %</b>				<b>ÎLES CAÏMANS 7,6 %</b>			
<b>AUSTRALIE 3,3 %</b>				<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 7,2 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 2,9 %</b>				<b>ACAS CLO Ltd.</b>			
Ausgrid Finance Pty. Ltd.				6,547 %, échéant le 18 oct. 2028	195 USD	238 \$	258 \$
3,750 %, échéant le 30 oct. 2024	2 000 AUD	1 844 \$	1 787 \$	<b>Apex Credit CLO Ltd.</b>			
<b>ING Bank Australia Ltd.</b>				6,622 %, échéant le 20 sept. 2029	349	432	461
5,158 %, échéant le 26 mai 2025	6 200	5 578	5 609	<b>Apidos CLO</b>			
<b>Toyota Finance Australia Ltd.</b>				6,557 %, échéant le 18 juill. 2029	2 423	3 015	3 206
4,915 %, échéant le 26 mars 2024	450	426	406	6,594 %, échéant le 17 juill. 2030	599	723	792
<b>Transurban Queensland Finance Pty. Ltd.</b>				<b>AREIT Trust</b>			
6,413 %, échéant le 16 déc. 2024	5 000	4 674	4 550	6,553 %, échéant le 17 nov. 2038	1 329	1 684	1 747
		<u>12 522</u>	<u>12 352</u>	6,588 %, échéant le 20 janv. 2037	2 682	3 367	3 531
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 0,4 %</b>				<b>Ares CLO Ltd.</b>			
<b>RESIMAC Premier</b>				6,707 %, échéant le 18 avr. 2031	300	375	397
6,172 %, échéant le 10 juill. 2052	1 258 USD	1 593	1 664	<b>Brightspire Capital Ltd.</b>			
Total - Australie		<u>14 115</u>	<u>14 016</u>	6,620 %, échéant le 19 août 2038	2 857	3 558	3 693
<b>CANADA 7,6 %</b>				<b>BXMT Ltd.</b>			
<b>TITRES DU GOUVERNEMENT FÉDÉRAL 0,7 %</b>				6,876 %, échéant le 15 nov. 2037			
<b>CPPIB Capital, Inc.</b>				<b>Crestline Denali CLO Ltd.</b>			
6,666 %, échéant le 11 mars 2026	2 300 USD	3 240	3 102	6,707 %, échéant le 20 avr. 2030	2 026	2 536	2 683
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 2,9 %</b>				<b>LoanCore Issuer Ltd.</b>			
<b>BMW Canada Auto Trust</b>				6,776 %, échéant le 15 juill. 2036	956	1 153	1 250
5,430 %, échéant le 20 janv. 2026	3 113 \$	3 113	3 109	<b>Mountain View CLO LLC</b>			
<b>Fiducie de titrisation automobile Ford</b>				6,745 %, échéant le 16 oct. 2029	541	720	717
1,162 %, échéant le 15 oct. 2025	1 604	1 604	1 586	<b>Nassau Ltd.</b>			
5,211 %, échéant le 15 juin 2025	1 343	1 343	1 342	6,805 %, échéant le 15 oct. 2029	333	442	442
<b>GMF Canada Leasing Trust, obligations adossées à des actifs</b>				<b>OZLM Ltd.</b>			
5,458 %, échéant le 21 avr. 2025	2 147	2 147	2 162	6,644 %, échéant le 17 oct. 2029	1 947	2 514	2 578
<b>Trillium Credit Card Trust</b>				<b>Palmer Square CLO Ltd.</b>			
6,241 %, échéant le 26 août 2028	3 200 USD	4 366	4 257	6,664 %, échéant le 17 oct. 2031	3 100	3 836	4 103
		<u>12 573</u>	<u>12 456</u>	<b>Starwood Mortgage Trust</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 3,5 %</b>				6,688 %, échéant le 15 nov. 2038			
<b>La Banque de Nouvelle-Écosse</b>					2 000	<u>2 503</u>	<u>2 575</u>
5,813 %, échéant le 15 avr. 2024	2 800	3 721	3 711			<u>29 671</u>	<u>30 959</u>
6,378 %, échéant le 11 mars 2024	1 000	1 281	1 326	<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,4 %</b>			
<b>BMW Canada, Inc.</b>				<b>QNB Finance Ltd.</b>			
4,760 %, échéant le 10 févr. 2025	3 500 \$	3 499	3 494	1,125 %, échéant le 17 juin 2024	1 500	1 828	1 943
<b>Fédération des caisses Desjardins du Québec</b>				Total - Îles Caïmans		<u>31 499</u>	<u>32 902</u>
0,700 %, échéant le 21 mai 2024	1 500 USD	1 911	1 950	<b>DANEMARK 0,9 %</b>			
2,050 %, échéant le 10 févr. 2025	2 194	2 702	2 805	<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,9 %</b>			
<b>La Banque Toronto-Dominion</b>				<b>Danske Bank AS</b>			
6,327 %, échéant le 8 mars 2024	1 300	1 665	1 725	5,375 %, échéant le 12 janv. 2024	2 870 USD	3 838	3 802
		<u>14 779</u>	<u>15 011</u>	Total - Danemark		<u>3 838</u>	<u>3 802</u>
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 0,5 %</b>				<b>FRANCE 2,1 %</b>			
<b>Classic RMBS Trust</b>				<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 2,1 %</b>			
1,433 %, échéant le 15 nov. 2051	845 \$	845	814	<b>Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA</b>			
1,528 %, échéant le 15 mars 2052	1 198	1 198	1 181	5,799 %, échéant le 4 févr. 2025	1 000 USD	1 348	1 319
		<u>2 043</u>	<u>1 995</u>	<b>BNP Paribas SA</b>			
Total - Canada		<u>32 635</u>	<u>32 564</u>	3,800 %, échéant le 10 janv. 2024	2 000	2 696	2 649
				4,705 %, échéant le 10 janv. 2025	1 900	2 540	2 518
				<b>Société Générale SA</b>			
				2,625 %, échéant le 16 oct. 2024	2 000	2 633	2 588
				Total - France		<u>9 217</u>	<u>9 074</u>

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>IRLANDE 5,0 %</b>			
<b>TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS 3,4 %</b>			
<b>BNPP AM Euro CLO DAC</b>			
4,565 %, échéant le 15 avr. 2031	1 000 EUR	1 467 \$	1 441 \$
<b>Carlyle Euro CLO DAC</b>			
4,632 %, échéant le 15 août 2030	1 202	1 772	1 742
<b>Contego CLO DAC</b>			
4,642 %, échéant le 23 janv. 2030	399	619	575
<b>Harvest CLO DAC</b>			
4,605 %, échéant le 15 oct. 2031	2 052	3 158	2 951
<b>Man GLG Euro CLO DAC</b>			
4,615 %, échéant le 15 déc. 2031	1 477	2 229	2 136
4,645 %, échéant le 15 oct. 2030	1 072	1 651	1 559
<b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b>			
4,745 %, échéant le 15 avr. 2031	220	326	318
<b>Tikehau CLO DAC</b>			
4,844 %, échéant le 4 août 2034	2 800	4 168	4 048
		<u>15 390</u>	<u>14 770</u>
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,3 %</b>			
<b>AerCap Ireland Capital DAC</b>			
1,650 %, échéant le 29 oct. 2024	1 185 USD	1 548	1 517
1,750 %, échéant le 29 oct. 2024	1 000	1 236	1 280
2,875 %, échéant le 14 août 2024	600	786	780
<b>SMBC Aviation Capital Finance DAC</b>			
3,550 %, échéant le 15 avr. 2024	1 600	2 145	2 106
		<u>5 715</u>	<u>5 683</u>
<b>TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 0,3 %</b>			
<b>Dilosk RMBS DAC</b>			
4,752 %, échéant le 20 févr. 2060	862 EUR	1 329	1 261
Total - Irlande		<u>22 434</u>	<u>21 714</u>
<b>ISRAËL 0,2 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,2 %</b>			
<b>Obligation internationale du gouvernement d'Israël</b>			
3,750 %, échéant le 31 mars 2024	1 800 ILS	661	659
Total - Israël		<u>661</u>	<u>659</u>
<b>JAPON 2,7 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 2,7 %</b>			
<b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b>			
6,339 %, échéant le 20 févr. 2026	2 000 USD	2 680	2 651
6,801 %, échéant le 12 sept. 2025	700	952	930
<b>Panasonic Holdings Corp.</b>			
2,679 %, échéant le 19 juill. 2024	540	708	704
<b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>			
5,402 %, échéant le 16 oct. 2024	8 000 AUD	7 553	7 239
Total - Japon		<u>11 893</u>	<u>11 524</u>
<b>PAYS-BAS 0,6 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,6 %</b>			
<b>Enel Finance International NV</b>			
2,650 %, échéant le 10 sept. 2024	2 000 USD	2 556	2 589
Total - Pays-Bas		<u>2 556</u>	<u>2 589</u>

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>NORVÈGE 0,8 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,8 %</b>			
<b>DNB Bank ASA</b>			
0,856 %, échéant le 30 sept. 2025	500 USD	646 \$	640 \$
6,266 %, échéant le 28 mars 2025	2 200	3 013	2 917
Total - Norvège		<u>3 659</u>	<u>3 557</u>
<b>SINGAPOUR 0,8 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,8 %</b>			
<b>Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.</b>			
4,713 %, échéant le 18 mars 2024	4 000 AUD	3 689	3 612
Total - Singapour		<u>3 689</u>	<u>3 612</u>
<b>CORÉE DU SUD 0,7 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,7 %</b>			
<b>Korea Southern Power Co. Ltd.</b>			
5,312 %, échéant le 30 oct. 2024	3 500 AUD	3 326	3 156
Total - Corée du Sud		<u>3 326</u>	<u>3 156</u>
<b>ESPAGNE 0,8 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,8 %</b>			
<b>Banco Santander SA</b>			
3,892 %, échéant le 24 mai 2024	800 USD	1 067	1 053
5,742 %, échéant le 30 juin 2024	1 700	2 227	2 252
Total - Espagne		<u>3 294</u>	<u>3 305</u>
<b>SWEDEN 0,8 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,8 %</b>			
<b>Skandinaviska Enskilda Banken AB</b>			
6,378 %, échéant le 9 juin 2025	2 000 USD	2 550	2 656
<b>Swedbank AB</b>			
6,270 %, échéant le 4 avr. 2025	550	749	730
Total - Suède		<u>3 299</u>	<u>3 386</u>
<b>SUISSE 1,5 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,5 %</b>			
<b>Credit Suisse AG</b>			
5,779 %, échéant le 2 févr. 2024	2 500 USD	3 173	3 311
<b>UBS AG</b>			
5,212 %, échéant le 30 juill. 2025	2 500 AUD	2 377	2 253
<b>UBS Group AG</b>			
6,976 %, échéant le 12 mai 2026	800 USD	1 027	1 065
Total - Suisse		<u>6 577</u>	<u>6 629</u>
<b>ROYAUME-UNI 9,7 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 4,2 %</b>			
<b>Barclays PLC</b>			
3,932 %, échéant le 7 mai 2025	2 827 USD	3 702	3 721
6,515 %, échéant le 26 juin 2024	1 500 AUD	1 396	1 362
<b>HSBC Holdings PLC</b>			
6,863 %, échéant le 11 mars 2025	2 800 USD	3 815	3 716
7,008 %, échéant le 12 sept. 2026	407	509	544
<b>NatWest Group PLC</b>			
4,269 %, échéant le 22 mars 2025	1 000	1 373	1 321
<b>NatWest Markets PLC</b>			
0,800 %, échéant le 12 août 2024	1 500	1 952	1 930
3,479 %, échéant le 22 mars 2025	200	254	260
6,880 %, échéant le 22 mars 2025	700	959	934

## Inventaire du portefeuille Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Standard Chartered PLC</b>							
1,214 %, échéant le 23 mars 2025	400 USD	539 \$	526 \$				
1,822 %, échéant le 23 nov. 2025	3 000	3 873	3 829				
		<u>18 372</u>	<u>18 143</u>				
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 5,5 %</b>							
<b>Canada Square Funding PLC</b>							
6,000 %, échéant le 17 juin 2058	1 213 GBP	2 084	2 040				
<b>Finsbury Square Green PLC</b>							
5,870 %, échéant le 16 déc. 2067	844	1 445	1 419				
<b>Residential Mortgage Securities PLC</b>							
6,470 %, échéant le 20 juin 2070	1 605	2 755	2 717				
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>							
6,120 %, échéant le 12 mars 2052	1 718	2 939	2 901				
6,121 %, échéant le 20 juill. 2060	407	716	687				
<b>Towd Point Mortgage Funding</b>							
6,365 %, échéant le 20 oct. 2051	399	680	675				
6,570 %, échéant le 20 mai 2045	1 948	3 376	3 295				
6,571 %, échéant le 20 juill. 2045	1 327	2 235	2 247				
<b>Trinity Square PLC</b>							
6,070 %, échéant le 15 juill. 2059	1 131	1 956	1 910				
<b>Tudor Rose Mortgages</b>							
5,820 %, échéant le 20 juin 2048	1 153	1 953	1 936				
<b>Twin Bridges PLC</b>							
6,070 %, échéant le 12 mars 2055	2 349	4 155	3 953				
		<u>24 294</u>	<u>23 780</u>				
Total - Royaume-Uni		<u>42 666</u>	<u>41 923</u>				
<b>ÉTATS-UNIS 37,5 %</b>							
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 14,0 %</b>							
<b>BMW Vehicle Lease Trust</b>							
5,950 %, échéant le 25 août 2025	4 000 USD	5 483	5 316				
<b>Capital One Multi-Asset Execution Trust</b>							
6,056 %, échéant le 15 juill. 2027	2 500	3 194	3 320				
<b>Capital One Prime Auto Receivables Trust</b>							
5,988 %, échéant le 15 sept. 2025	1 044	1 416	1 384				
<b>CarMax Auto Owner Trust</b>							
5,938 %, échéant le 16 nov. 2026	3 000	3 951	3 979				
<b>Chesapeake Funding LLC</b>							
6,103 %, échéant le 15 août 2032	88	120	117				
<b>Citibank Credit Card Issuance Trust</b>							
6,084 %, échéant le 7 août 2027	2 500	3 193	3 325				
6,091 %, échéant le 22 avr. 2026	2 500	3 195	3 317				
<b>Discover Card Execution Note Trust</b>							
6,076 %, échéant le 15 déc. 2026	2 500	3 194	3 318				
<b>ELFI Graduate Loan Program LLC</b>							
1,530 %, échéant le 26 déc. 2046	1 608	1 991	1 853				
<b>Fifth Third Auto Trust</b>							
5,868 %, échéant le 16 nov. 2026	1 800	2 430	2 386				
<b>GM Financial Consumer Automobile Receivables Trust</b>							
5,938 %, échéant le 16 sept. 2025	735	989	974				
5,958 %, échéant le 16 mars 2026	1 048	1 402	1 390				
<b>Hertz Vehicle Financing LLC</b>							
1,990 %, échéant le 25 juin 2026	1 500	1 936	1 900				
<b>Honda Auto Receivables Owner Trust</b>							
5,710 %, échéant le 18 mars 2026	2 300	3 104	3 057				
<b>Kubota Credit Owner Trust</b>							
5,610 %, échéant le 15 juill. 2026	3 400	4 480	4 521				
<b>LAD Auto Receivables Trust</b>							
5,210 %, échéant le 15 juin 2027	216	288	285				
<b>Navient Private Education Refi Loan Trust</b>							
1,310 %, échéant le 15 janv. 2069	636 USD	836 \$	772 \$				
1,580 %, échéant le 15 avr. 2070	1 330	1 675	1 530				
1,690 %, échéant le 15 mai 2069	771	1 043	931				
<b>Nelnet Student Loan Trust</b>							
6,270 %, échéant le 25 août 2067	291	380	382				
6,352 %, échéant le 27 juin 2067	446	601	586				
<b>Nissan Auto Lease Trust</b>							
5,100 %, échéant le 17 mars 2025	2 106	2 843	2 785				
5,958 %, échéant le 15 août 2025	996	1 311	1 322				
<b>PRET LLC</b>							
1,992 %, échéant le 25 févr. 2061	763	928	989				
<b>Ready Capital Mortgage Financing LLC</b>							
6,420 %, échéant le 25 juill. 2036	1 337	1 671	1 752				
<b>SMB Private Education Loan Trust</b>							
2,340 %, échéant le 15 sept. 2034	240	313	311				
6,076 %, échéant le 17 mars 2053	202	253	262				
6,320 %, échéant le 15 sept. 2054	1 003	1 320	1 312				
6,576 %, échéant le 15 juill. 2053	685	912	900				
<b>SoFi Professional Loan Program Trust</b>							
1,950 %, échéant le 15 févr. 2046	669	938	807				
<b>Verizon Master Trust</b>							
6,018 %, échéant le 8 sept. 2028	2 000	2 712	2 654				
<b>VMC Finance LLC</b>							
6,573 %, échéant le 16 juin 2036	922	1 113	1 211				
<b>World Omni Auto Receivables Trust</b>							
6,188 %, échéant le 16 mars 2026	985	1 332	1 306				
		<u>60 547</u>	<u>60 254</u>				
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 17,3 %</b>							
<b>American Honda Finance Corp.</b>							
6,106 %, échéant le 22 nov. 2024	400	549	531				
<b>American Tower Corp.</b>							
3,375 %, échéant le 15 mai 2024	1 400	1 881	1 838				
<b>AT&amp;T, Inc.</b>							
2,850 %, échéant le 25 mai 2024	2 000 \$	2 110	1 979				
<b>Athene Global Funding</b>							
5,962 %, échéant le 19 août 2024	300 USD	405	396				
6,108 %, échéant le 24 mai 2024	3 000	4 047	3 972				
<b>Bank of America Corp.</b>							
1,843 %, échéant le 4 févr. 2025	2 500	3 383	3 300				
2,932 %, échéant le 25 avr. 2025	1 000 \$	977	992				
6,424 %, échéant le 5 févr. 2026	374 USD	459	495				
<b>Baxter International, Inc.</b>							
1,322 %, échéant le 29 nov. 2024	1 000	1 297	1 277				
5,853 %, échéant le 29 nov. 2024	1 000	1 359	1 322				
<b>Boeing Co.</b>							
1,433 %, échéant le 4 févr. 2024	3 300	4 276	4 354				
<b>Citigroup, Inc.</b>							
6,058 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2025	800	992	1 058				
6,069 %, échéant le 30 oct. 2024	1 000	1 341	1 326				
<b>CNH Industrial Capital LLC</b>							
4,200 %, échéant le 15 janv. 2024	800	1 069	1 059				
<b>CommonSpirit Health</b>							
2,760 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2024	3 000	3 986	3 888				
<b>Daimler Truck Finance North America LLC</b>							
6,167 %, échéant le 13 déc. 2024	500	666	662				
<b>DTE Energy Co.</b>							
4,220 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2024	1 000	1 339	1 310				
<b>Energy Transfer LP</b>							
5,875 %, échéant le 15 janv. 2024	3 300	4 347	4 372				

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Fiserv, Inc.</b> 2,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juill. 2024	600 USD	786 \$	783 \$	<b>Natixis Commercial Mortgage Securities Trust</b> 6,426 %, échéant le 15 août 2038	1 000 USD	1 267 \$	1 243 \$
<b>GA Global Funding Trust</b> 5,921 %, échéant le 13 sept. 2024	1 040	1 360	1 369	<b>New Residential Mortgage Loan Trust</b> 0,941 %, échéant le 25 oct. 2058	1 101	1 339	1 334
<b>General Motors Financial Co., Inc.</b> 3,500 %, échéant le 7 nov. 2024	2 000	2 654	2 603	<b>Towd Point Mortgage Trust</b> 6,470 %, échéant le 25 mai 2058	484	644	653
<b>Georgia Power Co.</b> 6,144 %, échéant le 8 mai 2025	3 000	4 084	3 985	6,470 %, échéant le 25 oct. 2059	532	697	709
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b> 5,861 %, échéant le 21 oct. 2024	600	812	794			<u>17 112</u>	<u>16 693</u>
<b>Hyundai Capital America</b> 6,539 %, échéant le 4 août 2025	2 100	2 791	2 782	<b>ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX AMÉRICAINS 2,3 %</b>			
<b>Jackson National Life Global Funding</b> 6,586 %, échéant le 28 juin 2024	1 000	1 335	1 328	<b>Fannie Mae</b> 5,406 %, échéant le 25 juill. 2046	85	111	111
<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b> 2,301 %, échéant le 15 oct. 2025	1 500	2 002	1 937	5,483 %, échéant le 25 mai 2050	2 508	3 506	3 295
6,392 %, échéant le 14 juin 2025	1 800	2 452	2 389	5,852 %, échéant le 25 juin 2036	73	97	96
<b>McDonald's Corp.</b> 5,474 %, échéant le 8 mars 2024	3 300 AUD	3 194	2 981	5,952 %, échéant le 25 août 2059	386	515	501
<b>Mississippi Power Co.</b> 5,736 %, échéant le 28 juin 2024	700 USD	863	927	6,032 %, échéant le 25 juin 2041	248	329	325
<b>Morgan Stanley</b> 0,791 %, échéant le 22 janv. 2025	2 000	2 680	2 642	<b>Federal Home Loan Bank</b> 5,660 %, échéant le 20 sept. 2024	1 093	1 481	1 448
<b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b> 6,449 %, échéant le 21 mars 2024	2 800	3 534	3 712	5,720 %, échéant le 27 sept. 2024	2 000	2 718	2 650
<b>Penske Truck Leasing Co. LP</b> 3,900 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2024	600	802	794	<b>Freddie Mac</b> 3,000 %, échéant le 25 sept. 2045	338	457	391
<b>Reynolds American, Inc.</b> 4,450 %, échéant le 12 juin 2025	744	1 118	975	5,803 %, échéant le 15 août 2043	40	53	52
<b>Santander Holdings USA, Inc.</b> 3,500 %, échéant le 7 juin 2024	1 000	1 304	1 311	5,935 %, échéant le 25 févr. 2026	83	113	110
<b>Southern California Edison Co.</b> 6,266 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2024	1 000	1 349	1 326	<b>Ginnie Mae</b> 5,837 %, échéant le 20 nov. 2070	54	69	69
<b>Tyson Foods, Inc.</b> 3,950 %, échéant le 15 août 2024	1 000	1 359	1 310	5,857 %, échéant le 20 févr. 2046	503	665	640
<b>Volkswagen Group of America Finance LLC</b> 6,349 %, échéant le 12 sept. 2025	2 000	2 728	2 657	6,000 %, échéant le 20 juill. 2039	110	153	145
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b> 2,406 %, échéant le 30 oct. 2025	3 000	3 875	3 868	6,372 %, échéant le 20 août 2039	73	101	97
		<u>75 565</u>	<u>74 604</u>			<u>10 368</u>	<u>9 930</u>
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 3,9 %</b>				Total - États-Unis		<u>163 592</u>	<u>161 481</u>
<b>BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust</b> 6,459 %, échéant le 15 avr. 2036	1 500	2 020	1 979	<b>INSTRUMENTS À COURT TERME 17,2 %</b>			
<b>Credit Suisse Mortgage Capital Trust</b> 3,565 %, échéant le 15 déc. 2049	415	574	537	<b>BILLETS DE TRÉSORERIE 12,5 %</b>			
<b>GCAT Trust</b> 2,650 %, échéant le 25 oct. 2068	680	903	859	<b>Arrow Electronics, Inc.</b> 5,850 %, échéant le 11 janv. 2024	1 900 USD	2 530	2 512
<b>GS Mortgage Securities Corp. Trust</b> 8,762 %, échéant le 15 août 2039	2 300	2 924	3 073	5,900 %, échéant le 19 janv. 2024	1 150	1 523	1 519
<b>HPLY Trust</b> 6,475 %, échéant le 15 nov. 2036	1 149	1 546	1 513	5,900 %, échéant le 22 janv. 2024	1 150	1 522	1 518
<b>JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b> 6,859 %, échéant le 15 déc. 2031	476	632	516	<b>Bacardi-Martini BV</b> 5,950 %, échéant le 23 janv. 2024	2 000	2 670	2 639
6,976 %, échéant le 15 sept. 2029	1 699	2 249	2 081	5,950 %, échéant le 24 janv. 2024	1 200	1 582	1 583
<b>MFA Trust</b> 1,131 %, échéant le 25 juill. 2060	1 300	1 572	1 530	<b>Cigna Corp.</b> 5,650 %, échéant le 16 janv. 2024	400	542	529
<b>Mill City Mortgage Loan Trust</b> 2,750 %, échéant le 25 août 2059	530	745	666	5,680 %, échéant le 17 janv. 2024	900	1 219	1 189
				<b>Conagra Foods, Inc.</b> 5,820 %, échéant le 11 janv. 2024	3 200	4 244	4 231
				<b>Constellation Brands, Inc.</b> 5,740 %, échéant le 5 janv. 2024	3 200	4 318	4 235
				<b>Constellation Energy Generation LLC</b> 5,660 %, échéant le 9 janv. 2024	3 300	4 410	4 365
				<b>Energy Transfer Partners LP</b> 5,850 %, échéant le 4 janv. 2024	1 400	1 859	1 853
				<b>Global Payments, Inc.</b> 6,030 %, échéant le 5 janv. 2024	3 300	4 491	4 368
				<b>Marathon Oil Corp.</b> 6,050 %, échéant le 3 janv. 2024	4 800	6 374	6 355
				<b>Nissan Motor Acceptance Co LLC</b> 6,200 %, échéant le 12 janv. 2024	3 200	4 238	4 231
				<b>Quanta Storage, Inc.</b> 5,850 %, échéant le 4 janv. 2024	3 300	4 399	4 369
				5,900 %, échéant le 18 janv. 2024	900	1 192	1 189
				<b>Southern California Edison Co.</b> 5,730 %, échéant le 17 janv. 2024	2 300	3 096	3 038

## Inventaire du portefeuille Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>VF Corp.</b>				<b>BILLETS À COURT TERME 0,9 %</b>			
6,100 %, échéant le 17 janv. 2024	1 900 USD	2 572 \$	2 510 \$	<b>American Honda Finance Corp.</b>			
<b>Crédit VW, Inc.</b>				5,971 %, échéant le 7 juin 2024	2 800 USD	3 719 \$	3 713 \$
5,700 %, échéant le 4 janv. 2024	1 200	1 624	1 589	Total - Placements à court terme		74 211	73 701
		<u>54 405</u>	<u>53 822</u>	Total - Placements dans des titres		<u>433 161</u>	<u>429 594</u>
<b>PRISES EN PENSION<sup>a)</sup> 3,8 %</b>				<b>Total - Placements 99,8 %</b>		<b>433 161 \$</b>	<b>429 594 \$</b>
		<u>16 087</u>	<u>16 166</u>	Instruments financiers dérivés <sup>b), c)</sup> 1,9 %		0	8 269
				Passifs, moins les autres actifs (1,7) %			<u>(7 420)</u>
				<b>Total de l'actif net attribuable aux porteurs de parts</b>			<b>430 443 \$</b>
				rachetables 100,0 %			

### NOTES À L'INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE :

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

### EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

#### a) OPÉRATIONS DE PRISE EN PENSION :

Contrepartie	Taux de financement	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du capital	Garanti par	Garanties (reçues)	Prises en pension, à la valeur	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>
MBC	5,550 %	29 déc. 2023	2 janv. 2024	100 USD	Obligations du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéant le 31 janv. 2027	(137) \$	133 \$	133 \$
TDM	5,450	29 déc. 2023	2 janv. 2024	12 100	Obligations du Trésor des États-Unis, 2,375 %, échéant le 15 févr. 2042	(16 430)	16 033	16 043
<b>Total - Prises en pension de titres</b>						<b>(16 567) \$</b>	<b>16 166 \$</b>	<b>16 176 \$</b>

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et des autres opérations de financement et des garanties données/(reçues).

#### b) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE

##### CONTRATS À TERME :

Description	Type	Mois de l'échéance	Nombre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	Marge de variation	
					Actif	Passif
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, mars	Position courte	Juin 2025	121	(301) \$	0 \$	(16) \$
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 5 ans, mars	Position courte	Mars 2024	106	(113)	0	(12)
<b>Total des contrats à terme</b>				<b>(414) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(28) \$</b>

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée.

#### c) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE

##### CONTRATS DE CHANGE À TERME :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
AZD	Janv. 2024	30 106 AUD	19 951 USD	0 \$	(754) \$
	Janv. 2024	894 \$	662	0	(17)
BOA	Janv. 2024	239	176	0	(5)
	Janv. 2024	672 GBP	853	0	(4)
BPS	Janv. 2024	1 058 \$	780	0	(24)
	Janv. 2024	2 562 GBP	3 249	0	(21)
	Janv. 2024	414 USD	325 GBP	1	0

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
BRC	Janv. 2024	844 \$	633 USD	0 \$	(6) \$
	Janv. 2024	53 GBP	66	0	(1)
CBK	Janv. 2024	99 038 USD	134 678 \$	3 462	0
	Janv. 2024	3 081 \$	2 280 USD	0	(61)
	Janv. 2024	413 USD	626 AUD	18	0
	Janv. 2024	2 570	3 494 \$	89	0
	Janv. 2024	382	301 GBP	2	0
GLM	Avril 2024	1 805 ILS	498 USD	0	(2)
	Janv. 2024	14 144 \$	10 540	0	(180)
MBC	Janv. 2024	109 508 USD	148 817 \$	3 729	0
	Janv. 2024	9 225 AUD	6 117 USD	0	(227)
	Janv. 2024	1 054 \$	782	0	(19)
	Janv. 2024	11 048 EUR	12 147	0	(70)
	Janv. 2024	1 453 USD	2 145 AUD	12	0
MYI	Janv. 2024	20 772	28 110 \$	590	0
	Janv. 2024	72 \$	54 USD	0	0
SSB	Janv. 2024	85 826 USD	116 528 \$	2 816	0
	Janv. 2024	11 406 GBP	14 393 USD	0	(194)
				<b>10 719 \$</b>	<b>(1 585) \$</b>

**CONTRATS DE CHANGE À TERME EN COURS, EN \$ US, SÉRIE COUVERTE† :**

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
AZD	Janv. 2024	212 USD	288 \$	7 \$	0 \$
BRC	Janv. 2024	11 221 \$	8 252 USD	0	(288)
CBK	Janv. 2024	11 284	8 302	0	(285)
	Janv. 2024	809 USD	1 095 \$	24	0
GLM	Janv. 2024	11 300 \$	8 317 USD	0	(281)
	Janv. 2024	31 USD	41 \$	0	0
MYI	Janv. 2024	576 \$	424 USD	0	(14)
				<b>31 \$</b>	<b>(868) \$</b>
<b>Total des contrats de change à terme</b>				<b>10 750 \$</b>	<b>(2 453) \$</b>

† Le Fonds offre des séries en \$ US, couvertes, et utilise des techniques et des instruments pour réduire l'exposition au dollar canadien, en totalité ou en partie. Il est impossible de garantir que les séries \$ US, couvertes, seront couvertes en tout temps ni que la technique de couverture sera efficace.

**Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues).**

## Notes annexes propres au Fonds Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

### SOMMAIRE DES EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA)						
MBC	133 \$	0 \$	0 \$	133 \$	(137) \$	(4) \$
TDM	16 043	0	0	16 043	(16 430)	(387)
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement</b>	<b>16 176 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA)						
MBC	25 473 \$	0 \$	0 \$	25 473 \$	(26 154) \$	(681) \$
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement</b>	<b>25 473 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

<sup>2)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux emprunts et autres opérations de financement ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2023 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
<b>Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(28) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(28) \$</b>

Au 31 décembre 2022, il n'y avait aucun instrument financier dérivé négocié en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée en cours.

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	7 \$	0 \$	0 \$	7 \$	(771) \$	0 \$	0 \$	(771) \$	(764) \$	914 \$	150 \$
BOA	0	0	0	0	(9)	0	0	(9)	(9)	0	(9)
BPS	1	0	0	1	(45)	0	0	(45)	(44)	0	(44)
BRC	3 462	0	0	3 462	(295)	0	0	(295)	3 167	(3 578)	(411)
CBK	133	0	0	133	(348)	0	0	(348)	(215)	0	(215)
GLM	3 729	0	0	3 729	(461)	0	0	(461)	3 268	(3 631)	(363)
MBC	602	0	0	602	(316)	0	0	(316)	286	(278)	8
MYI	2 816	0	0	2 816	(14)	0	0	(14)	2 802	(3 193)	(391)
SSB	0	0	0	0	(194)	0	0	(194)	(194)	0	(194)
<b>Total - Hors cote</b>	<b>10 750 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>10 750 \$</b>	<b>(2 453) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(2 453) \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	11 \$	0 \$	0 \$	11 \$	(2) \$	0 \$	0 \$	(2) \$	9 \$	0 \$	9 \$
BOA	72	0	0	72	(267)	0	0	(267)	(195)	356	161
BPS	135	0	0	135	0	0	0	0	135	0	135
BRC	0	0	0	0	(12)	0	0	(12)	(12)	0	(12)
CBK	48	0	0	48	(1 232)	0	0	(1 232)	(1 184)	555	(629)
JPM	2	0	0	2	(57)	0	0	(57)	(55)	0	(55)
MBC	67	0	0	67	(615)	0	0	(615)	(548)	623	75
MYI	9	0	0	9	0	0	0	0	9	0	9
RBC	12	0	0	12	(34)	0	0	(34)	(22)	0	(22)
TOR	105	0	0	105	(1 196)	0	0	(1 196)	(1 091)	1 083	(8)
<b>Total - Hors cote</b>	<b>461 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>461 \$</b>	<b>(3 415) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(3 415) \$</b>			

<sup>1)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux instruments financiers dérivés hors cote ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

## ÉVALUATIONS DE LA JUSTE VALEUR

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2023 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Australie				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	12 352 \$	0 \$	12 352 \$
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	1 664	0	1 664
Canada				
Titres du gouvernement fédéral	0	3 102	0	3 102
Titres adossés à des actifs	0	12 456	0	12 456
Obligations et billets de sociétés	0	15 011	0	15 011
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	1 995	0	1 995
Îles Caïmans				
Titres adossés à des actifs	0	30 959	0	30 959
Obligations et billets de sociétés	0	1 943	0	1 943
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0	3 802	0	3 802
France				
Obligations et billets de sociétés	0	9 074	0	9 074

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Irlande</b>				
Titres adossés à des actifs	0 \$	14 770 \$	0 \$	14 770 \$
Obligations et billets de sociétés	0	5 683	0	5 683
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	1 261	0	1 261
<b>Israël</b>				
Émissions souveraines	0	659	0	659
<b>Japon</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	11 524	0	11 524
<b>Pays-Bas</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	2 589	0	2 589
<b>Norvège</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	3 557	0	3 557
<b>Singapour</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	3 612	0	3 612
<b>Corée du Sud</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	3 156	0	3 156
<b>Espagne</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	3 305	0	3 305
<b>Suède</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	3 386	0	3 386
<b>Suisse</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	6 629	0	6 629
<b>Royaume-Uni</b>				
Obligations et billets de sociétés	0	18 143	0	18 143
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	23 780	0	23 780
<b>États-Unis</b>				
Titres adossés à des actifs	0	60 254	0	60 254
Obligations et billets de sociétés	0	74 604	0	74 604
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	16 693	0	16 693
Organismes gouvernementaux américains	0	9 930	0	9 930
<b>Instruments à court terme</b>				
Billets de trésorerie	0	53 822	0	53 822
Prises en pension	0	16 166	0	16 166
Billets à court terme	0	3 713	0	3 713
<b>Total - Placements</b>	<b>0 \$</b>	<b>429 594 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>429 594 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Hors cote	0 \$	10 750 \$	0 \$	10 750 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	(28)	0	(28)
Hors cote	0	(2 453)	0	(2 453)
	0 \$	(2 481) \$	0 \$	(2 481) \$
<b>Total - Instruments financiers dérivés</b>	<b>0 \$</b>	<b>8 269 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>8 269 \$</b>
<b>Totaux</b>	<b>0 \$</b>	<b>437 863 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>437 863 \$</b>

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2022 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
<b>Australie</b>				
Titres adossés à des actifs	0 \$	1 247 \$	0 \$	1 247 \$
Obligations et billets de sociétés	0	14 358	0	14 358
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	3 484	0	3 484
<b>Canada</b>				
Titres adossés à des actifs	0	13 031	0	13 031
Obligations et billets de sociétés	0	8 119	0	8 119
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	4 071	0	4 071
<b>Îles Caïmans</b>				
Titres adossés à des actifs	0	41 907	0	41 907
Obligations et billets de sociétés	0	1 911	0	1 911

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	4 245 \$	0 \$	4 245 \$
Finlande				
Obligations et billets de sociétés	0	2 711	0	2 711
France				
Obligations et billets de sociétés	0	5 800	0	5 800
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	8 530	0	8 530
Irlande				
Titres adossés à des actifs	0	16 555	0	16 555
Obligations et billets de sociétés	0	4 006	0	4 006
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	1 585	0	1 585
Israël				
Émissions souveraines	0	680	0	680
Japon				
Titres adossés à des actifs	0	1 506	0	1 506
Obligations et billets de sociétés	0	24 273	0	24 273
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	9 458	0	9 458
Singapour				
Obligations et billets de sociétés	0	3 678	0	3 678
Corée du Sud				
Obligations et billets de sociétés	0	3 479	0	3 479
Émissions souveraines	0	948	0	948
Espagne				
Obligations et billets de sociétés	0	542	0	542
Suède				
Obligations et billets de sociétés	0	2 686	0	2 686
Suisse				
Obligations et billets de sociétés	0	10 570	0	10 570
Émirats arabes unis				
Obligations et billets de sociétés	0	4 061	0	4 061
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	11 229	0	11 229
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	39 625	0	39 625
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	41 446	0	41 446
Obligations et billets de sociétés	0	73 204	0	73 204
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	26 672	0	26 672
Organismes gouvernementaux américains	0	6 997	0	6 997
Instruments à court terme				
Billets de trésorerie	0	110 068	0	110 068
Prises en pension	0	25 455	0	25 455
Bons du Trésor d'Israël	0	4 136	0	4 136
Bons du Trésor des États-Unis	0	697	0	697
<b>Total - Placements</b>	<b>0 \$</b>	<b>532 970 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>532 970 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Hors cote	0 \$	461 \$	0 \$	461 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Hors cote	0 \$	(3 415) \$	0 \$	(3 415) \$
<b>Total - Instruments financiers dérivés</b>	<b>0 \$</b>	<b>(2 954) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(2 954) \$</b>
<b>Totaux</b>	<b>0 \$</b>	<b>530 016 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>530 016 \$</b>

Il n'y a eu aucun transfert significatif entre les niveaux 1, 2 ou 3 pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

#### CONCENTRATION DU PORTEFEUILLE

Le portefeuille de placements du Fonds est concentré dans les segments suivants :

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Australie	3,3 %	3,6 %
Canada	7,6 %	4,7 %
Îles Caimans	7,6 %	8,2 %
Danemark	0,9 %	0,8 %
Finlande	0,0 %	0,5 %
France	2,1 %	1,1 %

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Allemagne	0,0 %	1,6 %
Irlande	5,0 %	4,1 %
Israël	0,2 %	0,1 %
Japon	2,7 %	4,8 %
Pays-Bas	0,6 %	1,8 %
Norvège	0,8 %	0,0 %
Singapour	0,8 %	0,7 %
Corée du Sud	0,7 %	0,8 %
Espagne	0,8 %	0,1 %
Suède	0,8 %	0,5 %
Suisse	1,5 %	2,0 %
Émirats arabes unis	0,0 %	0,8 %
Royaume-Uni	9,7 %	9,5 %
États-Unis	37,5 %	27,8 %
Instruments à court terme	17,2 %	26,3 %
Instruments financiers dérivés	1,9 %	(0,5) %
Passifs, moins les autres actifs	(1,7) %	0,7 %
Total (%de l'actif net)	100,0 %	100,0 %

## RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

### RISQUE DE CHANGE

Les tableaux ci-dessous indiquent l'exposition globale au risque de change, sauf celui afférent à la monnaie fonctionnelle du Fonds.

Au 31 décembre 2023	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Dollar australien	33 186 \$	(33 015) \$	171 \$	Dollar australien	56 028 \$	(56 295) \$	(267) \$
Livre sterling	23 921	(23 757)	164	Livre sterling	40 012	(39 623)	389
Euro	16 302	(16 163)	139	Euro	18 340	(18 367)	(27)
Shekel israélien	678	(661)	17	Shekel israélien	4 817	(4 864)	(47)
Peso mexicain	5	0	5	Peso mexicain	4	0	4
Dollar américain	332 909	(327 509)	5 400	Dollar américain	397 352	(392 331)	5 021
	407 001 \$	(401 105) \$	5 896 \$		516 553 \$	(511 480) \$	5 073 \$

Les tableaux ci-dessous résument le risque de change lié aux séries en \$ US, couvertes, qui est compensé par des contrats de change à terme.

Au 31 décembre 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, en \$ US, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en \$ US, série couverte	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, en \$ US, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en \$ US, série couverte	Exposition nette
	32 159 \$	(32 120) \$	39 \$		42 733 \$	(42 787) \$	(54) \$

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport aux autres monnaies, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 295 \$ (254 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport au dollar américain, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables des séries couvertes aurait diminué ou augmenté d'environ 2 \$ [(2) \$ au 31 décembre 2022]. Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

## RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt. Ils incluent les instruments financiers du Fonds à la juste valeur, classés en fonction de la date d'échéance. Certains actifs ou passifs figurant dans l'état de la situation financière, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, ont été regroupés pour permettre la présentation ci-dessous.

<b>Actif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	104 749 \$	80 562 \$	133 983 \$	110 300 \$	0 \$	429 594 \$
Instruments financiers dérivés	10 750	0	0	0	0	10 750
Trésorerie et devises	0	0	0	0	1 152	1 152
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	1 701	1 701
Montants à recevoir	0	0	0	0	2 770	2 770
Autres actifs	0	0	0	0	1	1
<b>Total - Actif</b>	<b>115 499 \$</b>	<b>80 562 \$</b>	<b>133 983 \$</b>	<b>110 300 \$</b>	<b>5 624 \$</b>	<b>445 968 \$</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	(2 451) \$	(2) \$	0 \$	0 \$	(28) \$	(2 481) \$
Découvert – montant à payer au dépositaire	0	0	0	0	(10 701)	(10 701)
Montants à payer	0	0	0	0	(2 343)	(2 343)
<b>Total - Passif</b>	<b>(2 451) \$</b>	<b>(2) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(13 072) \$</b>	<b>(15 525) \$</b>

  

<b>Actif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	165 777 \$	71 835 \$	134 447 \$	160 911 \$	0 \$	532 970 \$
Instruments financiers dérivés	431	30	0	0	0	461
Trésorerie et devises	0	0	0	0	1 414	1 414
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	2 261	2 261
Montants à recevoir	0	0	0	0	2 124	2 124
Autres actifs	0	0	0	0	1	1
<b>Total - Actif</b>	<b>166 208 \$</b>	<b>71 865 \$</b>	<b>134 447 \$</b>	<b>160 911 \$</b>	<b>5 800 \$</b>	<b>539 231 \$</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	(3 415) \$	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	(3 415) \$
Découvert – montant à payer au dépositaire	0	0	0	0	(1)	(1)
Montants à payer	0	0	0	0	(1 822)	(1 822)
<b>Total - Passif</b>	<b>(3 415) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(1 823) \$</b>	<b>(5 238) \$</b>

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si les taux d'intérêt en vigueur avaient progressé ou reculé de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 221 \$ ou 0,1 % (1 879 \$, ou 0,4 %, au 31 décembre 2022). La sensibilité du Fonds à la variation des taux d'intérêt a été estimée d'après la durée moyenne pondérée des instruments de créance. Dans les faits, les résultats des opérations peuvent différer et la différence peut être importante.

## AUTRE RISQUE DE PRIX

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'était pas exposé à l'autre risque de prix de façon importante, car il détenait surtout des titres de créance.

RISQUE DE LIQUIDITÉ

Les tableaux ci-dessous font état des passifs du Fonds, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, par date de paiement contractuel : moins de trois mois, de trois mois à un an ou plus d'un an, selon le cas.

<b>Passif courant au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	2 479 \$	2 \$	0 \$	2 481 \$
Dépôts de contreparties	10 701	0	0	10 701
Montants à payer pour les parts rachetées	410	0	0	410
Distributions à payer	1 839	0	0	1 839
Frais de gestion à payer	94	0	0	94
<b>Total - Passif</b>	<b>15 523 \$</b>	<b>2 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>15 525 \$</b>

  

<b>Passif courant au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	3 415 \$	0 \$	0 \$	3 415 \$
Montants à payer pour les parts rachetées	254	0	0	254
Distributions à payer	1 363	0	0	1 363
Découvert - montant à payer au dépositaire	1	0	0	1
Frais de gestion à payer	205	0	0	205
<b>Total - Passif</b>	<b>5 238 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>5 238 \$</b>

RISQUE DE CRÉDIT

Les tableaux ci-dessous résument la composition des notations des instruments financiers du Fonds.

	<b>Au 31 décembre 2023</b>	<b>Au 31 décembre 2022</b>
Catégorie investissement	100 %	100 %
Inférieur à la catégorie investissement	0 %	0 %
Sans notation	0 %	0 %
Total (% des placements et des instruments financiers dérivés)	100 %	100 %

Les notations sont fournies par Standard & Poor's Ratings Services (S&P), Moody's Investors Services, Inc. (Moody's), Fitch Ratings, Inc. (Fitch) ou DBRS Limited (DBRS). Lorsqu'il existe plus d'une notation pour un titre, la plus élevée a été retenue. Si la notation d'un instrument n'est pas fournie par l'une de ces agences, un titre reçoit une notation interne. Les notations inférieures à la catégorie investissement sont celles inférieures à Baa3 selon Moody's, à BAA- selon la notation interne, à BBB- selon S&P et Fitch, et à BBBL selon DBRS.

## États de la situation financière Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 déc. 2023	31 déc. 2022
<b>Actif :</b>		
Actif courant :		
<i>Placements, à la juste valeur</i>		
Placements dans des titres <sup>†</sup>	512 093 USD	591 810 USD
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	190	214
Hors cote	7 611	802
Trésorerie	1 297	3 526
Dépôts auprès de contreparties	4 878	9 662
Devises	388	225
Montants à recevoir pour les placements vendus	174 415	111 174
Montants à recevoir au titre du revenu provenant de swaps	1	1
Montants à recevoir pour les parts vendues	95	823
Intérêts et dividendes à recevoir	1 653	1 894
	702 621	720 131
<b>Passif :</b>		
Passif courant :		
<i>Emprunts et autres opérations de financement</i>		
Montant à payer pour les ventes à découvert, à la juste valeur	1 842	545
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	42	77
Hors cote	1 306	3 969
Achats de placements à payer	365 976	276 181
Montant à payer pour les engagements de prêts non financés	0	31
Dépôts de contreparties	12 208	862
Montants à payer pour les parts rachetées	33	365
Distributions à payer	141	486
Frais de gestion à payer	142	232
	381 690	282 748
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>320 931 USD</b>	<b>437 383 USD</b>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A (\$ US)	1 267 USD	1 320 USD
Nombre de parts rachetables - série A (\$ US)	133	139
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A (\$ US)	9,55 USD	9,52 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F (\$ US)	2 290 USD	3 243 USD
Nombre de parts rachetables - série F (\$ US)	240	341
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F (\$ US)	9,55 USD	9,52 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I (\$ US)	11 USD	10 507 USD
Nombre de parts rachetables - série I (\$ US)	1	1 103
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I (\$ US)	9,55 USD	9,52 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série M (\$ US)	20 156 USD	20 964 USD
Nombre de parts rachetables - série M (\$ US)	2 110	2 203
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série M (\$ US)	9,55 USD	9,52 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série O (\$ US)	2 157 USD	3 349 USD
Nombre de parts rachetables - série O (\$ US)	226	352
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série O (\$ US)	9,55 USD	9,52 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A	6 619 USD	9 132 USD
Nombre de parts rachetables - série A	943	1 326
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	7,02 USD	6,89 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	9,31 \$	9,33 \$

## États de la situation financière Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) (suite)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F	51 451 USD	88 591 USD
Nombre de parts rachetables - série F	7 329	12 861
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	7,02 USD	6,89 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	9,30 \$	9,33 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I	109 990 USD	76 663 USD
Nombre de parts rachetables - série I	15 662	11 130
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	7,02 USD	6,89 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	9,31 \$	9,33 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série M	93 207 USD	169 161 USD
Nombre de parts rachetables - série M	13 269	24 559
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série M	7,02 USD	6,89 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série M	9,31 \$	9,33 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série O	24 569 USD	35 047 USD
Nombre de parts rachetables - série O	3 498	5 088
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série O	7,02 USD	6,89 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série O	9,31 \$	9,33 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série FNB	9 214 USD	19 406 USD
Nombre de parts rachetables - série FNB	650	1 400
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série FNB	14,17 USD	13,86 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série FNB	18,78 \$	18,77 \$
† Comprend les prises en pension de :	96 400 USD	204 128 USD

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États du résultat global Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Revenus :</b>		
<b>Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés</b>		
Intérêts à distribuer	14 198 USD	11 444 USD
Revenu (perte) sur instruments dérivés	4 656	1 458
Gain (perte) net réalisé à la vente de placements	(8 578)	(11 806)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	1 386	1 003
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés hors cote	(1 481)	(10 400)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	11 765	(16 914)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(682)	8 740
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés hors cote	9 473	(5 164)
Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés	30 737	(21 639)
<b>Autres revenus (pertes)</b>		
Gain (perte) net réalisé sur opérations en devises	204	534
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente à la conversion des actifs et des passifs libellés en devises	(22)	(42)
Autres revenus (pertes)	182	492
Total - Revenus (pertes)	30 919	(21 147)
<b>Charges :</b>		
Frais de gestion	1 612	1 917
Frais liés au CEI	2	1
Charges d'intérêts	163	33
Coûts de transaction	4	2
Total - Charges	1 781	1 953
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	29 138 USD	(23 100) USD
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série</b>		
Série A (\$ US)	63 USD	(51) USD
Série F (\$ US)	148	(58)
Série I (\$ US)	12	(773)
Série M (\$ US)	1 434	(803)
Série O (\$ US)	153	(451)
Série A	491	(953)
Série F	3 868	(1 631)
Série I	9 551	(3 163)
Série M	10 299	(10 903)
Série O	2 062	(3 613)
Série FNB	1 057	(701)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part</b>		
Série A (\$ US)	0,52 USD	(0,37) USD
Série F (\$ US)	0,60	(0,23)
Série I (\$ US)	1,19	(0,58)
Série M (\$ US)	0,59	(0,36)
Série O (\$ US)	0,59	(0,50)
Série A	0,50	(0,73)
Série F	0,81	(0,38)
Série I	0,68	(0,45)
Série M	0,74	(0,66)
Série O	0,49	(0,79)
Série FNB	1,66	(1,32)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

	Exercice clos le 31 déc. 2023				
	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Série I (\$ US)	Série M (\$ US)	Série O (\$ US)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	1 320 USD	3 243 USD	10 507 USD	20 964 USD	3 349 USD
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	63	148	12	1 434	153
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>					
Provenant du revenu net de placement	(61)	(139)	(1)	(1 424)	(136)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(61)	(139)	(1)	(1 424)	(136)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>					
Produit de la vente de parts rachetables	470	2 238	0	23 981	2 299
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	58	126	1	1 217	132
Coût des parts rachetables rachetées	(583)	(3 326)	(10 508)	(26 016)	(3 640)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(55)	(962)	(10 507)	(818)	(1 209)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(53)	(953)	(10 496)	(808)	(1 192)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	1 267 USD	2 290 USD	11 USD	20 156 USD	2 157 USD
<b>Transactions sur parts rachetables</b>					
Parts rachetables vendues	50	237	1	2 526	246
Parts émises au réinvestissement des distributions	6	13	0	129	14
Parts rachetables rachetées	(62)	(351)	(1 103)	(2 748)	(386)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(6)	(101)	(1 102)	(93)	(126)
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	139	341	1 103	2 203	352
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	133	240	1	2 110	226

	Exercice clos le 31 déc. 2022				
	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Série I (\$ US)	Série M (\$ US)	Série O (\$ US)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	1 467 USD	2 321 USD	23 347 USD	30 040 USD	15 912 USD
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(51)	(58)	(773)	(803)	(451)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>					
Provenant du revenu net de placement	(45)	(105)	(563)	(870)	(278)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(45)	(105)	(563)	(870)	(278)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>					
Produit de la vente de parts rachetables	1 189	4 223	10 434	24 026	2 731
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	45	94	544	757	270
Coût des parts rachetables rachetées	(1 285)	(3 232)	(22 482)	(32 186)	(14 835)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(51)	1 085	(11 504)	(7 403)	(11 834)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(147)	922	(12 840)	(9 076)	(12 563)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	1 320 USD	3 243 USD	10 507 USD	20 964 USD	3 349 USD
<b>Transactions sur parts rachetables</b>					
Parts rachetables vendues	121	437	1 087	2 482	277
Parts émises au réinvestissement des distributions	5	10	56	78	28
Parts rachetables rachetées	(131)	(333)	(2 324)	(3 296)	(1 510)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(5)	114	(1 181)	(736)	(1 205)
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	144	227	2 284	2 939	1 557
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	139	341	1 103	2 203	352

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

**Exercice clos le 31 déc. 2023**

Série A	Série F	Série I	Série M	Série O	Série FNB	Total
9 132 USD	88 591 USD	76 663 USD	169 161 USD	35 047 USD	19 406 USD	437 383 USD
491	3 868	9 551	10 299	2 062	1 057	29 138
(363)	(1 899)	(6 575)	(5 722)	(1 617)	(490)	(18 427)
(363)	(1 899)	(6 575)	(5 722)	(1 617)	(490)	(18 427)
4 871	46 197	81 281	100 023	12 960	5 481	279 801
315	1 573	4 778	4 723	1 323	0	14 246
(7 827)	(86 879)	(55 708)	(185 277)	(25 206)	(16 240)	(421 210)
(2 641)	(39 109)	30 351	(80 531)	(10 923)	(10 759)	(127 163)
(2 513)	(37 140)	33 327	(75 954)	(10 478)	(10 192)	(116 452)
6 619 USD	51 451 USD	109 990 USD	93 207 USD	24 569 USD	9 214 USD	320 931 USD
713	6 800	11 928	14 666	1 877	400	S.O.
46	229	699	689	193	0	S.O.
(1 142)	(12 561)	(8 095)	(26 645)	(3 660)	(1 150)	S.O.
(383)	(5 532)	4 532	(11 290)	(1 590)	(750)	S.O.
1 326	12 861	11 130	24 559	5 088	1 400	S.O.
943	7 329	15 662	13 269	3 498	650	S.O.

**Exercice clos le 31 déc. 2022**

Série A	Série F	Série I	Série M	Série O	Série FNB	Total
12 066 USD	25 684 USD	42 717 USD	116 823 USD	30 179 USD	6 333 USD	306 889 USD
(953)	(1 631)	(3 163)	(10 903)	(3 613)	(701)	(23 100)
(329)	(1 896)	(2 949)	(5 850)	(1 305)	(315)	(14 505)
(329)	(1 896)	(2 949)	(5 850)	(1 305)	(315)	(14 505)
15 338	134 700	90 465	195 024	42 480	17 774	538 384
288	1 505	2 948	3 084	1 120	0	10 655
(17 278)	(69 771)	(53 355)	(129 017)	(33 814)	(3 685)	(380 940)
(1 652)	66 434	40 058	69 091	9 786	14 089	168 099
(2 934)	62 907	33 946	52 338	4 868	13 073	130 494
9 132 USD	88 591 USD	76 663 USD	169 161 USD	35 047 USD	19 406 USD	437 383 USD
2 034	19 160	12 571	27 352	5 783	1 250	S.O.
40	214	415	436	157	0	S.O.
(2 266)	(9 745)	(7 232)	(17 930)	(4 650)	(250)	S.O.
(192)	9 629	5 754	9 858	1 290	1 000	S.O.
1 518	3 232	5 376	14 701	3 798	400	S.O.
1 326	12 861	11 130	24 559	5 088	1 400	S.O.

## Tableaux des flux de trésorerie Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)

(en milliers*)	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	29 138 USD	(23 100) USD
<b>Ajustements au titre du rapprochement de l'augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et des entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation :</b>		
Achats de titres	(10 311 693)	(10 487 879)
Produit de la vente de placements	10 421 581	10 333 324
(Augmentation) diminution des dépôts auprès de contreparties	4 784	(6 337)
(Augmentation) diminution des montants à recevoir au titre du revenu provenant de swaps	0	(1)
(Augmentation) diminution des intérêts et des dividendes à recevoir	241	(436)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	693	9 535
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés hors cote	(1 480)	(10 336)
Augmentation (diminution) des dépôts de contreparties	11 346	222
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(90)	52
Produit des opérations de vente à découvert	268 613	146 333
Paiements au titre des opérations de vente à découvert	(267 359)	(145 784)
Produit (paiements) au titre des opérations en devises	194	483
<i>(Gain) perte nette réalisée</i>		
Placements	8 578	11 806
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(1 386)	(1 003)
Instruments financiers dérivés hors cote	1 481	10 400
Opérations en devises	(204)	(534)
<i>Variation nette de la (plus-value) moins-value latente</i>		
Placements	(11 765)	16 914
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	682	(8 740)
Instruments financiers dérivés hors cote	(9 473)	5 164
Conversion de passifs et d'actifs libellés en devises	22	42
Amortissement net des primes (des escomptes) sur les placements	(418)	67
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation</b>	<b>143 485</b>	<b>(149 808)</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement :</b>		
Produit de la vente de parts rachetables**	172 513	492 769
Montant payé au titre du rachat de parts rachetables**	(313 526)	(337 235)
Distributions en trésorerie versées aux porteurs de parts rachetables	(4 526)	(3 518)
Produit des accords cadres sur transactions à livrer	42 408	15 659
Paiements au titre des accords cadres sur transactions à livrer	(42 408)	(15 659)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement</b>	<b>(145 539)</b>	<b>152 016</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des devises</b>	<b>(2 054)</b>	<b>2 208</b>
<b>Trésorerie (découvert) et devises :</b>		
Ouverture de l'exercice	3 751	1 534
Gain (perte) de change sur la trésorerie	(12)	9
Clôture de l'exercice	1 685 USD	3 751 USD
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie :</b>		
Intérêts payés liés aux activités de financement	132 USD	31 USD
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	14 022 USD	11 081 USD

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

\*\* Ne comprend pas les transferts hors trésorerie entre les séries.

(en milliers\*, sauf le nombre d'actions, de contrats, de parts ou d'onces, selon le cas)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES 159,6 %</b>						
<b>ARGENTINE 0,3 %</b>						
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,3 %</b>						
<b>Obligations internationales du gouvernement de l'Argentine</b>						
0,750 %, échéant le 9 juill. 2030	26 USD	14 USD	10 USD			
3,500 %, échéant le 9 juill. 2041	102	42	35			
3,625 %, échéant le 9 juill. 2035	1 858	724	634			
4,250 %, échéant le 9 janv. 2038	300	132	119			
<b>Provincia de Buenos Aires</b>						
129,126 %, échéant le 12 avr. 2025	80 ARS	1	0			
Total - Argentine		913	798			
<b>AUSTRALIE 0,0 %</b>						
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,0 %</b>						
<b>Obligations internationales du gouvernement de l'Australie</b>						
1,750 %, échéant le 21 juin 2051	100 AUD	68	40			
Total - Australie		68	40			
<b>CANADA 0,0 %</b>						
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 0,0 %</b>						
<b>Fiducie de liquidité sur actifs immobiliers</b>						
1,162 %, échéant le 12 févr. 2055 <sup>a)</sup>	253 \$	8	7			
3,641 %, échéant le 14 juin 2061	32	24	24			
Total - Canada		32	31			
<b>ÎLES CAÏMANS 3,3 %</b>						
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 2,8 %</b>						
<b>Anchorage Capital CLO Ltd.</b>						
6,705 %, échéant le 15 juill. 2030	167 USD	166	167			
<b>Apidos CLO</b>						
6,875 %, échéant le 15 avr. 2033	1 000	983	999			
<b>Elevation CLO Ltd.</b>						
6,877 %, échéant le 20 oct. 2034	3 000	2 990	2 985			
<b>Halseypoint CLO Ltd.</b>						
7,102 %, échéant le 30 nov. 2032	500	494	500			
<b>Hildene TruPS Securitization Ltd.</b>						
7,393 %, échéant le 22 mai 2039	205	205	200			
<b>LCM Loan Income Fund Ltd.</b>						
6,707 %, échéant le 20 avr. 2031	1 314	1 307	1 313			
<b>LCM Ltd.</b>						
6,757 %, échéant le 20 avr. 2031	500	491	499			
<b>M360 Ltd.</b>						
6,971 %, échéant le 22 nov. 2038	1 829	1 766	1 804			
<b>Octagon Investment Partners Ltd.</b>						
6,639 %, échéant le 14 févr. 2031	410	401	409			
<b>Venture CLO Ltd.</b>						
6,697 %, échéant le 20 avr. 2029	66	66	66			
		8 869	8 942			
<b>PRÊTS AVEC PARTICIPATION ET CESSION 0,5 %</b>						
<b>American Airlines, Inc.</b>						
10,427 %, échéant le 20 avr. 2028	1 440	1 490	1 482			
Total - Îles Caïmans		10 359	10 424			
<b>FRANCE 1,2 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,2 %</b>						
<b>Altice France SA</b>						
8,125 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2027	300 USD	328 USD	277 USD			
<b>BPCE SA</b>						
6,612 %, échéant le 19 oct. 2027	2 200	2 200	2 266			
<b>Société Générale SA</b>						
6,447 %, échéant le 12 janv. 2027	1 300	1 300	1 323			
Total - France		3 828	3 866			
<b>ALLEMAGNE 0,4 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,4 %</b>						
<b>Deutsche Bank AG</b>						
6,720 %, échéant le 18 janv. 2029	200 USD	195	210			
6,819 %, échéant le 20 nov. 2029	1 000	1 000	1 053			
Total - Allemagne		1 195	1 263			
<b>IRLANDE 3,2 %</b>						
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 1,3 %</b>						
<b>Dryden Euro CLO BV</b>						
4,715 %, échéant le 15 juill. 2032	929 EUR	921	1 016			
<b>Dryden Euro CLO DAC</b>						
4,775 %, échéant le 15 janv. 2032	1 749	1 748	1 916			
<b>Palmer Square European Loan Funding</b>						
5,602 %, échéant le 15 nov. 2032	965	1 018	1 065			
		3 687	3 997			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 1,9 %</b>						
<b>Glenbeigh 2 Issuer DAC</b>						
4,666 %, échéant le 24 mars 2046	1 824	1 918	2 013			
4,666 %, échéant le 24 juin 2050	1 602	1 684	1 768			
<b>Kinbane DAC</b>						
4,685 %, échéant le 25 sept. 2062	2 180	2 153	2 385			
		5 755	6 166			
Total - Irlande		9 442	10 163			
<b>ISRAËL 1,1 %</b>						
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 1,1 %</b>						
<b>Obligation internationale du gouvernement d'Israël</b>						
5,000 %, échéant le 30 oct. 2026	3 200 EUR	3 358	3 615			
Total - Israël		3 358	3 615			
<b>ITALIE 0,5 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>						
<b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b>						
1,875 %, échéant le 9 janv. 2026	1 575 EUR	1 527	1 654			
Total - Italie		1 527	1 654			
<b>JAPON 0,3 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,3 %</b>						
<b>Nissan Motor Co. Ltd.</b>						
4,345 %, échéant le 17 sept. 2027	430 USD	472	412			
4,810 %, échéant le 17 sept. 2030	700	778	655			
Total - Japon		1 250	1 067			

## Inventaire du portefeuille Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) (suite)

ACTIONS	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)	
<b>LUXEMBOURG 1,0 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,0 %</b>			
ADLER Group SA <sup>d</sup>	7 032	0 USD	4 USD
ADLER Group SA	15 570	0	9
Intelsat Emergence SA <sup>d</sup>	4 263	238	121
		<u>238</u>	<u>134</u>
	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)		
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,0 %</b>			
Adler Financing SARL (12,500 % en titres à rendement réinvesti) 12,500 %, échéant le 30 juin 2025 <sup>b</sup>	626 EUR	641	729
Bevco Lux SARL 1,000 %, échéant le 16 janv. 2030	1 700	2 049	1 575
Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 4,950 %, échéant le 6 févr. 2028	850	969	591
Intelsat Jackson Holdings SA 6,500 %, échéant le 15 mars 2030	318	310	304
		<u>3 969</u>	<u>3 199</u>
Total - Luxembourg		<u>4 207</u>	<u>3 333</u>
<b>MEXICO 0,6 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,4 %</b>			
Petroleos Mexicanos 6,700 %, échéant le 16 févr. 2032	1 420 USD	1 422	1 180
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,2 %</b>			
Obligations internationales du gouvernement du Mexique 2,750 %, échéant le 27 nov. 2031 <sup>h</sup>	9 581 MXN	480	498
3,000 %, échéant le 3 déc. 2026 <sup>l</sup>	1 597	87	88
		<u>567</u>	<u>586</u>
Total - Mexique		<u>1 989</u>	<u>1 766</u>
<b>PAYS-BAS 1,1 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,1 %</b>			
Cooperatieve Rabobank UA 4,655 %, échéant le 22 août 2028	1 500 USD	1 445	1 478
CTP NV 1,250 %, échéant le 21 juin 2029	1 000 EUR	1 196	917
Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 %, échéant le 18 mars 2033	1 133	1 340	981
Total - Pays-Bas		<u>3 981</u>	<u>3 376</u>
<b>PÉROU 0,0 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,0 %</b>			
Obligations internationales du gouvernement du Pérou 5,400 %, échéant le 12 août 2034	1 PEN	0	0
Total - Pérou		<u>0</u>	<u>0</u>
<b>ROUMANIE 0,2 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,2 %</b>			
Obligations internationales du gouvernement de la Roumanie 5,500 %, échéant le 18 sept. 2028	600 EUR	645	682
Total - Roumanie		<u>645</u>	<u>682</u>

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>RUSSIE 0,6 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,6 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement de la Russie</b>			
4,250 %, échéant le 23 juin 2027 <sup>^</sup>	800 USD	449 USD	516 USD
4,750 %, échéant le 27 mai 2026 <sup>^</sup>	800	449	564
5,250 %, échéant le 23 juin 2047 <sup>^</sup>	1 400	786	497
5,625 %, échéant le 4 avr. 2042 <sup>^</sup>	400	224	268
7,150 %, échéant le 12 nov. 2025 <sup>^</sup>	985 RUB	16	5
7,950 %, échéant le 7 oct. 2026 <sup>^</sup>	654	12	3
Total - Russie		<u>1 936</u>	<u>1 853</u>
<b>AFRIQUE DU SUD 0,3 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,3 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement de l'Afrique du Sud</b>			
10,500 %, échéant le 21 déc. 2026	17 600 ZAR	1 398	1 007
Total - Afrique du Sud		<u>1 398</u>	<u>1 007</u>
<b>ESPAGNE 1,0 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,0 %</b>			
Banco Santander SA 4,250 %, échéant le 11 avr. 2027	1 400 USD	1 330	1 357
4,379 %, échéant le 12 avr. 2028	1 600	1 503	1 556
CaixaBank SA 6,684 %, échéant le 13 sept. 2027	400	400	410
Total - Espagne		<u>3 233</u>	<u>3 323</u>
<b>SUISSE 1,1 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,1 %</b>			
UBS Group AG 5,959 %, échéant le 12 janv. 2034	370 USD	370	383
6,327 %, échéant le 22 déc. 2027	1 400	1 400	1 444
6,373 %, échéant le 15 juill. 2026	600	600	607
6,442 %, échéant le 11 août 2028	950	950	987
Total - Suisse		<u>3 320</u>	<u>3 421</u>
<b>TURQUIE 0,1 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,1 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement de la Turquie</b>			
4,250 %, échéant le 13 mars 2025	200 USD	198	197
Total - Turquie		<u>198</u>	<u>197</u>
<b>ROYAUME-UNI 7,4 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,8 %</b>			
Agps Bondco PLC 5,000 %, échéant le 27 avr. 2027	900 EUR	1 068	335
Barclays PLC 4,972 %, échéant le 16 mai 2029	400 USD	383	393
6,224 %, échéant le 9 mai 2034	546	546	567
6,496 %, échéant le 13 sept. 2027	600	600	617
7,437 %, échéant le 2 nov. 2033	200	217	224
HSBC Holdings PLC 4,041 %, échéant le 13 mars 2028	1 500	1 423	1 446
Market Bidco Finco PLC 4,750 %, échéant le 4 nov. 2027	500 EUR	458	496
Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 %, échéant le 15 déc. 2030	67 GBP	100	81
Nationwide Building Society 6,557 %, échéant le 18 oct. 2027	1 500 USD	1 525	1 554
Santander U.K. Group Holdings PLC 7,482 %, échéant le 29 août 2029	100 GBP	127	139
		<u>6 447</u>	<u>5 852</u>

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PRÊTS AVEC PARTICIPATION ET CESSION 0,6 %</b>			
<b>Poseidon Bidco SASU</b>			
9,175 %, échéant le 30 sept. 2028	1 100 EUR	937 USD	1 216 USD
<b>Softbank Vision Fund</b>			
5,000 %, échéant le 21 déc. 2025	635 USD	635	606
		1 572	1 822
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 5,0 %</b>			
<b>Canada Square Funding PLC</b>			
6,170 %, échéant le 17 juin 2058	4 373 GBP	5 156	5 568
<b>Great Hall Mortgages PLC</b>			
5,469 %, échéant le 18 mars 2039	19	24	24
5,489 %, échéant le 18 juin 2038	22	29	29
<b>Lanebrook Mortgage Transaction PLC</b>			
7,070 %, échéant le 12 juin 2057	718	915	918
<b>Mortimer BTL PLC</b>			
6,369 %, échéant le 22 déc. 2056	1 200	1 499	1 533
<b>Precise Mortgage Funding PLC</b>			
6,126 %, échéant le 16 oct. 2056	128	167	163
<b>Temple Quay No. 1 PLC</b>			
6,720 %, échéant le 24 juill. 2085	3 937	4 563	5 023
<b>Warwick Finance Residential Mortgages PLC</b>			
6,870 %, échéant le 21 déc. 2049	2 261	2 727	2 858
		15 080	16 116
Total - Royaume-Uni		23 099	23 790
<b>ÉTATS-UNIS 100,5 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 11,9 %</b>			
<b>ABFC Trust</b>			
6,415 %, échéant le 25 juill. 2034	152 USD	146	152
<b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>			
5,770 %, échéant le 25 juill. 2036	1 331	634	439
6,400 %, échéant le 25 nov. 2034	1 082	1 041	1 073
6,505 %, échéant le 25 oct. 2034	3 006	2 795	2 840
<b>Argent Securities Trust</b>			
5,850 %, échéant le 25 mars 2036	104	97	93
<b>Argent Securities, Inc., certificats à flux identiques adossés à des actifs</b>			
4,230 %, échéant le 25 oct. 2034	152	141	148
<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>			
6,051 %, échéant le 25 déc. 2034	139	133	140
6,670 %, échéant le 25 juin 2036	1 000	977	983
<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>			
5,764 %, échéant le 25 janv. 2037	284	193	117
<b>Ellington Loan Acquisition Trust</b>			
6,570 %, échéant le 25 mai 2037	1 186	1 186	1 143
<b>Fremont Home Loan Trust</b>			
5,790 %, échéant le 25 mai 2036	3 628	2 817	2 117
<b>GSAA Home Equity Trust</b>			
4,468 %, échéant le 25 août 2034	77	75	70
<b>GSAMP Trust</b>			
5,540 %, échéant le 25 déc. 2036	201	124	95
<b>Home Equity Asset Trust</b>			
6,715 %, échéant le 25 mai 2035	5 292	4 868	5 044
<b>LCCM Trust</b>			
6,926 %, échéant le 15 nov. 2038	2 900	2 900	2 881
<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>			
6,070 %, échéant le 25 janv. 2036	826	783	771
6,445 %, échéant le 25 oct. 2034	122	117	120

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b>			
6,190 %, échéant le 25 déc. 2034	706 USD	656 USD	658 USD
6,250 %, échéant le 25 févr. 2034	196	181	197
<b>MF1 LLC</b>			
7,506 %, échéant le 19 juin 2037	600	594	599
<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>			
5,950 %, échéant le 25 sept. 2036	1 953	1 068	695
6,040 %, échéant le 25 déc. 2035	1 300	1 161	1 053
6,280 %, échéant le 25 avr. 2034	387	358	382
6,370 %, échéant le 25 août 2034	1 183	1 105	1 158
6,490 %, échéant le 25 janv. 2035	1 505	1 354	1 469
<b>New Century Home Equity Loan Trust</b>			
6,595 %, échéant le 25 oct. 2033	842	840	835
<b>Pagaya AI Debt Selection Trust</b>			
7,128 %, échéant le 16 juin 2031	1 332	1 332	1 335
<b>Pagaya AI Debt Trust</b>			
7,656 %, échéant le 15 mai 2030	500	500	501
<b>People's Choice Home Loan Securities Trust</b>			
6,415 %, échéant le 25 mai 2035	396	354	361
<b>People's Financial Realty Mortgage Securities Trust</b>			
5,610 %, échéant le 25 sept. 2036	570	264	146
<b>PRET LLC</b>			
1,868 %, échéant le 25 juill. 2051	1 577	1 400	1 524
1,992 %, échéant le 25 févr. 2061	2 187	2 187	2 139
<b>Renaissance Home Equity Loan Trust</b>			
4,156 %, échéant le 25 août 2033	282	261	257
<b>Research-Driven Pagaya Motor Asset Trust</b>			
4,320 %, échéant le 25 sept. 2030	1 658	1 658	1 585
<b>SMB Private Education Loan Trust</b>			
6,788 %, échéant le 16 févr. 2055	1 874	1 874	1 873
<b>Specialty Underwriting &amp; Residential Finance Trust</b>			
5,890 %, échéant le 25 nov. 2037	2 458	1 810	1 356
<b>Structured Asset Investment Loan Trust</b>			
6,670 %, échéant le 25 août 2034	439	424	443
<b>Upstart Securitization Trust</b>			
5,500 %, échéant le 20 juin 2032	1 382	1 367	1 357
<b>Wells Fargo Home Equity Trust, certificats à flux identiques de titres hypothécaires</b>			
6,070 %, échéant le 25 avr. 2034	51	48	50
		39 823	38 199
ACTIONS			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,2 %</b>			
Amsurg, titres de capitaux propres <sup>d</sup>	13 345	558	684
Neiman Marcus Group Ltd. LLC <sup>d</sup>	419	13	63
		571	747
OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 7,1 %			
<b>American Airlines, fiducie à flux identiques</b>			
3,375 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2028	575 USD	575	528
3,700 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2028	687	690	640
<b>Bank of America Corp.</b>			
3,419 %, échéant le 20 déc. 2028	1 600	1 417	1 508
3,824 %, échéant le 20 janv. 2028	1 600	1 518	1 538
<b>Carvana Co. (12,000 % en titres à rendement réinvesti)</b>			
12,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2028 <sup>b</sup>	128	142	104
<b>Carvana Co. (13,000 % en titres à rendement réinvesti)</b>			
13,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2030 <sup>b</sup>	469	434	374
<b>Carvana Co. (14,000 % en titres à rendement réinvesti)</b>			
14,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2031 <sup>b</sup>	551	497	445

## Inventaire du portefeuille Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>CDW LLC</b>						
2,670 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2026	2 940 USD	2 940 USD	2 753 USD			
Credit Suisse AG AT1 Claim	2 600	0	312			
<b>CVS Pass-Through Trust</b>						
5,789 %, échéant le 10 janv. 2026	277	299	277			
<b>Morgan Stanley</b>						
5,123 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2029	1 100	1 084	1 106			
<b>Navient Corp.</b>						
5,625 %, échéant le 25 janv. 2025	36	30	34			
<b>Nissan Motor Acceptance Co. LLC</b>						
2,000 %, échéant le 9 mars 2026	1 800	1 811	1 655			
<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>						
3,250 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2031	1 101	1 072	955			
3,400 %, échéant le 15 août 2024	5	4	5			
3,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juill. 2028	41	38	38			
4,450 %, échéant le 15 avr. 2042	200	223	162			
4,500 %, échéant le 15 déc. 2041	553	559	434			
4,550 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juill. 2030	1 047	1 144	998			
4,950 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juill. 2050	44	48	38			
5,450 %, échéant le 15 juin 2027	2 445	2 399	2 466			
<b>Prime Healthcare Services, Inc.</b>						
7,250 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2025	2 012	2 161	1 964			
<b>RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.</b>						
9,750 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2026	1 700	1 832	1 688			
<b>Topaz Solar Farms LLC</b>						
4,875 %, échéant le 30 sept. 2039	1	1	1			
<b>U.S. Renal Care, Inc.</b>						
10,625 %, échéant le 28 juin 2028	1	0	1			
<b>Uniti Group LP</b>						
10,500 %, échéant le 15 févr. 2028	312	312	317			
<b>Venture Global Calcasieu Pass LLC</b>						
3,875 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2033	400	400	339			
<b>Venture Global LNG, Inc.</b>						
8,125 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2028	200	200	202			
8,375 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2031	200	200	200			
9,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2029	450	450	476			
9,875 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2032	150	149	156			
<b>VICI Properties LP</b>						
4,500 %, échéant le 15 janv. 2028	447	443	427			
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b>						
2,393 %, échéant le 2 juin 2028	600	541	550			
		<u>23 613</u>	<u>22 691</u>			
<b>PRÊTS AVEC PARTICIPATION ET CESSION 1,8 %</b>						
<b>Amsurg</b>						
10,110 %, échéant le 3 nov. 2026	396	396	396			
13,258 %, échéant le 15 sept. 2028	1 305	1 266	1 305			
<b>Emerald TopCo, Inc.</b>						
8,970 %, échéant le 24 juill. 2026	3	3	3			
<b>Lealand Finance Co. BV (6,431 % en trésorerie et 3,000 % en titres à rendement réinvesti)</b>						
9,431 %, échéant le 30 juin 2025 <sup>b)</sup>	1	2	0			
<b>PUG LLC</b>						
8,970 %, échéant le 12 févr. 2027	2	2	2			
<b>Syniverse Holdings, Inc.</b>						
12,348 %, échéant le 13 mai 2027	482	458	427			
<b>TransDigm, Inc.</b>						
8,598 %, échéant le 22 févr. 2027	1 955	1 949	1 966			
8,598 %, échéant le 24 août 2028	418	413	420			
<b>U.S. Renal Care, Inc.</b>						
10,470 %, échéant le 20 juin 2028	84	50	64			
<b>Windstream Services LLC</b>						
11,706 %, échéant le 21 sept. 2027	1 310 USD	1 192 USD	1 243 USD			
		<u>5 731</u>	<u>5 826</u>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 16,0 %</b>						
<b>20 Times Square Trust</b>						
3,100 %, échéant le 15 mai 2035	1 200	1 200	1 064			
<b>225 Liberty Street Trust</b>						
4,501 %, échéant le 10 févr. 2036	400	429	334			
4,649 %, échéant le 10 févr. 2036	850	872	608			
<b>280 Park Avenue Mortgage Trust</b>						
6,538 %, échéant le 15 sept. 2034	500	490	481			
<b>Atrium Hotel Portfolio Trust</b>						
6,589 %, échéant le 15 déc. 2036	484	473	461			
<b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>						
6,595 %, échéant le 25 janv. 2035	192	193	178			
<b>Bear Stearns Mortgage Funding Trust</b>						
5,650 %, échéant le 25 juin 2037	4 357	3 901	4 016			
<b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b>						
4,805 %, échéant le 26 janv. 2036	31	28	23			
<b>CitiMortgage Alternative Loan Trust</b>						
5,750 %, échéant le 25 avr. 2037	60	59	55			
<b>Colony Mortgage Capital Ltd.</b>						
6,953 %, échéant le 15 nov. 2038	900	846	859			
<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>						
6,250 %, échéant le 25 sept. 2037	679	372	362			
<b>Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust</b>						
6,500 %, échéant le 25 mars 2035	90	92	89			
<b>Credit Suisse Mortgage Capital Trust</b>						
1,796 %, échéant le 27 déc. 2060	1 858	1 858	1 810			
3,090 %, échéant le 26 déc. 2059	384	384	384			
8,326 %, échéant le 15 oct. 2037	3 776	3 609	3 557			
<b>DBGS Mortgage Trust</b>						
7,776 %, échéant le 15 oct. 2036	3 030	2 837	2 207			
<b>DROP Mortgage Trust</b>						
0,000 %, échéant le 15 oct. 2043 <sup>a)</sup>	133 713	0	0			
<b>Ellington Financial Mortgage Trust</b>						
5,900 %, échéant le 25 sept. 2067	3 759	3 714	3 760			
<b>GS Mortgage Securities Corp. Trust</b>						
3,924 %, échéant le 10 oct. 2032	900	901	848			
<b>GS Mortgage Securities Trust</b>						
3,805 %, échéant le 10 oct. 2035	150	152	131			
<b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>						
5,880 %, échéant le 19 déc. 2036	347	313	277			
<b>Hilton Orlando Trust</b>						
6,959 %, échéant le 15 déc. 2034	1 600	1 585	1 581			
<b>Impac Secured Assets Trust</b>						
5,990 %, échéant le 25 janv. 2037	2 856	2 717	2 357			
<b>JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b>						
0,000 %, échéant le 15 nov. 2038 <sup>a)</sup>	113 280	0	0			
6,776 %, échéant le 15 mars 2036	1 000	1 000	890			
<b>Lavender Trust</b>						
6,250 %, échéant le 26 oct. 2036	27	21	14			
<b>Legacy Mortgage Asset Trust</b>						
1,991 %, échéant le 25 sept. 2060	130	131	130			
6,250 %, échéant le 25 mai 2060	9 012	8 896	9 010			
<b>LUXE Commercial Mortgage Trust</b>						
7,234 %, échéant le 15 oct. 2038	2 831	2 831	2 800			

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Morgan Stanley Capital Trust</b>				0,625 %, échéant le 15 juill. 2032	2 541 USD	2 399 USD	2 323 USD
5,166 %, échéant le 12 oct. 2052	2 USD	2 USD	2 USD	1,375 %, échéant le 15 juill. 2033	608	565	590
<b>Natixis Commercial Mortgage Securities Trust</b>				1,500 %, échéant le 15 févr. 2053	725	651	658
3,790 %, échéant le 15 nov. 2032	2 980	2 986	2 161	<b>Obligations du Trésor des États-Unis</b>			
<b>New Orleans Hotel Trust</b>				0,375 %, échéant le 30 sept. 2027	110	95	96
6,398 %, échéant le 15 avr. 2032	700	673	676	0,500 %, échéant le 31 oct. 2027	200	172	176
<b>Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust</b>				0,625 %, échéant le 30 nov. 2027	2 300	1 997	2 028
6,610 %, échéant le 25 nov. 2034	926	898	883	0,625 %, échéant le 31 déc. 2027	980	849	862
<b>Nomura Resecuritization Trust</b>				0,750 %, échéant le 31 janv. 2028	850	739	749
6,370 %, échéant le 25 janv. 2037	3 468	3 251	3 248	2,375 %, échéant le 31 mars 2029	3 100	3 075	2 879
<b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>						33 470	32 545
6,250 %, échéant le 25 avr. 2037	1 749	1 747	1 417	Total - États-Unis		329 775	322 541
<b>Fiducie de prêts hypothécaires à taux variable structurés</b>							
4,236 %, échéant le 25 avr. 2047	147	110	70	<b>INSTRUMENTS À COURT TERME 35,4 %</b>			
<b>Fiducie de placements en actifs hypothécaires structurés</b>				<b>PRISES EN PENSION<sup>g)</sup> 30,0 %</b>			
6,010 %, échéant le 25 août 2035	36	34	31			96 400	96 400
<b>Towd Point Mortgage Trust</b>				<b>BILLETTS À COURT TERME 0,0 %</b>			
3,750 %, échéant le 25 sept. 2062	2 357	2 236	2 215	<b>Obligations du Trésor de l'Argentine, BONCER</b>			
6,470 %, échéant le 25 mai 2058	44	44	44	3,750 %, échéant le 20 mai 2024	2 436 ARS	3	3
<b>TTAN</b>				<b>BONS DU TRÉSOR DE LA HONGRIE 0,1 %</b>			
0,000 %, échéant le 15 mars 2038 <sup>a)</sup>	25 500	0	0	10,900 %, échéant le 4 janv. 2024 <sup>d), e)</sup>	140 000 HUF	406	403
<b>Wells Fargo Commercial Mortgage Trust</b>				<b>BONS DU TRÉSOR DU JAPON 4,9 %</b>			
3,038 %, échéant le 15 sept. 2031	1 800	1 791	1 648	(0,257) %, échéant le 4 avr. 2024 <sup>d), e)</sup>	231 000 JPY	1 622	1 639
<b>Worldwide Plaza Trust</b>				(0,252) %, échéant le 26 févr. 2024 <sup>d), e)</sup>	354 000	2 366	2 511
3,596 %, échéant le 10 nov. 2036	2 650	2 664	566	(0,231) %, échéant le 26 févr. 2024 <sup>d), e)</sup>	96 000	642	681
		56 340	51 247	(0,217) %, échéant le 19 févr. 2024 <sup>d), e)</sup>	320 000	2 112	2 270
				(0,216) %, échéant le 22 janv. 2024 <sup>d), e)</sup>	96 000	642	681
				(0,207) %, échéant le 5 févr. 2024 <sup>d), e)</sup>	42 000	281	298
				(0,191) %, échéant le 25 mars 2024 <sup>d), e)</sup>	240 000	1 688	1 703
				(0,177) %, échéant le 11 mars 2024 <sup>d), e)</sup>	184 000	1 253	1 306
				(0,149) %, échéant le 18 mars 2024 <sup>d), e)</sup>	667 000	4 602	4 732
						15 208	15 821
<b>ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX AMÉRICAINS 53,4 %</b>				<b>BONS DU TRÉSOR DES ÉTATS-UNIS 0,4 %</b>			
<b>Fannie Mae</b>				5,419 %, échéant le 25 janv. 2024 <sup>d), e)</sup>	82 USD	82	82
2,390 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2025	9	9	8	5,450 %, échéant le 11 janv. 2024 <sup>d), e)</sup>	208	208	208
3,500 %, échéant le 25 mars 2027 <sup>a)</sup>	106	5	4	5,453 %, échéant le 25 janv. 2024 <sup>d), e)</sup>	540	538	538
<b>Ginnie Mae, à déterminer</b>				5,462 %, échéant le 25 janv. 2024 <sup>d), e)</sup>	430	428	428
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2054	1 500	1 333	1 397			1 256	1 256
5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2054	2 400	2 317	2 383	Total - Placements à court terme		113 273	113 883
<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme</b>				Total - Placements dans des titres		519 026	512 093
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juill. 2052	1 388	1 337	1 274	<b>Total - Placements 159,6 %</b>		519 026 USD	512 093 USD
5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2053 - 1 <sup>er</sup> juin 2053	17 220	17 148	17 040	<b>Instruments financiers dérivés<sup>h), i)</sup> 2,0 %</b>		(65)	6 453
<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, à déterminer</b>				<b>Passifs, moins les autres actifs (61,6) %</b>			(197 615)
3,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	16 900	15 035	14 968	<b>Total de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables 100,0 %</b>			320 931 USD
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	10 200	9 047	9 368				
4,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2054 - 1 <sup>er</sup> févr. 2054	23 400	21 740	22 146				
4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2054 - 1 <sup>er</sup> févr. 2054	9 900	9 593	9 603				
5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2054 - 1 <sup>er</sup> févr. 2054	15 275	14 904	15 114				
5,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	28 075	28 125	28 202				
6,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	31 075	31 495	31 554				
6,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	15 875	16 187	16 268				
7,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2054	1 900	1 952	1 957				
		170 227	171 286				
<b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR DES ÉTATS-UNIS 10,1 %</b>							
<b>Titres du Trésor des É.-U. indexés sur l'inflation<sup>g)</sup></b>							
0,125 %, échéant le 15 juill. 2024	4 185	4 078	4 114				
0,125 %, échéant le 15 oct. 2024	4 173	4 047	4 082				
0,125 %, échéant le 15 juill. 2030	360	392	325				
0,125 %, échéant le 15 janv. 2031	118	107	106				
0,125 %, échéant le 15 juill. 2031	4 052	4 471	3 605				
0,250 %, échéant le 15 juill. 2029	241	241	222				
0,500 %, échéant le 15 avr. 2024	3 501	3 422	3 457				
0,625 %, échéant le 15 janv. 2024	6 290	6 170	6 273				

## Inventaire du portefeuille Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) (suite)

### NOTES À L'INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE :

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

^ Titre en défaillance.

a) Coupon détaché.

b) Titre à rendement réinvesti.

c) Titre n'ayant produit aucun revenu au cours des douze derniers mois.

d) Titre à coupon zéro.

e) Coupon représentant un rendement à l'échéance.

f) Le montant du capital du titre est indexé selon l'inflation.

### EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

#### g) PRISES EN PENSION :

Contrepartie	Taux de financement	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du capital	Garanti par	Garanties (reçues)	Prises en pension, à la valeur	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>
JPS	5,490 %	2 janv. 2024	3 janv. 2024	45 100 USD	Obligations du Trésor des États-Unis, 0,750 %, échéant le 31 mai 2026	(46 017) USD	45 100 USD	45 100 USD
MBC	5,550	29 déc. 2023	2 janv. 2024	51 300	Obligations du Trésor des États-Unis, 1,500 % - 2,500 %, échéant le 15 nov. 2026 - 31 mars 2027	(53 030)	51 300	51 332
<b>Total - Prises en pension de titres</b>						<b>(99 047) USD</b>	<b>96 400 USD</b>	<b>96 432 USD</b>

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

#### VENTES À DÉCOUVERT :

Description	Intérêt	Date d'échéance	Montant du capital	Produits	Montants à payer pour les ventes à découvert
États-Unis					
Organismes gouvernementaux américains					
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, à déterminer	4,500 %	1 <sup>er</sup> mars 2054	1 900 USD	(1 803) USD	(1 842) USD
<b>Total des ventes à découvert</b>				<b>(1 803) USD</b>	<b>(1 842) USD</b>

Le solde moyen des emprunts pendant la période close le 31 décembre 2023 était de (145) \$ à un taux d'intérêt pondéré moyen de 4,578 %. Les emprunts peuvent comprendre des mises en pension et des accords cadres sur transactions à livrer.

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et des autres opérations de financement et des garanties données/(reçues).

#### h) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE

##### CONTRATS À TERME :

Description	Type	Mois de l'échéance	Nombre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	Marge de variation	
					Actif	Passif
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, décembre	Position courte	Mars 2024	13	87 USD	0 USD	1 USD
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, décembre	Position courte	Mars 2025	7	26	0	(1)
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, décembre	Position courte	Mars 2026	6	14	0	(1)
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, juin	Position courte	Sept. 2024	7	37	0	0
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, juin	Position courte	Sept. 2025	8	21	0	(1)
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, mars	Position courte	Juin 2024	11	67	0	0
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, mars	Position courte	Juin 2025	7	22	0	(1)
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, mars	Position courte	Juin 2026	7	15	0	(1)
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, septembre	Position courte	Déc. 2024	8	36	0	(1)
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, septembre	Position courte	Déc. 2025	4	9	0	0
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 5 ans, mars	Position longue	Mars 2024	14	33	1	0
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position courte	Mars 2024	67	(237)	0	0
Contrats à terme Ultra sur obligations à long terme du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position courte	Mars 2024	4	(21)	0	0
<b>Total des contrats à terme</b>				<b>109 USD</b>	<b>1 USD</b>	<b>(5) USD</b>

## SWAPS :

SWAPS SUR DÉFAILLANCE DE TITRES DE SOCIÉTÉS - PROTECTION À LA VENTE<sup>1)</sup>

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>2)</sup>	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur <sup>3)</sup>	Marge de variation	
						Actif	Passif
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20 juin 2025	200 USD	3 USD	12 USD	0 USD	0 USD

SWAPS SUR DÉFAILLANCE D'INDICES DE CRÉDIT - PROTECTION À LA VENTE <sup>1)</sup>

Indice/tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>2)</sup>	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur <sup>3)</sup>	Marge de variation	
						Actif	Passif
Indice CDX.EM-36 à 5 ans	1,000 %	20 déc. 2026	2 392 USD	88 USD	(15) USD	0 USD	(1) USD
Indice CDX.EM-40 à 5 ans	1,000	20 déc. 2028	900	19	(26)	0	0
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	5,000	20 juin 2028	99	3	6	0	0
Indice CDX.HY-41 à 5 ans	5,000	20 déc. 2028	13 266	676	774	0	(3)
				786 USD	739 USD	0 USD	(4) USD

<sup>1)</sup> Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, le Fonds soit i) versera à l'acheteur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et prendra livraison de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) paiera un montant net de règlement, sous forme de trésorerie, de titres ou d'autres obligations livrables, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence.

<sup>2)</sup> Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait devoir payer en tant que vendeur de protection de crédit ou recevoir en tant qu'acheteur de protection de crédit en cas d'incident de crédit, conformément aux dispositions du swap en question.

<sup>3)</sup> Les cours et les valeurs résultantes des swaps sur défaillance permettent de suivre l'évolution du risque de paiement/rendement et déterminent la probabilité qu'un passif (ou un actif) attendu sur le dérivé de crédit soit réalisé si le swap est dénoué ou si le notionnel est vendu à la clôture de la période. L'augmentation des justes valeurs en termes absolus, lorsque comparées aux valeurs notionnelles du swap, indique un affaiblissement du niveau de solvabilité de l'instrument référencé sous-jacent et une plus grande probabilité de défaillance ou de risque de défaillance, ou de survenance d'autres incidents de crédit définis dans les dispositions de l'accord.

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	Marge de variation	
							Actif	Passif
À payer	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	5,000 %	20 mars 2029	3 400 GBP	2 USD	337 USD	0 USD	(11) USD
À recevoir	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	0,750	21 sept. 2032	800	20	191	7	0
À recevoir	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	0,750	21 sept. 2052	700	401	426	14	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	0,500	15 juin 2024	13 600 USD	147	297	8	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,450	20 déc. 2024	12 400	277	276	3	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,350	17 janv. 2025	6 200	140	141	0	(1)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,300	17 janv. 2026	1 000	33	33	0	(1)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,450	6 juin 2026	151 200	1 855	1 832	51	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	0,500	16 juin 2026	2 300	145	197	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,000	19 juin 2026	300	21	8	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	21 juin 2026	780	7	7	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,000	15 juin 2027	10 880	734	938	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,000	21 déc. 2027	1 050	(14)	62	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,250	21 juin 2028	550	(2)	7	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,250	21 juin 2028	2 503	13	33	0	(1)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,500	15 déc. 2028	444	(57)	(46)	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,750	20 déc. 2028	1 670	(17)	(17)	0	(1)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,250	20 mars 2029	960	(5)	(36)	0	(1)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,000	15 juin 2029	500	35	62	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,000	15 juin 2029	700	45	86	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,750	15 juin 2029	1 224	35	106	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,750	20 juin 2029	2 700	(1)	(52)	0	(1)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,000	21 déc. 2029	16 490	(132)	1 312	3	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,360	21 déc. 2029	2 900	16	20	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,870	6 juin 2030	69 300	(1 212)	(1 512)	0	(5)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,250	17 juin 2030	1 600	149	229	1	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,000	21 juin 2030	14 110	194	395	1	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,000	16 déc. 2030	1 327	259	223	1	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	20 déc. 2030	1 790	(17)	(3)	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	20 déc. 2030	330	(9)	(1)	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,250	20 mars 2031	1 090	(7)	(57)	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	0,750	16 juin 2031	4 900	564	955	3	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	0,750	16 juin 2031	4 654	573	905	3	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,750	15 déc. 2031	3 800	581	522	2	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,750	15 juin 2032	5 930	392	741	4	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,750	15 juin 2032	1 373	51	171	1	0

## Inventaire du portefeuille Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) (suite)

Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Plus-value/ (moins-value)		Marge de variation	
					latente	Juste valeur	Actif	Passif
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,000 %	21 déc. 2032	3 350 USD	29 USD	374 USD	3 USD	0 USD
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,275	21 déc. 2032	5 000	(69)	(73)	0	(3)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,280	21 déc. 2032	4 000	48	54	3	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,000	21 juin 2033	3 140	78	116	3	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,000	21 juin 2033	705	19	26	1	0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	20 déc. 2033	380	13	1	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	20 déc. 2033	400	(12)	(1)	0	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,250	16 juin 2051	900	203	379	3	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,750	15 juin 2052	2 600	503	748	10	0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,750	15 juin 2052	1 700	205	483	6	0
À payer	CDI en BRL à un an	11,157	2 janv. 2025	100 BRL	0	0	0	0
À payer	CDI en BRL à un an	9,874	2 janv. 2026	2 200	(2)	(2)	0	0
À payer	CDI en BRL à un an	9,899	2 janv. 2026	1 100	(1)	(1)	0	0
À payer	CDI en BRL à un an	9,939	2 janv. 2026	1 500	(1)	(1)	0	0
À payer	CDI en BRL à un an	10,052	2 janv. 2026	4 200	(1)	(1)	0	(1)
À payer	CDI en BRL à un an	10,085	2 janv. 2026	4 200	0	0	0	(1)
À payer	CDI en BRL à un an	10,105	2 janv. 2026	4 200	0	0	0	(1)
À payer	CDI en BRL à un an	9,998	4 janv. 2027	3 100	0	0	0	0
À payer	CDI en BRL à un an	10,037	4 janv. 2027	700	0	0	0	0
À payer	CDI en BRL à un an	10,041	4 janv. 2027	3 400	0	0	0	(1)
À payer	CDI en BRL à un an	10,090	4 janv. 2027	6 500	2	2	0	(1)
À payer	CDI en BRL à un an	10,138	4 janv. 2027	1 600 BRL	1	1	0	0
À payer	CDI en BRL à un an	11,901	4 janv. 2027	100	1	1	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,410	31 juill. 2028	2 000 ZAR	2	2	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,415	31 juill. 2028	1 600	2	2	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,420	31 juill. 2028	6 000	6	6	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,428	31 juill. 2028	4 000	4	4	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,426	1 <sup>er</sup> août 2028	2 400	2	2	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,460	1 <sup>er</sup> août 2028	4 100	4	4	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,460	2 août 2028	4 200	5	5	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,464	2 août 2028	4 200	5	5	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,550	3 août 2028	4 000	5	5	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,380	4 août 2028	1 900	2	2	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,410	4 août 2028	4 600	4	4	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,415	4 août 2028	1 900	2	2	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,421	4 août 2028	2 000	2	2	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,543	4 août 2028	2 000	3	3	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,360	7 août 2028	3 800	3	3	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,400	7 août 2028	3 800	4	4	0	0
À payer	JIBAR en ZAR à 3 mois	8,410	7 août 2028	1 100	1	1	0	0
À payer	BBR-BBSW en AUD à 6 mois	4,500	20 sept. 2033	2 500 AUD	49	46	2	0
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	0,250	21 sept. 2032	2 000 EUR	203	384	17	0
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	2,000	21 sept. 2032	300	(19)	(12)	0	(3)
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	0,250	18 mars 2050	37	15	17	1	0
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	0,830	9 déc. 2052	7 500	433	481	38	0
À recevoir	TIIE en MXN à 28 jours	8,675	3 avr. 2024	6 800 MXN	3	3	0	0
À recevoir	TIIE en MXN à 28 jours	8,660	4 avr. 2024	2 900	1	1	0	0
À recevoir	TIIE en MXN à 28 jours	8,750	5 avr. 2024	2 900	1	1	0	0
À recevoir	TIIE en MXN à 28 jours	8,410	31 mars 2027	800	1	1	0	0
À recevoir	TIIE en MXN à 28 jours	8,730	6 avr. 2027	1 200	0	0	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,300	16 juin 2028	4 900	(2)	(4)	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,512	24 juill. 2028	8 700	(2)	(2)	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,444	25 juill. 2028	11 500	(5)	(5)	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,471	26 juill. 2028	5 800	(2)	(2)	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,550	27 juill. 2028	2 900	0	0	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,556	27 juill. 2028	17 500	(2)	(2)	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,620	28 juill. 2028	3 100	0	0	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,636	28 juill. 2028	6 100	0	0	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,640	28 juill. 2028	1 200	0	0	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,650	28 juill. 2028	3 100	0	0	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,660	28 juill. 2028	3 100	0	0	0	0
À payer	TIIE en MXN à 28 jours	8,600	31 juill. 2028	4 400	0	0	0	0
À recevoir	TIIE en MXN à 28 jours	7,495	14 janv. 2032	600	(1)	2	0	0
À recevoir	TIIE en MXN à 28 jours	7,498	15 janv. 2032	2 500	(2)	8	0	0
À recevoir	TIIE en MXN à 28 jours	8,732	30 mars 2032	600	(1)	(1)	0	0
À recevoir	TIIE en MXN à 28 jours	8,701	31 mars 2032	1 400	(1)	(1)	0	0
					6 957 USD	11 865 USD	189 USD	(33) USD
<b>Total des swaps</b>					<b>7 746 USD</b>	<b>12 616 USD</b>	<b>189 USD</b>	<b>(37) USD</b>

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée.

## i) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE

### CONTRATS DE CHANGE À TERME :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
AZD	Janv. 2024	146 \$	108 USD	0 USD	(2) USD
	Mars 2024	544 CNH	75	0	(1)
BOA	Janv. 2024	955 GBP	1 211	0	(6)
	Janv. 2024	91 331 JPY	619	0	(29)
	Févr. 2024	117 USD	824 CNY	0	0
	Févr. 2024	157	4 784 TRY	0	0
	Mars 2024	613 CNH	85 USD	0	(2)
CBK	Mars 2024	120 USD	10 031 INR	0	0
	Janv. 2024	1 378 \$	1 025 USD	0	(15)
	Janv. 2024	20 710 EUR	22 665	0	(203)
	Janv. 2024	2 732 HUF	8	0	0
	Janv. 2024	15 858 MXN	902	0	(28)
	Janv. 2024	2 582 USD	3 489 \$	52	0
	Janv. 2024	114	1 983 MXN	2	0
	Févr. 2024	2 835	14 541 BRL	154	0
	Févr. 2024	327	2 320 CNY	1	0
	Févr. 2024	260	7 900 TRY	0	(1)
	Mars 2024	667 000 JPY	4 710 USD	0	(75)
	Avril 2024	231 000	1 649	0	(12)
	GLM	Janv. 2024	61 AUD	40	0
Janv. 2024		9 238 \$	6 801	0	(172)
Janv. 2024		338 USD	305 EUR	0	(1)
Janv. 2024		3	916 HUF	0	0
Janv. 2024		624	91 900 JPY	28	0
Janv. 2024		1 525	26 751 MXN	43	0
Janv. 2024		389	11 780 TRY	4	0
Janv. 2024		3 497 ZAR	190 USD	0	(1)
Févr. 2024		25 BRL	5	0	0
Févr. 2024		1 591 USD	48 670 TRY	0	(11)
Mars 2024		25	385 755 IDR	0	0
Mars 2024		811	25 439 TRY	0	(7)
JPM		Janv. 2024	137 696 HUF	392 USD	0
	Janv. 2024	13 630 ZAR	709	0	(35)
	Févr. 2024	73 USD	2 242 TRY	0	0
	Mars 2024	1 397 CNH	194 USD	0	(4)
	Mars 2024	240 000 JPY	1 713	0	(11)
	Mars 2024	20 802 TWD	669	0	(20)
	Mars 2024	96 USD	8 059 INR	0	0
RBC	Janv. 2024	96 000 JPY	652 USD	0	(31)
	Mars 2024	184 000	1 262	0	(56)
	Avril 2024	2 USD	39 MXN	0	0
SCX	Janv. 2024	809 \$	610 USD	0	(1)
	Janv. 2024	174 EUR	189	0	(3)
	Janv. 2024	12 254 GBP	15 500	0	(120)
	Janv. 2024	312 USD	245 GBP	1	0
	Mars 2024	634 CNH	88 USD	0	(2)
	Mars 2024	26 047 TWD	825	0	(38)
	Mars 2024	3 USD	49 657 IDR	0	0
	Mars 2024	504	42 147 INR	1	0
SSB	Févr. 2024	450 000 JPY	3 036 USD	0	(181)
TOR	Févr. 2024	362 000	2 434	0	(152)
				<b>286 USD (1 226) USD</b>	

## Inventaire du portefeuille Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) (suite)

### CONTRATS DE CHANGE À TERME EN COURS, EN CAD, SÉRIE COUVERTE<sup>†</sup> :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
AZD	Janv. 2024	2 512 USD	3 414 \$	64 USD	0 USD
CBK	Janv. 2024	2 424 \$	1 814 USD	0	(16)
	Janv. 2024	104 759 USD	142 262 \$	2 621	(4)
GLM	Janv. 2024	144 \$	107 USD	0	(1)
	Janv. 2024	185 409 USD	251 684 \$	4 562	(6)
MYI	Janv. 2024	2 647	3 508	0	0
SCX	Janv. 2024	10 041 \$	7 567 USD	0	(12)
TOR	Janv. 2024	3 006	2 235	0	(33)
	Janv. 2024	3 031 USD	4 118 \$	78	0
				7 325 USD	(72) USD
<b>Total des contrats de change à terme</b>				<b>7 611 USD</b>	<b>(1 298) USD</b>

<sup>†</sup> Le Fonds offre des séries en CAD, couvertes, et utilise des techniques et des instruments pour réduire l'exposition au dollar américain, en totalité ou en partie. Il est impossible de garantir que les séries CAD, couvertes, seront couvertes en tout temps ni que la technique de couverture sera efficace.

### SWAPS :

#### SWAPS SUR DÉFAILLANCE DES ÉMISSIONS SOUVERAINES - PROTECTION À LA VENTE<sup>1)</sup>

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>2)</sup>	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Swaps, à la valeur <sup>3)</sup>		
							Actif	Passif	
BOA	Obligations internationales du gouvernement de l'Afrique du Sud	1,000 %	20 déc. 2026	900 USD	(39) USD	33 USD	0 USD	(6) USD	
CBK	Obligation internationale du gouvernement de la Colombie	1,000	20 juin 2027	100	(4)	4	0	0	
GST	Obligation internationale du gouvernement de la Colombie	1,000	20 juin 2027	100	(4)	4	0	0	
	Obligation internationale du gouvernement de la Colombie	1,000	20 déc. 2027	100	(9)	8	0	(1)	
	Obligations internationales du gouvernement de l'Afrique du Sud	1,000	20 déc. 2026	200	(9)	8	0	(1)	
<b>Total des swaps</b>						<b>(65) USD</b>	<b>57 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(8) USD</b>

<sup>1)</sup> Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, le Fonds soit i) versera à l'acheteur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et prendra livraison de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) paiera un montant net de règlement, sous forme de trésorerie, de titres ou d'autres obligations livrables, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence.

<sup>2)</sup> Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait devoir payer en tant que vendeur de protection de crédit ou recevoir en tant qu'acheteur de protection de crédit en cas d'incident de crédit, conformément aux dispositions du swap en question.

<sup>3)</sup> Les cours et les valeurs résultantes des swaps sur défaillance permettent de suivre l'évolution du risque de paiement/rendement et déterminent la probabilité qu'un passif (ou un actif) attendu sur le dérivé de crédit soit réalisé si le swap est dénoué ou si le notionnel est vendu à la clôture de la période. L'augmentation des justes valeurs en termes absolus, lorsque comparées aux valeurs notionnelles du swap, indique un affaiblissement du niveau de solvabilité de l'instrument référencé sous-jacent et une plus grande probabilité de défaillance ou de survenance d'autres incidents de crédit définis dans les dispositions de l'accord.

**Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues).**

(en milliers\*)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

**SOMMAIRE DES EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Montants à payer pour les ventes à découvert	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA)							
JPS	45 100 USD	0 USD	0 USD	0 USD	45 100 USD	(46 018) USD	(918) USD
MBC	51 332	0	0	0	51 332	(53 030)	(1 698)
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement <sup>3)</sup></b>	<b>96 432 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Montants à payer pour les ventes à découvert	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA)							
JPS	73 300 USD	0 USD	0 USD	0 USD	73 300 USD	(70 865) USD	2 435 USD
MBC	93 948	0	0	0	93 948	(97 010)	(3 062)
TOR	36 981	0	0	0	36 981	(37 045)	(64)
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement <sup>3)</sup></b>	<b>204 229 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>			

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.<sup>2)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux emprunts et autres opérations de financement ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».<sup>3)</sup> Les emprunts se sont établis entre 0 USD et 12 479 USD pour la période close le 31 décembre 2023 (entre 0 USD et 13 641 USD pour la période close le 31 décembre 2022).**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE – SOMMAIRE**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2023 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
<b>Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée</b>	<b>0 USD</b>	<b>1 USD</b>	<b>189 USD</b>	<b>190 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(5) USD</b>	<b>(37) USD</b>	<b>(42) USD</b>

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2022 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
<b>Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée</b>	<b>0 USD</b>	<b>5 USD</b>	<b>209 USD</b>	<b>214 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(45) USD</b>	<b>(32) USD</b>	<b>(77) USD</b>

## Notes annexes propres au Fonds Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) (suite)

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	64 USD	0 USD	0 USD	64 USD	(3) USD	0 USD	0 USD	(3) USD	61 USD	0 USD	61 USD
BOA	0	0	0	0	(37)	0	(6)	(43)	(43)	0	(43)
CBK	2 830	0	0	2 830	(354)	0	0	(354)	2 476	(2 960)	(484)
GLM	4 637	0	0	4 637	(200)	0	0	(200)	4 437	(4 740)	(303)
GST	0	0	0	0	0	0	(2)	(2)	(2)	28	26
JPM	0	0	0	0	(75)	0	0	(75)	(75)	0	(75)
RBC	0	0	0	0	(87)	0	0	(87)	(87)	0	(87)
SCX	2	0	0	2	(176)	0	0	(176)	(174)	0	(174)
SSB	0	0	0	0	(181)	0	0	(181)	(181)	0	(181)
TOR	78	0	0	78	(185)	0	0	(185)	(107)	0	(107)
<b>Total - Hors cote</b>	<b>7 611 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>7 611 USD</b>	<b>(1 298) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(8) USD</b>	<b>(1 306) USD</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	48 USD	0 USD	0 USD	48 USD	(60) USD	0 USD	0 USD	(60) USD	(12) USD	0 USD	(12) USD
BOA	430	0	0	430	(1 160)	0	(35)	(1 195)	(765)	890	125
CBK	80	0	0	80	(43)	0	(6)	(49)	31	0	31
CLY	0	0	0	0	(46)	0	0	(46)	(46)	0	(46)
GLM	48	0	0	48	(15)	0	0	(15)	33	(170)	(137)
GST	0	0	0	0	0	0	(21)	(21)	(21)	28	7
JPM	60	0	0	60	(281)	0	0	(281)	(221)	0	(221)
RBC	101	0	0	101	(433)	0	0	(433)	(332)	270	(62)
SCX	0	0	0	0	(1 009)	0	0	(1 009)	(1 009)	1 010	1
TOR	35	0	0	35	(860)	0	0	(860)	(825)	820	(5)
<b>Total - Hors cote</b>	<b>802 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>802 USD</b>	<b>(3 907) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(62) USD</b>	<b>(3 969) USD</b>			

<sup>1)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux instruments financiers dérivés hors cote ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

### ÉVALUATIONS DE LA JUSTE VALEUR

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2023 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Argentine				
Émissions souveraines	0 USD	798 USD	0 USD	798 USD
Australie				
Émissions souveraines	0	40	0	40
Canada				
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	31	0	31
Îles Caïmans				
Titres adossés à des actifs	0	8 942	0	8 942
Prêts avec participation et cession	0	1 482	0	1 482
France				
Obligations et billets de sociétés	0	3 866	0	3 866
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	1 263	0	1 263
Irlande				
Titres adossés à des actifs	0	3 997	0	3 997
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	6 166	0	6 166

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
Israël				
Émissions souveraines	0 USD	3 615 USD	0 USD	3 615 USD
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0	1 654	0	1 654
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	1 067	0	1 067
Luxembourg				
Actions ordinaires	9	0	125	134
Obligations et billets de sociétés	0	3 199	0	3 199
Mexique				
Obligations et billets de sociétés	0	1 180	0	1 180
Émissions souveraines	0	586	0	586
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	3 376	0	3 376
Roumanie				
Émissions souveraines	0	682	0	682
Russie				
Émissions souveraines	0	1 853	0	1 853
Afrique du Sud				
Émissions souveraines	0	1 007	0	1 007
Espagne				
Obligations et billets de sociétés	0	3 323	0	3 323
Suisse				
Obligations et billets de sociétés	0	3 421	0	3 421
Turquie				
Émissions souveraines	0	197	0	197
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	5 852	0	5 852
Prêts avec participation et cession	0	1 216	606	1 822
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	16 116	0	16 116
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	37 698	501	38 199
Actions ordinaires	0	0	747	747
Obligations et billets de sociétés	0	22 691	0	22 691
Prêts avec participation et cession	0	4 125	1 701	5 826
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	51 247	0	51 247
Organismes gouvernementaux américains	0	171 286	0	171 286
Obligations du Trésor américain	0	32 545	0	32 545
Instruments à court terme				
Prises en pension	0	96 400	0	96 400
Billets à court terme	0	3	0	3
Bons du Trésor de la Hongrie	0	403	0	403
Bons du Trésor du Japon	0	15 821	0	15 821
Bons du Trésor des États-Unis	0	1 256	0	1 256
Total - Placements	9 USD	508 404 USD	3 680 USD	512 093 USD
<b>Ventes à découvert, à la valeur - Passifs</b>				
États-Unis				
Organismes gouvernementaux américains	0 USD	(1 842) USD	0 USD	(1 842) USD
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	190	0	190
Hors cote	0	7 611	0	7 611
	0 USD	7 801 USD	0 USD	7 801 USD
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	(42)	0	(42)
Hors cote	0	(1 306)	0	(1 306)
	0 USD	(1 348) USD	0 USD	(1 348) USD
Total - Instruments financiers dérivés	0 USD	6 453 USD	0 USD	6 453 USD
Totaux	9 USD	513 015 USD	3 680 USD	516 704 USD

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2022 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Argentine				
Émissions souveraines	0 USD	604 USD	0 USD	604 USD
Australie				
Émissions souveraines	0	39	0	39
Canada				
Obligations et billets de sociétés	0	848	0	848
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	35	0	35
Îles Caïmans				
Titres adossés à des actifs	0	4 934	0	4 934
Obligations et billets de sociétés	0	2 533	0	2 533
Prêts avec participation et cession	0	1 596	0	1 596
France				
Obligations et billets de sociétés	0	1 735	0	1 735
Guernesey, Îles anglo-normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	41	0	41
Hong Kong				
Obligations et billets de sociétés	0	237	0	237
Irlande				
Titres adossés à des actifs	0	3 073	0	3 073
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	7 460	0	7 460
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	986	0	986
Émissions souveraines	0	1 402	0	1 402
Jersey, îles Anglo-Normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	693	0	693
Libéria				
Obligations et billets de sociétés	0	1 553	0	1 553
Luxembourg				
Actions ordinaires	0	0	102	102
Obligations et billets de sociétés	0	3 632	693	4 325
Prêts avec participation et cession	0	85	0	85
Droits	0	0	3	3
Bons de souscription	0	0	3	3
Mexique				
Obligations et billets de sociétés	0	1 118	0	1 118
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	4 177	0	4 177
Pérou				
Émissions souveraines	0	41	0	41
Russie				
Émissions souveraines	0	1 339	0	1 339
Afrique du Sud				
Émissions souveraines	0	1 163	0	1 163
Suisse				
Obligations et billets de sociétés	0	3 686	0	3 686
Turquie				
Émissions souveraines	0	187	0	187
Royaume-Uni				
Actions ordinaires	26	0	0	26
Obligations et billets de sociétés	0	3 301	0	3 301
Prêts avec participation et cession	0	0	1 826	1 826
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	17 935	0	17 935
Émissions souveraines	0	235	0	235
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	37 624	0	37 624
Actions ordinaires	0	0	74	74
Obligations et billets de sociétés	0	25 027	0	25 027
Prêts avec participation et cession	0	13 798	0	13 798
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	75 877	0	75 877
Organismes gouvernementaux américains	0	92 244	0	92 244
Obligations du Trésor américain	0	30 279	0	30 279
Îles Vierges britanniques				
Obligations et billets de sociétés	0	524	0	524

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Instruments à court terme</b>				
Billets de trésorerie	0 USD	16 719 USD	0 USD	16 719 USD
Prises en pension	0	204 128	0	204 128
Billets à court terme	0	8 900	0	8 900
Bons du Trésor du Japon	0	17 499	0	17 499
Bons du Trésor des États-Unis	0	1 796	0	1 796
<b>Total - Placements</b>	<b>26 USD</b>	<b>589 083 USD</b>	<b>2 701 USD</b>	<b>591 810 USD</b>
<b>Ventes à découvert, à la valeur - Passifs</b>				
<b>États-Unis</b>				
Organismes gouvernementaux américains	0 USD	(545) USD	0 USD	(545) USD
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	214	0	214
Hors cote	0	802	0	802
	<b>0 USD</b>	<b>1 016 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>1 016 USD</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	(77)	0	(77)
Hors cote	0	(3 969)	0	(3 969)
	<b>0 USD</b>	<b>(4 046) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(4 046) USD</b>
<b>Total - Instruments financiers dérivés</b>	<b>0 USD</b>	<b>(3 030) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(3 030) USD</b>
<b>Totaux</b>	<b>26 USD</b>	<b>585 508 USD</b>	<b>2 701 USD</b>	<b>588 235 USD</b>

**Vous trouverez ci-dessous un rapprochement des justes valeurs fondées sur des données non observables importantes (niveau 3) pour le Fonds au cours de la période close le 31 décembre 2023 :**

Catégorie et sous-catégorie	Solde d'ouverture au 31 déc. 2022	Achats nets	Ventes/ règlements nets	Escomptes/ (primes) accumulés	Gain/ (perte) réalisé	Variation nette de la plus-value/ (moins-value) latente <sup>1)</sup>	Transferts vers le niveau 3	Transferts hors du niveau 3	Solde de clôture au 31 déc. 2023	Variation nette de la plus-value/ (moins-value) latente des placements en portefeuille au 31 déc. 2023 <sup>1)</sup>
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>										
<b>Luxembourg</b>										
Actions ordinaires	102 USD	0 USD	0 USD	0 USD	0 USD	23 USD	0 USD	0 USD	125 USD	23 USD
Obligations et billets de sociétés	693	0	(693)	0	0	0	0	0	0	0
Droits	3	0	(4)	0	4	(3)	0	0	0	0
Bons de souscription	3	0	(4)	0	4	(3)	0	0	0	0
<b>Royaume-Uni</b>										
Prêts avec participation et cession	1 826	0	(208)	0	0	204	0	(1 216)	606	(4)
<b>États-Unis</b>										
Titres adossés à des actifs	0	500	0	0	0	1	0	0	501	1
Actions ordinaires	74	558	0	0	0	115	0	0	747	116
Prêts avec participation et cession	0	1 662	0	0	0	39	0	0	1 701	39
<b>Totaux</b>	<b>2 701 USD</b>	<b>2 720 USD</b>	<b>(909) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>8 USD</b>	<b>376 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(1 216) USD</b>	<b>3 680 USD</b>	<b>175 USD</b>

## Notes annexes propres au Fonds Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) (suite)

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des données non observables importantes utilisées pour déterminer la juste valeur des actifs et des passifs classés au niveau 3 de la hiérarchie des justes valeurs.

Catégorie et sous-catégorie	Solde de clôture au 31 déc. 2023	Technique d'évaluation	Données d'entrée non observables	(en %, à moins d'indication contraire)	
				Valeur(s) des données d'entrée	
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>					
Luxembourg					
Actions ordinaires	121 USD	Sociétés comparables	Multiple de BAIIA	X	4,000
	4	Modèle d'évaluation du prix des options	Volatilité		60,720
Royaume-Uni					
Prêts avec participation et cession	606	Flux de trésorerie actualisés	Taux d'actualisation		8,800
États-Unis					
Titres adossés à des actifs	501	Évaluation par comparaison	Prix de base		99,938
Actions ordinaires	684	Sociétés comparables	Multiple de BAIIA	X	14,500
			Multiple de revenus/ multiple de BAIIA/ taux d'actualisation	X/X/%	0,550/6,500/10,000
Prêts avec participation et cession	63	Sociétés comparables/ flux de trésorerie actualisés	Multiple de BAIIA	X	14,500
	1 701	Sociétés comparables			
<b>Total</b>	<b>3 680 USD</b>				

1) Toute différence entre la variation nette de la plus-value/(moins-value) latente et la variation nette de la plus-value/(moins-value) latente du portefeuille de placement au 31 décembre 2023 peut découler du fait qu'un placement n'est plus détenu ou classé au niveau 3 à la clôture de l'exercice.

Il n'y a eu aucun transfert significatif entre les niveaux 1, 2 ou 3 pendant la période close le 31 décembre 2022.

Au 31 décembre 2023, si la juste valeur évaluée à partir de données d'entrée non observables importantes (de niveau 3) avait progressé ou reculé de 10 % (10 % au 31 décembre 2022), l'actif net du Fonds aurait augmenté ou diminué de 368 \$ (270 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

### CONCENTRATION DU PORTEFEUILLE

Le portefeuille de placements du Fonds est concentré dans les segments suivants :

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Argentine	0,3 %	0,1 %
Australie	0,0 %	0,0 %
Canada	0,0 %	0,2 %
Îles Caïmans	3,3 %	2,1 %
France	1,2 %	0,4 %
Allemagne	0,4 %	0,0 %
Guernesey, Îles anglo-normandes	0,0 %	0,0 %
Hong Kong	0,0 %	0,1 %
Irlande	3,2 %	2,4 %
Israël	1,1 %	0,0 %
Italie	0,5 %	0,0 %
Japon	0,3 %	0,5 %
Jersey, Îles Anglo-Normandes	0,0 %	0,2 %
Libéria	0,0 %	0,4 %
Luxembourg	1,0 %	1,0 %
Mexique	0,6 %	0,3 %
Pays-Bas	1,1 %	1,0 %
Pérou	0,0 %	0,0 %
Roumanie	0,2 %	0,0 %
Russie	0,6 %	0,3 %
Afrique du Sud	0,3 %	0,3 %
Espagne	1,0 %	0,0 %
Suisse	1,1 %	0,8 %
Turquie	0,1 %	0,0 %
Royaume-Uni	7,4 %	5,4 %
États-Unis	100,5 %	62,9 %

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Îles Vierges britanniques	0,0 %	0,1 %
Instruments à court terme	35,4 %	56,9 %
Instruments financiers dérivés	2,0 %	(0,7) %
Passifs, moins les autres actifs	(61,6) %	(34,7) %
Total (% de l'actif net)	100,0 %	100,0 %

## RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

### RISQUE DE CHANGE

Les tableaux ci-dessous indiquent l'exposition globale au risque de change, sauf celui afférent à la monnaie fonctionnelle du Fonds.

Au 31 décembre 2023	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Peso argentin	7 USD	0 USD	7 USD	Peso argentin	33 USD	0 USD	33 USD
Dollar australien	123	(42)	81	Dollar australien	41	652	693
Réal brésilien	0	2 984	2 984	Réal brésilien	0	1 451	1 451
Livre sterling	15 089	(16 525)	(1 436)	Livre sterling	18 519	(19 662)	(1 143)
Dollar canadien	(19 176)	(6 167)	(25 343)	Dollar canadien	37 061	(62 639)	(25 578)
Yuan renminbi chinois (continental)	10	444	454	Yuan renminbi chinois (continental)	11	469	480
Yuan renminbi chinois (Offshore)	0	(450)	(450)	Yuan renminbi chinois (Offshore)	0	(474)	(474)
Euro	21 729	(22 723)	(994)	Euro	18 195	(18 831)	(636)
Forint hongrois	403	(402)	1	Forint hongrois	0	0	0
Roupie indienne	0	721	721	Roupie indienne	0	0	0
Roupie indonésienne	0	28	28	Roupie indonésienne	0	28	28
Yen japonais	15 819	(15 970)	(151)	Yen japonais	18 998	(15 989)	3 009
Peso mexicain	929	757	1 686	Peso mexicain	225	1 646	1 871
Nouveau sol péruvien	2	0	2	Nouveau sol péruvien	44	107	151
Rouble russe	10	0	10	Rouble russe	11	0	11
Rand sud-africain	1 051	(935)	116	Rand sud-africain	1 198	(803)	395
Franc suisse	0	0	0	Franc suisse	824	(856)	(32)
Dollar de Taiwan	0	(1 552)	(1 552)	Dollar de Taiwan	0	(1 747)	(1 747)
Nouvelle livre turque	0	3 109	3 109	Nouvelle livre turque	0	0	0
	35 996 USD	(56 723) USD	(20 727) USD		95 160 USD	(116 648) USD	(21 488) USD

Les tableaux ci-dessous résument le risque de change lié aux séries en CAD, couvertes, qui est compensé par des contrats de change à terme.

Au 31 décembre 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables en CAD, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en CAD, série couverte	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables en CAD, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en CAD, série couverte	Exposition nette
	295 050 USD	(293 932) USD	1 118 USD		398 000 USD	(394 658) USD	3 342 USD

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar américain avait progressé ou reculé de 5 % par rapport aux autres monnaies, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté d'environ (1 036) USD [(1 074) USD au 31 décembre 2022]. Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar américain avait progressé ou reculé de 5 % par rapport au dollar canadien, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables des séries couvertes aurait diminué ou augmenté d'environ 56 USD (157 USD au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

## Notes annexes propres au Fonds Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) (suite)

### RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt. Ils incluent les instruments financiers du Fonds à la juste valeur, classés en fonction de la date d'échéance. Certains actifs ou passifs figurant dans l'état de la situation financière ont été regroupés pour permettre la présentation ci-dessous.

<b>Actif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	118 513 USD	13 300 USD	55 958 USD	323 440 USD	882 USD	512 093 USD
Instruments financiers dérivés	7 611	11	51	126	2	7 801
Trésorerie et devises	0	0	0	0	1 685	1 685
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	4 878	4 878
Montants à recevoir	0	0	0	0	176 164	176 164
<b>Total - Actif</b>	<b>126 124 USD</b>	<b>13 311 USD</b>	<b>56 009 USD</b>	<b>323 566 USD</b>	<b>183 611 USD</b>	<b>702 621 USD</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Emprunts et autres opérations de financement	0 USD	0 USD	0 USD	(1 842) USD	0 USD	(1 842) USD
Instruments financiers dérivés	(1 286)	(12)	(10)	(23)	(17)	(1 348)
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(12 208)	(12 208)
Montants à payer	0	0	0	0	(366 292)	(366 292)
<b>Total - Passif</b>	<b>(1 286) USD</b>	<b>(12) USD</b>	<b>(10) USD</b>	<b>(1 865) USD</b>	<b>(378 517) USD</b>	<b>(381 690) USD</b>

  

<b>Actif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	250 446 USD	3 418 USD	60 202 USD	277 536 USD	208 USD	591 810 USD
Instruments financiers dérivés	767	35	51	157	6	1 016
Trésorerie et devises	0	0	0	0	3 751	3 751
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	9 662	9 662
Montants à recevoir	0	0	0	0	113 892	113 892
<b>Total - Actif</b>	<b>251 213 USD</b>	<b>3 453 USD</b>	<b>60 253 USD</b>	<b>277 693 USD</b>	<b>127 519 USD</b>	<b>720 131 USD</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Emprunts et autres opérations de financement	0 USD	0 USD	0 USD	(545) USD	0 USD	(545) USD
Instruments financiers dérivés	(3 900)	(10)	0	(19)	(117)	(4 046)
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(862)	(862)
Montants à payer	0	0	0	0	(277 295)	(277 295)
<b>Total - Passif</b>	<b>(3 900) USD</b>	<b>(10) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(564) USD</b>	<b>(278 274) USD</b>	<b>(282 748) USD</b>

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si les taux d'intérêt en vigueur avaient progressé ou reculé de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 9 366 USD, ou 2,9 % (10 618 USD, ou 2,4 %, au 31 décembre 2022). La sensibilité du Fonds à la variation des taux d'intérêt a été estimée d'après la duration moyenne pondérée des instruments de créance. Dans les faits, les résultats des opérations peuvent différer et la différence peut être importante.

### AUTRE RISQUE DE PRIX

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'était pas exposé à l'autre risque de prix de façon importante, car il détenait surtout des titres de créance.

## RISQUE DE LIQUIDITÉ

Les tableaux ci-dessous font état des passifs du Fonds par date de paiement contractuel : moins de trois mois, de trois mois à un an ou plus d'un an, selon le cas.

<b>Passif courant au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Emprunts et autres opérations de financement	0 USD	0 USD	1 842 USD	1 842 USD
Instruments financiers dérivés	1 303	12	33	1 348
Achats de placements à payer	365 976	0	0	365 976
Dépôts de contreparties	12 208	0	0	12 208
Montants à payer pour les parts rachetées	33	0	0	33
Distributions à payer	141	0	0	141
Frais de gestion à payer	142	0	0	142
<b>Total - Passif</b>	<b>379 803 USD</b>	<b>12 USD</b>	<b>1 875 USD</b>	<b>381 690 USD</b>

  

<b>Passif courant au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Emprunts et autres opérations de financement	545 USD	0 USD	0 USD	545 USD
Instruments financiers dérivés	4 036	10	0	4 046
Achats de placements à payer	276 181	0	0	276 181
Montant à payer pour les engagements de prêts non financés	31	0	0	31
Dépôts de contreparties	862	0	0	862
Montants à payer pour les parts rachetées	365	0	0	365
Distributions à payer	486	0	0	486
Frais de gestion à payer	232	0	0	232
<b>Total - Passif</b>	<b>282 738 USD</b>	<b>10 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>282 748 USD</b>

## RISQUE DE CRÉDIT

Les tableaux ci-dessous résument la composition des notations des instruments financiers du Fonds.

	<b>Au 31 décembre 2023</b>	<b>Au 31 décembre 2022</b>
Catégorie investissement	88 %	82 %
Inférieur à la catégorie investissement	12 %	18 %
Sans notation	0 %	0 %
Total (% des placements et des instruments financiers dérivés)	100 %	100 %

Les notations sont fournies par Standard & Poor's Ratings Services (S&P), Moody's Investors Services, Inc. (Moody's), Fitch Ratings, Inc. (Fitch) ou DBRS Limited (DBRS). Lorsqu'il existe plus d'une notation pour un titre, la plus élevée a été retenue. Si la notation d'un instrument n'est pas fournie par l'une de ces agences, un titre reçoit une notation interne. Les notations inférieures à la catégorie investissement sont celles inférieures à Baa3 selon Moody's, à BAA- selon la notation interne, à BBB- selon S&P et Fitch, et à BBBL selon DBRS.

## États de la situation financière Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 déc. 2023	31 déc. 2022
<b>Actif :</b>		
Actif courant :		
<i>Placements, à la juste valeur</i>		
Placement dans des fonds sous-jacents	100 032 \$	142 749 \$
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Hors cote	2	9
Trésorerie	1 004	1 417
Devises	56	13
Montants à recevoir pour la vente de placements dans des fonds sous-jacents	126	129
Montants à recevoir pour les parts vendues	18	219
Distributions à recevoir de fonds sous-jacents	420	462
	101 658	144 998
<b>Passif :</b>		
Passif courant :		
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Hors cote	42	1
Achats de placements à payer	3	1
Montants à payer pour l'achat de placements dans des fonds sous-jacents	537	641
Montants à payer pour les parts rachetées	79	159
Distributions à payer	70	43
Frais de gestion à payer	62	85
	793	930
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>100 865 \$</b>	<b>144 068 \$</b>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A	5 658 \$	5 545 \$
Nombre de parts rachetables - série A	627	619
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	9,01 \$	8,95 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F	89 962 \$	133 283 \$
Nombre de parts rachetables - série F	9 832	14 750
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	9,15 \$	9,04 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série FNB	3 624 \$	2 684 \$
Nombre de parts rachetables - série FNB	200	150
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série FNB	18,12 \$	17,90 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A (\$ US)	75 \$	94 \$
Nombre de parts rachetables - série A (\$ US)	6	8
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A (\$ US)	11,94 \$	12,21 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A (\$ US)	9,01 USD	9,02 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F (\$ US)	1 546 \$	2 462 \$
Nombre de parts rachetables - série F (\$ US)	128	204
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F (\$ US)	12,10 \$	12,07 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F (\$ US)	9,13 USD	8,92 USD

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États du résultat global Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Revenus :</b>		
<b>Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés</b>		
Intérêts à distribuer	4 \$	3 \$
Dividendes provenant de placements dans des fonds sous-jacents	5 127	5 217
Gain net réalisé sur la vente de placements dans les fonds sous-jacents	(1 518)	(6 744)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés hors cote	61	441
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements et des placements dans les fonds sous-jacents	4 444	(2 800)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés hors cote	(48)	148
Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés	8 070	(3 735)
<b>Autres revenus (pertes)</b>		
Gain (perte) net réalisé sur opérations en devises	0	(1)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente à la conversion des actifs et des passifs libellés en devises	(2)	(1)
Autres revenus (pertes)	(2)	(2)
Total - Revenus (pertes)	8 068	(3 737)
<b>Charges :</b>		
Frais de gestion	680	886
Frais liés au CEI	1	1
Charges d'intérêts	3	1
Total - Charges	684	888
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>7 384 \$</b>	<b>(4 625) \$</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série</b>		
Série A	313 \$	(418) \$
Série F	6 752	(4 264)
Série FNB	178	(194)
Série A (\$ US)	4	(5)
Série F (\$ US)	137	256
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part</b>		
Série A	0,49 \$	(0,63) \$
Série F	0,70	(0,34)
Série FNB	1,15	(1,20)
Série A (\$ US)	0,50	(0,11)
Série F (\$ US)	0,71	0,58

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence

(en milliers\*)

	Exercice clos le 31 déc. 2023					
	Série A	Série F	Série FNB	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	5 545 \$	133 283 \$	2 684 \$	94 \$	2 462 \$	144 068 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	313	6 752	178	4	137	7 384
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>						
Provenant du revenu net de placement	(280)	(3 943)	(152)	(6)	(96)	(4 477)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(280)	(3 943)	(152)	(6)	(96)	(4 477)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>						
Produit de la vente de parts rachetables	1 583	49 527	1 821	11	1 117	54 059
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	200	2 772	0	2	31	3 005
Coût des parts rachetables rachetées	(1 703)	(98 429)	(907)	(30)	(2 105)	(103 174)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	80	(46 130)	914	(17)	(957)	(46 110)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	113	(43 321)	940	(19)	(916)	(43 203)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	5 658 \$	89 962 \$	3 624 \$	75 \$	1 546 \$	100 865 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Parts rachetables vendues	175	5 529	100	0	94	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	22	307	0	0	3	S.O.
Parts rachetables rachetées	(189)	(10 754)	(50)	(2)	(173)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	8	(4 918)	50	(2)	(76)	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	619	14 750	150	8	204	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	627	9 832	200	6	128	S.O.

  

	Exercice clos le 31 déc. 2022					
	Série A	Série F	Série FNB	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	7 176 \$	105 120 \$	5 878 \$	658 \$	12 220 \$	131 052 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(418)	(4 264)	(194)	(5)	256	(4 625)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>						
Provenant du revenu net de placement	(159)	(3 784)	(93)	(11)	(153)	(4 200)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(159)	(3 784)	(93)	(11)	(153)	(4 200)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>						
Produit de la vente de parts rachetables	1 538	243 931	1 921	108	8 913	256 411
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	109	2 433	0	9	48	2 599
Coût des parts rachetables rachetées	(2 701)	(210 153)	(4 828)	(665)	(18 822)	(237 169)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(1 054)	36 211	(2 907)	(548)	(9 861)	21 841
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(1 631)	28 163	(3 194)	(564)	(9 758)	13 016
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	5 545 \$	133 283 \$	2 684 \$	94 \$	2 462 \$	144 068 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Parts rachetables vendues	167	26 397	100	9	760	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	12	267	0	1	4	S.O.
Parts rachetables rachetées	(293)	(22 561)	(250)	(55)	(1 540)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(114)	4 103	(150)	(45)	(776)	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	733	10 647	300	53	980	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	619	14 750	150	8	204	S.O.

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## Tableaux des flux de trésorerie Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence

(en milliers*)	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7 384 \$	(4 625) \$
<b>Ajustements au titre du rapprochement de l'augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et des entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation :</b>		
Achats de titres	(64 966)	(242 468)
Produit de la vente de placements	115 637	229 117
(Augmentation) diminution des distributions provenant des placements dans des fonds sous-jacents	42	(281)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés hors cote	61	441
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(23)	12
Produit (paiements) au titre des opérations en devises	(2)	(2)
<i>(Gain) perte nette réalisée</i>		
Placement dans des fonds sous-jacents	1 518	6 744
Instruments financiers dérivés hors cote	(61)	(441)
Opérations en devises	0	1
<i>Variation nette de la (plus-value) moins-value latente</i>		
Placements et placements dans des fonds sous-jacents	(4 444)	2 800
Instruments financiers dérivés hors cote	48	(148)
Conversion de passifs et d'actifs libellés en devises	2	1
Réinvestissement des dividendes autres qu'en trésorerie	(5 127)	(5 217)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation</b>	<b>50 069</b>	<b>(14 066)</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement :</b>		
Produit de la vente de parts rachetables**	49 543	248 847
Montant payé au titre du rachat de parts rachetables**	(98 537)	(233 070)
Distributions en trésorerie versées aux porteurs de parts rachetables	(1 445)	(1 620)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement</b>	<b>(50 439)</b>	<b>14 157</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des devises</b>	<b>(370)</b>	<b>91</b>
<b>Trésorerie (découvert) et devises :</b>		
Ouverture de l'exercice	1 430	1 339
Clôture de l'exercice	1 060 \$	1 430 \$
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie :</b>		
Intérêts payés liés aux activités de financement	3 \$	1 \$
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	4 \$	3 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

\*\* Ne comprend pas les transferts hors trésorerie entre les séries.

# Inventaire du portefeuille Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence

31 décembre 2023

(en milliers\*, sauf le nombre d'actions, de contrats, de parts ou d'onces, selon le cas)

	ACTIONS	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		ACTIONS	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES D'ENTREPRISES LIÉES 99,2 %</b>							
<b>CANADA 99,2 %</b>							
<b>FONDS COMMUNS DE PLACEMENT<sup>a)</sup> 99,2 %</b>							
Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO	1 130 867	10 835 \$	10 972 \$	Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)	330 937	2 999 \$	2 992 \$
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)	752 222	7 558	7 967	Total - Canada		99 475	100 032
Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)	2 443 843	23 161	23 031	Total - Placements dans des titres d'entreprises liées		99 475	100 032
Fonds d'obligations de qualité supérieure PIMCO (Canada)	563 186	4 802	4 991	<b>Total - Placements 99,2 %</b>		<b>99 475 \$</b>	<b>100 032 \$</b>
Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)	4 305 806	40 353	40 070	Instruments financiers dérivés <sup>b)</sup> (0,1) %		0	(40)
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada)	794 846	9 767	10 009	Autres actifs, moins les passifs 0,9 %			873
				<b>Total de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables 100,0 %</b>			<b>100 865 \$</b>

## NOTES À L'INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE :

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

a) Actions de série I de chaque Fonds.

## EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

Le solde moyen des emprunts pendant l'exercice clos le 31 décembre 2023 était de (5) \$ à un taux d'intérêt pondéré moyen de 5,025 %. Les emprunts peuvent comprendre des mises en pension et des accords cadres sur transactions à livrer.

## b) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE

### CONTRATS DE CHANGE À TERME :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
GLM	Janv. 2024	50 USD	66 \$	0 \$	0 \$
MBC	Janv. 2024	36	49	1	0
				1 \$	0 \$

### CONTRATS DE CHANGE À TERME EN COURS, EN \$ US, SÉRIE COUVERTE<sup>†</sup> :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
CBK	Janv. 2024	559 \$	411 USD	0 \$	(14) \$
	Janv. 2024	30 USD	40 \$	1	0
GLM	Janv. 2024	1 140 \$	840 USD	0	(28)
	Janv. 2024	3 USD	4 \$	0	0
MYI	Janv. 2024	9 \$	7 USD	0	0
				1 \$	(42) \$
<b>Total des contrats de change à terme</b>				<b>2 \$</b>	<b>(42) \$</b>

<sup>†</sup> Le Fonds offre des séries en \$ US, couvertes, et utilise des techniques et des instruments pour réduire l'exposition au dollar canadien, en totalité ou en partie. Il est impossible de garantir que les séries \$ US, couvertes, seront couvertes en tout temps ni que la technique de couverture sera efficace.

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues).

(en milliers\*)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

**SOMMAIRE DES EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT**

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucun emprunt ou autre opération de financement en cours.

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE - SOMMAIRE**

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucun instrument financier dérivé négocié en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée en cours.

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE - SOMMAIRE**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
CBK	1 \$	0 \$	0 \$	1 \$	(14) \$	0 \$	0 \$	(14) \$	(13) \$	0 \$	(13) \$
GLM	0	0	0	0	(28)	0	0	(28)	(28)	0	(28)
MBC	1	0	0	1	0	0	0	0	1	0	1
<b>Total - Hors cote</b>	<b>2 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>2 \$</b>	<b>(42) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(42) \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	(1) \$	0 \$	0 \$	(1) \$	(1) \$	0 \$	(1) \$
BOA	3	0	0	3	0	0	0	0	3	0	3
TOR	6	0	0	6	0	0	0	0	6	0	6
<b>Total - Hors cote</b>	<b>9 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>9 \$</b>	<b>(1) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(1) \$</b>			

<sup>1)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux instruments financiers dérivés hors cote ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

**ÉVALUATIONS DE LA JUSTE VALEUR**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2023 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Placements dans des entités affiliées, à la valeur</b>				
Canada				
Fonds communs de placement	100 032 \$	0 \$	0 \$	100 032 \$
Total – Placements	100 032 \$	0 \$	0 \$	100 032 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Hors cote	0 \$	2 \$	0 \$	2 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Hors cote	0 \$	(42) \$	0 \$	(42) \$
Total - Instruments financiers dérivés	0 \$	(40) \$	0 \$	(40) \$
Totaux	100 032 \$	(40) \$	0 \$	99 992 \$

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2022 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Placements dans des entités affiliées, à la valeur</b>				
Canada				
Fonds communs de placement	142 749 \$	0 \$	0 \$	142 749 \$
Total - Placements	142 749 \$	0 \$	0 \$	142 749 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Hors cote	0 \$	9 \$	0 \$	9 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Hors cote	0 \$	(1) \$	0 \$	(1) \$
Total - Instruments financiers dérivés	0 \$	8 \$	0 \$	8 \$
Totaux	142 749 \$	8 \$	0 \$	142 757 \$

Il n'y a eu aucun transfert significatif entre les niveaux 1, 2 ou 3 pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

### CONCENTRATION DU PORTEFEUILLE

Le portefeuille de placements du Fonds est concentré dans les segments suivants :

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Canada	99,2 %	99,1 %
Instruments financiers dérivés	(0,1) %	0,0 %
Autres actifs, moins les passifs	0,9 %	0,9 %
Total (% de l'actif net)	100,0 %	100,0 %

La concentration du portefeuille ci-dessus est établie en fonction de la juste valeur des placements. Elle ne représente pas la concentration des fonds sous-jacents détenus par le Fonds.

### RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

#### RISQUE DE CHANGE

Les tableaux ci-dessous indiquent l'exposition globale au risque de change, sauf celui afférent à la monnaie fonctionnelle du Fonds. Le Fonds peut être exposé à d'autres risques de change en raison de ses placements dans les fonds sous-jacents.

Au 31 décembre 2023	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Dollar américain	298 \$	(357) \$	(59) \$	Dollar américain	303 \$	(303) \$	0 \$
	298 \$	(357) \$	(59) \$		303 \$	(303) \$	0 \$

Les tableaux ci-dessous résument le risque de change lié aux séries en \$ US, couvertes, qui est compensé par des contrats de change à terme.

Au 31 décembre 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, en \$ US, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en \$ US, série couverte	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, en \$ US, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en \$ US, série couverte	Exposition nette
	1 621 \$	(1 622) \$	(1) \$		2 556 \$	(2 554) \$	2 \$

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport aux autres monnaies, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ (3) \$ (0 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport au dollar américain, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 0 \$ (0 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

## RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt. Ils incluent les instruments financiers du Fonds à la juste valeur, classés en fonction de la date d'échéance. Certains actifs ou passifs figurant dans l'état de la situation financière, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, ont été regroupés pour permettre la présentation ci-dessous. Le Fonds peut être exposé à d'autres risques d'intérêt en raison de ses placements dans les fonds sous-jacents.

## Actif au 31 décembre 2023

	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Placements, à la juste valeur	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	100 032 \$	100 032 \$
Instruments financiers dérivés	2	0	0	0	0	2
Trésorerie et devises	0	0	0	0	1 060	1 060
Montants à recevoir	0	0	0	0	564	564
<b>Total - Actif</b>	<b>2 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>101 656 \$</b>	<b>101 658 \$</b>

## Passif au 31 décembre 2023

	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Instruments financiers dérivés	(42) \$	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	(42) \$
Montants à payer	0	0	0	0	(751)	(751)
<b>Total - Passif</b>	<b>(42) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(751) \$</b>	<b>(793) \$</b>

## Actif au 31 décembre 2022

	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Placements, à la juste valeur	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	142 749 \$	142 749 \$
Instruments financiers dérivés	9	0	0	0	0	9
Trésorerie et devises	0	0	0	0	1 430	1 430
Montants à recevoir	0	0	0	0	810	810
<b>Total - Actif</b>	<b>9 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>144 989 \$</b>	<b>144 998 \$</b>

## Passif au 31 décembre 2022

	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Instruments financiers dérivés	(1) \$	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	(1) \$
Montants à payer	0	0	0	0	(929)	(929)
<b>Total - Passif</b>	<b>(1) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(929) \$</b>	<b>(930) \$</b>

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si les taux d'intérêt en vigueur avaient progressé ou reculé de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 1 \$ ou 0 % (0 \$, ou 0 %, au 31 décembre 2022). La sensibilité du Fonds à la variation des taux d'intérêt a été estimée d'après la durée moyenne pondérée des instruments de créance. Dans les faits, les résultats des opérations peuvent différer et la différence peut être importante.

## AUTRE RISQUE DE PRIX

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'était pas exposé à l'autre risque de prix de façon importante, car les fonds sous-jacents détenaient surtout des titres de créance.

## RISQUE DE LIQUIDITÉ

Les tableaux ci-dessous font état des passifs du Fonds, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, par date de paiement contractuel : moins de trois mois, de trois mois à un an ou plus d'un an, selon le cas.

Passif courant au 31 décembre 2023	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Total
Instruments financiers dérivés	42 \$	0 \$	0 \$	42 \$
Achats de placements à payer	3	0	0	3
Montants à payer pour l'achat de placements dans des fonds sous-jacents	537	0	0	537
Montants à payer pour les parts rachetées	79	0	0	79
Distributions à payer	70	0	0	70
Frais de gestion à payer	62	0	0	62
<b>Total - Passif</b>	<b>793 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>793 \$</b>

Passif courant au 31 décembre 2022	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Total
Instruments financiers dérivés	1 \$	0 \$	0 \$	1 \$
Achats de placements à payer	1	0	0	1
Montants à payer pour l'achat de placements dans des fonds sous-jacents	641	0	0	641
Montants à payer pour les parts rachetées	159	0	0	159
Distributions à payer	43	0	0	43
Frais de gestion à payer	85	0	0	85
<b>Total - Passif</b>	<b>930 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>930 \$</b>

#### RISQUE DE CRÉDIT

Les tableaux ci-dessous résument la composition des notations des instruments financiers du Fonds. Le Fonds peut être exposé à d'autres risques de crédit en raison de ses placements dans les fonds sous-jacents.

	Au 31 décembre 2023	Au 31 décembre 2022
Catégorie investissement	100 %	100 %
Inférieur à la catégorie investissement	0 %	0 %
Sans notation	0 %	0 %
Total (% des placements et des instruments financiers dérivés)	100 %	100 %

Les notations sont fournies par Standard & Poor's Ratings Services (S&P), Moody's Investors Services, Inc. (Moody's), Fitch Ratings, Inc. (Fitch) ou DBRS Limited (DBRS). Lorsqu'il existe plus d'une notation pour un titre, la plus élevée a été retenue. Si la notation d'un instrument n'est pas fournie par l'une de ces agences, un titre reçoit une notation interne. Les notations inférieures à la catégorie investissement sont celles inférieures à Baa3 selon Moody's, à BAA- selon la notation interne, à BBB- selon S&P et Fitch, et à BBBL selon DBRS.

#### INTÉRÊTS DÉTENUS DANS D'AUTRES ENTITÉS

L'exposition aux placements détenus dans les fonds sous-jacents est présentée dans les tableaux ci-dessous. Ces placements sont compris dans le poste « Placement dans des fonds sous-jacents » de l'état de la situation financière.

	Juste valeur du fonds sous-jacent	Placement dans le fonds sous-jacent à la juste valeur	% du fonds sous-jacent détenu
<b>Au 31 décembre 2023</b>			
Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO	496 676 \$	10 972 \$	2,21 %
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)	239 675	7 967	3,32
Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)	430 443	23 031	5,35
Fonds d'obligations de qualité supérieure PIMCO (Canada)	380 210 USD	4 991	0,99
Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)	320 931	40 070	9,42
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada)	23 674 119 \$	10 009	0,04
Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)	79 930	2 992	3,74
<b>Au 31 décembre 2022</b>			
Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO	633 925 \$	22 743 \$	3,59 %
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)	228 342	5 697	2,49
Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)	533 993	28 599	5,36
Fonds d'obligations de qualité supérieure PIMCO (Canada)	349 798 USD	8 551	1,81
Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)	437 383	52 909	8,93
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada)	21 193 630 \$	14 276	0,07
Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)	117 230	9 974	8,51

#### RETRAITEMENT DE DONNÉES COMPARATIVES

Certaines données comparatives ont été reclassées afin que leur présentation soit conforme à celle des états financiers pour l'exercice présenté. Les postes « Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements en portefeuille » et « Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements dans les fonds sous-jacents », d'un montant respectif de (7 775) \$ et de 4 975 \$ à l'exercice précédent, ont été combinés et présentés à titre de « Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements en portefeuille et des placements dans les fonds sous-jacents » dans les données comparatives.

## États de la situation financière Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
<b>Actif :</b>		
Actif courant :		
<i>Placements, à la juste valeur</i>		
Placements dans des titres	816 \$	0 \$
Placement dans des fonds sous-jacents	1 242 062	1 079 842
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Hors cote	29	112
Trésorerie	11 766	11 247
Devises	424	6
Montants à recevoir pour la vente de placements dans des fonds sous-jacents	12 990	157
Montants à recevoir pour les parts vendues	37 901	4 402
Distributions à recevoir de fonds sous-jacents	4 018	2 989
	1 310 006	1 098 755
<b>Passif :</b>		
Passif courant :		
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Hors cote	1 017	20
Achats de placements à payer	9	2
Montants à payer pour l'achat de placements dans des fonds sous-jacents	18 143	5 554
Montants à payer pour les parts rachetées	37 232	2 384
Distributions à payer	914	855
Frais de gestion à payer	709	617
	58 024	9 432
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>1 251 982 \$</b>	<b>1 089 323 \$</b>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A	34 198 \$	32 195 \$
Nombre de parts rachetables - série A	3 793	3 712
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	9,02 \$	8,67 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F	1 068 815 \$	934 337 \$
Nombre de parts rachetables - série F	118 586	107 657
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	9,01 \$	8,68 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série FNB	108 980 \$	85 664 \$
Nombre de parts rachetables - série FNB	6 000	4 900
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série FNB	18,16 \$	17,48 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A (\$ US)	2 001 \$	2 406 \$
Nombre de parts rachetables - série A (\$ US)	167	207
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A (\$ US)	11,98 \$	11,63 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A (\$ US)	9,04 USD	8,59 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F (\$ US)	37 988 \$	34 721 \$
Nombre de parts rachetables - série F (\$ US)	3 159	2 984
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F (\$ US)	12,03 \$	11,64 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F (\$ US)	9,08 USD	8,59 USD

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États du résultat global Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	Exercice clos le 31 décembre 2023	Exercice clos le 31 décembre 2022
<b>Revenus :</b>		
<b>Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés</b>		
Intérêts à distribuer	117 \$	14 \$
Dividendes provenant de placements dans des fonds sous-jacents	51 006	39 777
Gain (perte) net réalisé à la vente de placements	4	6
Gain net réalisé sur la vente de placements dans les fonds sous-jacents	(27 484)	(46 476)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés hors cote	(416)	1 692
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements dans les fonds sous-jacents	70 753	(86 261)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés hors cote	(1 081)	398
Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés	92 899	(90 850)
<b>Autres revenus (pertes)</b>		
Gain (perte) net réalisé sur opérations en devises	(16)	13
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente à la conversion des actifs et des passifs libellés en devises	(6)	4
Autres revenus (pertes)	(22)	17
Total - Revenus (pertes)	92 877	(90 833)
<b>Charges :</b>		
Frais de gestion	7 761	6 589
Frais liés au CEI	5	3
Charges d'intérêts	5	1
Total - Charges	7 771	6 593
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	85 106 \$	(97 426) \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série</b>		
Série A	2 227 \$	(2 958) \$
Série F	75 574	(85 889)
Série FNB	5 519	(7 459)
Série A (\$ US)	135	(46)
Série F (\$ US)	1 651	(1 074)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part</b>		
Série A	0,61 \$	(0,94) \$
Série F	0,64	(0,90)
Série FNB	1,33	(1,67)
Série A (\$ US)	0,66	(0,44)
Série F (\$ US)	0,43	(0,43)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base

(en milliers\*)

Exercice clos le 31 décembre 2023

	Série A	Série F	Série FNB	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	32 195 \$	934 337 \$	85 664 \$	2 406 \$	34 721 \$	1 089 323 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	2 227	75 574	5 519	135	1 651	85 106
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>						
Provenant du revenu net de placement	(950)	(38 278)	(2 503)	(55)	(1 284)	(43 070)
Total – Distributions aux porteurs de parts rachetables	(950)	(38 278)	(2 503)	(55)	(1 284)	(43 070)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>						
Produit de la vente de parts rachetables	13 853	528 847	80 085	507	50 588	673 880
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	759	19 173	0	55	978	20 965
Coût des parts rachetables rachetées	(13 886)	(450 838)	(59 785)	(1 047)	(48 666)	(574 222)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	726	97 182	20 300	(485)	2 900	120 623
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	2 003	134 478	23 316	(405)	3 267	162 659
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	34 198 \$	1 068 815 \$	108 980 \$	2 001 \$	37 988 \$	1 251 982 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Parts rachetables vendues	1 570	59 927	4 500	42	4 242	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	85	2 166	0	5	82	S.O.
Parts rachetables rachetées	(1 574)	(51 164)	(3 400)	(87)	(4 149)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	81	10 929	1 100	(40)	175	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	3 712	107 657	4 900	207	2 984	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	3 793	118 586	6 000	167	3 159	S.O.

Exercice clos le 31 déc. 2022

	Série A	Série F	Série FNB	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	30 505 \$	883 979 \$	77 448 \$	1 308 \$	27 901 \$	1 021 141 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(2 958)	(85 889)	(7 459)	(46)	(1 074)	(97 426)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>						
Provenant du revenu net de placement	(783)	(28 750)	(2 746)	(36)	(981)	(33 296)
Total – Distributions aux porteurs de parts rachetables	(783)	(28 750)	(2 746)	(36)	(981)	(33 296)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>						
Produit de la vente de parts rachetables	19 752	920 400	43 554	1 770	43 194	1 028 670
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	545	13 770	0	36	573	14 924
Coût des parts rachetables rachetées	(14 866)	(769 173)	(25 133)	(626)	(34 892)	(844 690)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	5 431	164 997	18 421	1 180	8 875	198 904
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	1 690	50 358	8 216	1 098	6 820	68 182
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	32 195 \$	934 337 \$	85 664 \$	2 406 \$	34 721 \$	1 089 323 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Parts rachetables vendues	2 223	102 511	2 400	152	3 686	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	62	1 557	0	3	50	S.O.
Parts rachetables rachetées	(1 670)	(86 048)	(1 400)	(54)	(3 020)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	615	18 020	1 000	101	716	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	3 097	89 637	3 900	106	2 268	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	3 712	107 657	4 900	207	2 984	S.O.

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## Tableaux des flux de trésorerie Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base

(en milliers*)	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	85 106 \$	(97 426) \$
<b>Ajustements au titre du rapprochement de l'augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et des entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation :</b>		
Achats de titres	(579 219)	(705 717)
Produit de la vente de placements	510 254	545 640
(Augmentation) diminution des distributions provenant des placements dans des fonds sous-jacents	(1 029)	(432)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés hors cote	(417)	1 693
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	92	(4)
Produit (paiements) au titre des opérations en devises	(23)	14
<i>(Gain) perte nette réalisée</i>		
Placements	(4)	(6)
Placement dans des fonds sous-jacents	27 484	46 476
Instruments financiers dérivés hors cote	416	(1 692)
Opérations en devises	16	(13)
<i>Variation nette de la (plus-value) moins-value latente</i>		
Placement dans des fonds sous-jacents	(70 753)	86 261
Instruments financiers dérivés hors cote	1 081	(398)
Conversion de passifs et d'actifs libellés en devises	6	(4)
Réinvestissement des dividendes autres qu'en trésorerie	(51 007)	(39 777)
Amortissement net des primes (des escomptes) sur les placements	(28)	0
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation</b>	<b>(78 025)</b>	<b>(165 385)</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement :</b>		
Produit de la vente de parts rachetables**	571 090	982 248
Montant payé au titre du rachat de parts rachetables**	(470 083)	(797 234)
Distributions en trésorerie versées aux porteurs de parts rachetables	(22 046)	(18 470)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement</b>	<b>78 961</b>	<b>166 544</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des devises</b>	<b>936</b>	<b>1 159</b>
<b>Trésorerie (découvert) et devises :</b>		
Ouverture de l'exercice	11 253	10 091
Gain (perte) de change sur la trésorerie	1	3
Clôture de l'exercice	12 190 \$	11 253 \$
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie :</b>		
Intérêts payés liés aux activités de financement	5 \$	1 \$
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	88 \$	14 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

\*\* Ne comprend pas les transferts hors trésorerie entre les séries.

# Inventaire du portefeuille Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base

31 décembre 2023

(en milliers\*, sauf le nombre d'actions, de contrats, de parts ou d'onces, selon le cas)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		ACTIONS	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES 0,1 %</b>							
<b>INSTRUMENTS À COURT TERME 0,1 %</b>							
<b>BONS DU TRÉSOR DU CANADA 0,1 %</b>							
5,031 %, échéant le 14 mars 2024 <sup>a), b)</sup>	402 \$	398 \$	398 \$				
5,037 %, échéant le 14 mars 2024 <sup>a), b)</sup>	423	419	418				
Total - Placements à court terme		817	816				
Total - Placements dans des titres		817	816				
ACTIONS							
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES D'ENTREPRISES LIÉES 99,2 %</b>							
<b>CANADA 99,2 %</b>							
<b>FONDS COMMUNS DE PLACEMENT<sup>c)</sup> 99,2 %</b>							
Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO	29 401 060	292 930	285 246	Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)	2 743 281	25 644 \$	24 805 \$
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)	12 860 689	132 426	136 215	Total - Canada		1 260 995	1 242 062
Fonds d'obligations de qualité supérieure PIMCO (Canada)	21 008 108	189 396	186 164	Total - Placements dans des titres d'entreprises liées		1 260 995	1 242 062
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada)	48 411 920	620 599	609 632	<b>Total - Placements 99,3 %</b>		<b>1 261 812 \$</b>	<b>1 242 878 \$</b>
				Instruments financiers dérivés <sup>d)</sup> (0,1) %		0	(988)
				Autres actifs, moins les passifs 0,8 %			10 092
				<b>Total de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables 100,0 %</b>			<b>1 251 982 \$</b>

## NOTES À L'INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE :

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

a) Titre à coupon zéro.

b) Coupon représentant un rendement à l'échéance.

c) Actions de série I de chaque Fonds.

## d) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE

### CONTRATS DE CHANGE À TERME :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
CBK	Janv. 2024	15 \$	11 USD	0 \$	0 \$
	Janv. 2024	5 USD	6 \$	0	0
				<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>

### CONTRATS DE CHANGE À TERME EN COURS, EN \$ US, SÉRIE COUVERTE<sup>†</sup> :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
AZD	Janv. 2024	13 USD	17 \$	1 \$	0 \$
CBK	Janv. 2024	15 273 \$	11 243 USD	0	(377)
	Janv. 2024	958 USD	1 280 \$	11	0
GLM	Janv. 2024	26 822 \$	19 763 USD	0	(639)
	Janv. 2024	606 USD	819 \$	17	0
MYI	Janv. 2024	927 \$	700 USD	0	0
	Janv. 2024	72	54	0	(1)
				<b>29 \$</b>	<b>(1 017) \$</b>
<b>Total des contrats de change à terme</b>				<b>29 \$</b>	<b>(1 017) \$</b>

<sup>†</sup> Le Fonds offre des séries en \$ US, couvertes, et utilise des techniques et des instruments pour réduire l'exposition au dollar canadien, en totalité ou en partie. Il est impossible de garantir que les séries \$ US, couvertes, seront couvertes en tout temps ni que la technique de couverture sera efficace.

**Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues).**

## Notes annexes propres au Fonds Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base

(en milliers\*)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

### SOMMAIRE DES EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucun emprunt ou autre opération de financement en cours.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE - SOMMAIRE

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucun instrument financier dérivé négocié en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée en cours.

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE – SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	1 \$	0 \$	0 \$	1 \$	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	1 \$	0 \$	1 \$
CBK	11	0	0	11	(377)	0	0	(377)	(366)	418	52
GLM	17	0	0	17	(639)	0	0	(639)	(622)	398	(224)
TOR	0	0	0	0	(1)	0	0	(1)	(1)	0	(1)
<b>Total - Hors cote</b>	<b>29 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>29 \$</b>	<b>(1 017) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(1 017) \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	18 \$	0 \$	0 \$	18 \$	(2) \$	0 \$	0 \$	(2) \$	16 \$	0 \$	16 \$
BOA	21	0	0	21	(13)	0	0	(13)	8	0	8
JPM	4	0	0	4	0	0	0	0	4	0	4
MBC	0	0	0	0	(2)	0	0	(2)	(2)	0	(2)
TOR	69	0	0	69	(3)	0	0	(3)	66	0	66
<b>Total - Hors cote</b>	<b>112 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>112 \$</b>	<b>(20) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(20) \$</b>			

<sup>1)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux instruments financiers dérivés hors cote ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

## ÉVALUATIONS DE LA JUSTE VALEUR

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2023 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Instruments à court terme				
Bons du Trésor du Canada	0 \$	816 \$	0 \$	816 \$
	0 \$	816 \$	0 \$	816 \$
<b>Placements dans des entités affiliées, à la valeur</b>				
Canada				
Fonds communs de placement	1 242 062	0	0	1 242 062
Total - Placements	1 242 062 \$	0 \$	0 \$	1 242 062 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Hors cote	0 \$	29 \$	0 \$	29 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Hors cote	0 \$	(1 017) \$	0 \$	(1 017) \$
Total - Instruments financiers dérivés	0 \$	(988) \$	0 \$	(988) \$
Totaux	1 242 062 \$	(172) \$	0 \$	1 241 890 \$

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2022 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Placements dans des entités affiliées, à la valeur</b>				
Canada				
Fonds communs de placement	1 079 842 \$	0 \$	0 \$	1 079 842 \$
Total - Placements	1 079 842 \$	0 \$	0 \$	1 079 842 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Hors cote	0 \$	112 \$	0 \$	112 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Hors cote	0 \$	(20) \$	0 \$	(20) \$
Total - Instruments financiers dérivés	0 \$	92 \$	0 \$	92 \$
Totaux	1 079 842 \$	92 \$	0 \$	1 079 934 \$

Il n'y a eu aucun transfert significatif entre les niveaux 1, 2 ou 3 pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

## CONCENTRATION DU PORTEFEUILLE

Le portefeuille de placements du Fonds est concentré dans les segments suivants :

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Canada	99,2 %	99,1 %
Instruments à court terme	0,1 %	0,0 %
Instruments financiers dérivés	(0,1) %	0,0 %
Autres actifs, moins les passifs	0,8 %	0,9 %
Total (% de l'actif net)	100,0 %	100,0 %

La concentration du portefeuille ci-dessus est établie en fonction de la juste valeur des placements. Elle ne représente pas la concentration des fonds sous-jacents détenus par le Fonds.

## Notes annexes propres au Fonds Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base (suite)

### RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

#### RISQUE DE CHANGE

Les tableaux ci-dessous indiquent l'exposition globale au risque de change, sauf celui afférent à la monnaie fonctionnelle du Fonds. Le Fonds peut être exposé à d'autres risques de change en raison de ses placements dans les fonds sous-jacents.

Au 31 décembre 2023	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Dollar américain	1 136 \$	(712) \$	424 \$	Dollar américain	515 \$	(635) \$	(120) \$
	1 136 \$	(712) \$	424 \$		515 \$	(635) \$	(120) \$

Les tableaux ci-dessous résument le risque de change lié aux séries en \$ US, couvertes, qui est compensé par des contrats de change à terme.

Au 31 décembre 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, en \$ US, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en \$ US, série couverte	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, en \$ US, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en \$ US, série couverte	Exposition nette
	39 989 \$	(40 005) \$	(16) \$		37 127 \$	(37 237) \$	(110) \$

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport aux autres monnaies, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 21 \$ [(6) \$ au 31 décembre 2022]. Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport au dollar américain, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ (1) \$ [(6) \$ au 31 décembre 2022]. Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

#### RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt. Ils incluent les instruments financiers du Fonds à la juste valeur, classés en fonction de la date d'échéance. Certains actifs ou passifs figurant dans l'état de la situation financière, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, ont été regroupés pour permettre la présentation ci-dessous. Le Fonds peut être exposé à d'autres risques d'intérêt en raison de ses placements dans les fonds sous-jacents.

Actif au 31 décembre 2023	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Placements, à la juste valeur	816 \$	0 \$	0 \$	0 \$	1 242 062 \$	1 242 878 \$
Instruments financiers dérivés	29	0	0	0	0	29
Trésorerie et devises	0	0	0	0	12 190	12 190
Montants à recevoir	0	0	0	0	54 909	54 909
<b>Total – Actif</b>	<b>845 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>1 309 161 \$</b>	<b>1 310 006 \$</b>

  

Passif au 31 décembre 2023	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Instruments financiers dérivés	(1 017) \$	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	(1 017) \$
Montants à payer	0	0	0	0	(57 007)	(57 007)
<b>Total – Passif</b>	<b>(1 017) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(57 007) \$</b>	<b>(58 024) \$</b>

  

Actif au 31 décembre 2022	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
Placements, à la juste valeur	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	1 079 842 \$	1 079 842 \$
Instruments financiers dérivés	112	0	0	0	0	112
Trésorerie et devises	0	0	0	0	11 253	11 253
Montants à recevoir	0	0	0	0	7 548	7 548
<b>Total – Actif</b>	<b>112 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>1 098 643 \$</b>	<b>1 098 755 \$</b>

<b>Passif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	(20) \$	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	(20) \$
Montants à payer	0	0	0	0	(9 412)	(9 412)
<b>Total - Passif</b>	<b>(20) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(9 412) \$</b>	<b>(9 432) \$</b>

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si les taux d'intérêt en vigueur avaient progressé ou reculé de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 87 \$ ou 0 % (6 \$, ou 0 %, au 31 décembre 2022). La sensibilité du Fonds à la variation des taux d'intérêt a été estimée d'après la durée moyenne pondérée des instruments de créance. Dans les faits, les résultats des opérations peuvent différer et la différence peut être importante.

#### AUTRE RISQUE DE PRIX

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'était pas exposé à l'autre risque de prix de façon importante, car les fonds sous-jacents détenaient surtout des titres de créance.

#### RISQUE DE LIQUIDITÉ

Les tableaux ci-dessous font état des passifs du Fonds, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, par date de paiement contractuel : moins de trois mois, de trois mois à un an ou plus d'un an, selon le cas.

<b>Passif courant au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	1 017 \$	0 \$	0 \$	1 017 \$
Achats de placements à payer	9	0	0	9
Montants à payer pour l'achat de placements dans des fonds sous-jacents	18 143	0	0	18 143
Montants à payer pour les parts rachetées	37 232	0	0	37 232
Distributions à payer	914	0	0	914
Frais de gestion à payer	709	0	0	709
<b>Total - Passif</b>	<b>58 024 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>58 024 \$</b>

  

<b>Passif courant au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	20 \$	0 \$	0 \$	20 \$
Achats de placements à payer	2	0	0	2
Montants à payer pour l'achat de placements dans des fonds sous-jacents	5 554	0	0	5 554
Montants à payer pour les parts rachetées	2 384	0	0	2 384
Distributions à payer	855	0	0	855
Frais de gestion à payer	617	0	0	617
<b>Total - Passif</b>	<b>9 432 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>9 432 \$</b>

#### RISQUE DE CRÉDIT

Les tableaux ci-dessous résument la composition des notations des instruments financiers du Fonds. Le Fonds peut être exposé à d'autres risques de crédit en raison de ses placements dans les fonds sous-jacents.

	<b>Au 31 décembre 2023</b>	<b>Au 31 décembre 2022</b>
Catégorie investissement	100 %	100 %
Inférieure à la catégorie investissement	0 %	0 %
Sans notation	0 %	0 %
Total (% des placements et des instruments financiers dérivés)	100 %	100 %

Les notations sont fournies par Standard & Poor's Ratings Services (S&P), Moody's Investors Services, Inc. (Moody's), Fitch Ratings, Inc. (Fitch) ou DBRS Limited (DBRS). Lorsqu'il existe plus d'une notation pour un titre, la plus élevée a été retenue. Si la notation d'un instrument n'est pas fournie par l'une de ces agences, un titre reçoit une notation interne. Les notations inférieures à la catégorie investissement sont celles inférieures à Baa3 selon Moody's, à BAA- selon la notation interne, à BBB- selon S&P et Fitch, et à BBBL selon DBRS.

INTÉRÊTS DÉTENUS DANS D'AUTRES ENTITÉS

L'exposition aux placements détenus dans les fonds sous-jacents est présentée dans les tableaux ci-dessous. Ces placements sont compris dans le poste « Placement dans des fonds sous-jacents » de l'état de la situation financière.

<b>Au 31 décembre 2023</b>	<b>Juste valeur du fonds sous-jacent</b>	<b>Placement dans le fonds sous-jacent à la juste valeur</b>	<b>% du fonds sous-jacent détenu</b>
Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO	496 676 \$	285 246 \$	57,43 %
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)	239 675	136 215	56,83
Fonds d'obligations de qualité supérieure PIMCO (Canada)	380 210 USD	186 164	36,95
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada)	23 674 119 \$	609 632	2,58
Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)	79 930	24 805	31,03
<b>Au 31 décembre 2022</b>	<b>Juste valeur du fonds sous-jacent</b>	<b>Placement dans le fonds sous-jacent à la juste valeur</b>	<b>% du fonds sous-jacent détenu</b>
Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO	633 925 \$	247 683 \$	39,07 %
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)	228 342	107 897	47,25
Fonds d'obligations de qualité supérieure PIMCO (Canada)	349 798 USD	140 347	29,63
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada)	21 193 630 \$	540 735	2,55
Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)	117 230	43 180	36,83

## États de la situation financière Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 déc. 2023	31 déc. 2022
<b>Actif :</b>		
Actif courant :		
<i>Placements, à la juste valeur</i>		
Placements dans des titres <sup>†</sup>	22 456 \$	21 968 \$
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	31	13
Hors cote	428	15
Trésorerie	228	272
Dépôts auprès de contreparties	251	230
Devises	27	48
Montants à recevoir pour les parts vendues	26	23
Intérêts et dividendes à recevoir	202	156
	23 649	22 725
<b>Passif :</b>		
Passif courant :		
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	1	9
Hors cote	7	311
Montants à payer pour les parts rachetées	159	37
Distributions à payer	16	15
Frais de gestion à payer	12	12
	195	384
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>23 454 \$</b>	<b>22 341 \$</b>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A	2 101 \$	1 438 \$
Nombre de parts rachetables - série A	234	168
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	8,97 \$	8,55 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F	12 671 \$	13 212 \$
Nombre de parts rachetables - série F	1 412	1 545
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	8,97 \$	8,55 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I	8 682 \$	7 691 \$
Nombre de parts rachetables - série I	968	899
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	8,97 \$	8,55 \$
<sup>†</sup> Comprend les prises en pension de :	2 000 \$	3 100 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États du résultat global Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Revenus :</b>		
<b>Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés</b>		
Intérêts à distribuer	779 \$	564 \$
Revenu (perte) sur instruments dérivés	0	1
Gain (perte) net réalisé à la vente de placements	(735)	(839)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(36)	445
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés hors cote	(565)	(538)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements en portefeuille	1 765	(2 364)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(20)	25
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés hors cote	717	(383)
Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés	1 905	(3 089)
<b>Autres revenus (pertes)</b>		
Gain (perte) net réalisé sur opérations en devises	(34)	338
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente à la conversion des actifs et des passifs libellés en devises	(15)	10
Autres revenus (pertes)	(49)	348
Total - Revenus (pertes)	1 856	(2 741)
<b>Charges :</b>		
Frais de gestion	129	132
Frais liés au CEI	0	0
Retenues d'impôts	0	1
Coûts de transaction	1	1
Total - Charges	130	134
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	1 726 \$	(2 875) \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série</b>		
Série A	126 \$	(244) \$
Série F	937	(1 680)
Série I	663	(951)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part</b>		
Série A	0,66 \$	(1,38) \$
Série F	0,64	(1,14)
Série I	0,67	(1,14)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

	Exercice clos le 31 déc. 2023			
	Série A	Série F	Série I	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	1 438 \$	13 212 \$	7 691 \$	22 341 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	126	937	663	1 726
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>				
Provenant du revenu net de placement	(33)	(326)	(287)	(646)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(33)	(326)	(287)	(646)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>				
Produit de la vente de parts rachetables	1 261	5 365	1 955	8 581
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	32	256	287	575
Coût des parts rachetables rachetées	(723)	(6 773)	(1 627)	(9 123)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	570	(1 152)	615	33
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	663	(541)	991	1 113
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	2 101 \$	12 671 \$	8 682 \$	23 454 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Parts rachetables vendues	145	617	226	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	4	29	33	S.O.
Parts rachetables rachetées	(83)	(779)	(190)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	66	(133)	69	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	168	1 545	899	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	234	1 412	968	S.O.

	Exercice clos le 31 déc. 2022			
	Série A	Série F	Série I	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	1 790 \$	11 244 \$	7 590 \$	20 624 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(244)	(1 680)	(951)	(2 875)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>				
Provenant du revenu net de placement	(17)	(228)	(191)	(436)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(17)	(228)	(191)	(436)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>				
Produit de la vente de parts rachetables	768	10 619	2 470	13 857
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	17	134	191	342
Coût des parts rachetables rachetées	(876)	(6 877)	(1 418)	(9 171)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(91)	3 876	1 243	5 028
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(352)	1 968	101	1 717
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	1 438 \$	13 212 \$	7 691 \$	22 341 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Parts rachetables vendues	84	1 181	269	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	2	16	22	S.O.
Parts rachetables rachetées	(98)	(780)	(154)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(12)	417	137	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	180	1 128	762	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	168	1 545	899	S.O.

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## Tableaux des flux de trésorerie Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)

(en milliers*)	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 726 \$	(2 875)\$
<b>Ajustements au titre du rapprochement de l'augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et des entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation :</b>		
Achats de titres	(604 710)	(320 325)
Produit de la vente de placements	605 286	314 042
(Augmentation) diminution des dépôts auprès de contreparties	(21)	13
(Augmentation) diminution des intérêts et des dividendes à recevoir	(46)	(25)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(82)	461
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés hors cote	(565)	(537)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	0	1
Produit (paiements) au titre des opérations en devises	(49)	348
<i>(Gain) perte nette réalisée</i>		
Placements	735	839
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	36	(445)
Instruments financiers dérivés hors cote	565	538
Opérations en devises	34	(338)
<i>Variation nette de la (plus-value) moins-value latente</i>		
Placements	(1 765)	2 364
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	20	(25)
Instruments financiers dérivés hors cote	(717)	383
Conversion de passifs et d'actifs libellés en devises	15	(10)
Amortissement net des primes (des escomptes) sur les placements	(34)	(18)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation</b>	<b>428</b>	<b>(5 609)</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement :</b>		
Produit de la vente de parts rachetables**	7 695	12 964
Montant payé au titre du rachat de parts rachetables**	(8 118)	(8 231)
Distributions en trésorerie versées aux porteurs de parts rachetables	(70)	(101)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement</b>	<b>(493)</b>	<b>4 632</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des devises</b>	<b>(65)</b>	<b>(977)</b>
<b>Trésorerie (découvert) et devises :</b>		
Ouverture de l'exercice	320	1 297
Clôture de l'exercice	255 \$	320 \$
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	693 \$	524 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

\*\* Ne comprend pas les transferts hors trésorerie entre les séries.

# Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)

31 décembre 2023

(en milliers\*, sauf le nombre d'actions, de contrats, de parts ou d'onces, selon le cas)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES 95,7 %</b>						
<b>AUSTRALIE 0,6 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,6 %</b>						
GPT Wholesale Office Fund No1 3,222 %, échéant le 5 nov. 2031	30 AUD	28 \$	22 \$			
Wesfarmers Ltd. 0,954 %, échéant le 21 oct. 2033	100 EUR	143	118			
Total - Australie		171	140			
<b>AUTRICHE 0,6 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,6 %</b>						
UniCredit Bank Austria AG 3,125 %, échéant le 21 sept. 2029	100 EUR	143	149			
Total - Autriche		143	149			
<b>CANADA 2,1 %</b>						
<b>TITRES DES PROVINCES 1,2 %</b>						
Province d'Ontario 1,550 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2029	200 \$	172	179			
1,850 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2027	100	91	95			
		263	274			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,9 %</b>						
Brookfield Property Finance ULC 7,125 %, échéant le 13 févr. 2028	100	100	99			
Compagnie Crédit Ford du Canada 7,375 %, échéant le 12 mai 2026	100	100	104			
Total - Canada		463	477			
<b>DANEMARK 1,5 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,5 %</b>						
AP Moller - Maersk AS 0,750 %, échéant le 25 nov. 2031	100 EUR	142	120			
5,875 %, échéant le 14 sept. 2033	52 USD	70	72			
TDC Net AS 5,618 %, échéant le 6 févr. 2030	100 EUR	146	151			
Total - Danemark		358	343			
<b>FINLANDE 0,6 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,6 %</b>						
Nordea Bank Abp 1,125 %, échéant le 16 févr. 2027	100 EUR	145	138			
Total - Finlande		145	138			
<b>FRANCE 7,5 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 3,9 %</b>						
BNP Paribas SA 0,500 %, échéant le 4 juin 2026	100 EUR	155	140			
1,675 %, échéant le 30 juin 2027	40 USD	46	48			
BPCE SA 0,500 %, échéant le 14 janv. 2028	100 EUR	143	134			
Crédit Agricole SA 4,375 %, échéant le 27 nov. 2033	100	150	154			
Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement 0,125 %, échéant le 16 sept. 2025	100	149	138			
Kering SA 5,125 %, échéant le 23 nov. 2026	100 GBP	171	172			
Société Générale SA 0,625 %, échéant le 2 déc. 2027	100 EUR	141 \$	134 \$			
		955	920			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 3,6 %</b>						
Agence Française de Développement EPIC 3,500 %, échéant le 25 févr. 2033	100	133	154			
Île-de-France Mobilités 0,675 %, échéant le 24 nov. 2036	100	143	109			
3,700 %, échéant le 14 juin 2038	100	143	154			
Soc Nationale SNCF SACA 3,125 %, échéant le 2 nov. 2027	100	135	148			
Société du Grand Paris EPIC 0,300 %, échéant le 25 nov. 2031	100	142	121			
Société nationale des chemins de fer français SA 3,375 %, échéant le 25 mai 2033	100	146	152			
		842	838			
Total - France		1 797	1 758			
<b>ALLEMAGNE 7,7 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 7,5 %</b>						
Amprion GmbH 3,450 %, échéant le 22 sept. 2027	100 EUR	131	148			
Deutsche Bahn Finance GmbH 3,250 %, échéant le 19 mai 2033	100	146	151			
Deutsche Bank AG 1,875 %, échéant le 23 févr. 2028	100	144	137			
Eurogrid GmbH 3,279 %, échéant le 5 sept. 2031	100	129	146			
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,375 %, échéant le 7 juin 2032	300	375	402			
2,000 %, échéant le 15 nov. 2029	200	261	286			
4,875 %, échéant le 3 févr. 2031	100 GBP	169	181			
Landwirtschaftliche Rentenbank 3,250 %, échéant le 26 sept. 2033	100 EUR	143	155			
Schaeffler AG 3,375 %, échéant le 12 oct. 2028	100	143	142			
		1 641	1 748			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,2 %</b>						
État de la Rhénanie-du-Nord-Westphalie 2,900 %, échéant le 7 juin 2033	25	36	38			
Total - Allemagne		1 677	1 786			
<b>GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES 0,5 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>						
Sirius Real Estate Ltd. 1,750 %, échéant le 24 nov. 2028	100 EUR	141	122			
Total - Guernesey, Îles anglo-normandes		141	122			
<b>HONG KONG 0,7 %</b>						
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,7 %</b>						
Obligations internationales du gouvernement de Hong Kong 3,750 %, échéant le 7 juin 2032	100 EUR	144	153			
Total - Hong Kong		144	153			

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>INDE 0,8 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,8 %</b>							
JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 %, échéant le 18 mai 2031	161 USD	188 \$	186 \$				
Total - Inde		188	186				
<b>IRLANDE 1,3 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,3 %</b>							
AIB Group PLC 5,250 %, échéant le 23 oct. 2031	100 EUR	143	158				
Bank of Ireland Group PLC 4,875 %, échéant le 16 juill. 2028	100	143	153				
Total - Irlande		286	311				
<b>JAPON 1,2 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,6 %</b>							
NTT Finance Corp. 0,399 %, échéant le 13 déc. 2028	100 EUR	144	130				
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,6 %</b>							
Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 %, échéant le 22 févr. 2028	100	143	150				
Total - Japon		287	280				
<b>JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES 0,2 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>							
Aptiv PLC 3,100 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2051	50 USD	61	43				
Total - Jersey, îles anglo-normandes		61	43				
<b>LUXEMBOURG 2,1 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 2,1 %</b>							
Acef Holding SCA 0,750 %, échéant le 14 juin 2028	100 EUR	146	126				
CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,900 %, échéant le 12 oct. 2029	100	145	122				
Logicor Financier SARL 2,000 %, échéant le 17 janv. 2034	100	141	115				
Prologis International Funding SA 0,750 %, échéant le 23 mars 2033	125	187	140				
Total - Luxembourg		619	503				
<b>MULTINATIONAL 0,2 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>							
NXP BV 2,500 %, échéant le 11 mai 2031	40 USD	49	45				
Total - Multinational		49	45				
<b>PAYS-BAS 11,4 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 9,3 %</b>							
ABN AMRO Bank NV 2,470 %, échéant le 13 déc. 2029	200 USD	226	233				
CTP NV 0,625 %, échéant le 27 sept. 2026	100 EUR	150	132				
1,250 %, échéant le 21 juin 2029	100	146	121				
Digital Dutch Finco BV 1,000 %, échéant le 15 janv. 2032	100	151	117				
Enel Finance International NV 0,875 %, échéant le 28 sept. 2034	100	150	110				
ING Groep NV 4,875 %, échéant le 16 mai 2029 <sup>(c), (d)</sup>	200 USD	263 \$	220 \$				
JAB Holdings BV 4,750 %, échéant le 29 juin 2032	100 EUR	137	156				
LeasePlan Corp. NV 0,250 %, échéant le 7 sept. 2026	100 EUR	148	135				
3,500 %, échéant le 9 avr. 2025	100	173	146				
Lseg Netherlands BV 4,231 %, échéant le 29 sept. 2030	100	143	155				
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0,625 %, échéant le 9 sept. 2032	100	148	119				
Nationale-Nederlanden Bank NV 0,500 %, échéant le 21 sept. 2028	100	149	129				
Vesteda Finance BV 0,750 %, échéant le 18 oct. 2031	100	143	118				
Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 %, échéant le 3 déc. 2027	100	151	135				
ZF Europe Finance BV 6,125 %, échéant le 13 mars 2029	100	146	156				
		2 424	2 182				
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 1,3 %</b>							
Green Lion BV 4,440 %, échéant le 23 juill. 2065	100	146	147				
Green STORM BV 4,712 %, échéant le 22 févr. 2068	100	153	147				
		299	294				
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,8 %</b>							
Nederlandse Waterschapsbank NV 3,000 %, échéant le 20 avr. 2033	100	146	150				
Obligations internationales du gouvernement des Pays-Bas 3,250 %, échéant le 15 janv. 2044	25	36	41				
		182	191				
Total - Pays-Bas		2 905	2 667				
<b>NORVÈGE 0,6 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,6 %</b>							
DNB Bank ASA 4,500 %, échéant le 19 juill. 2028	100 EUR	147	151				
Total - Norvège		147	151				
<b>ESPAGNE 1,9 %</b>							
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,3 %</b>							
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 5,125 %, échéant le 23 avr. 2031	100 EUR	143	155				
EDP Servicios Financieros Espana SA 4,375 %, échéant le 4 avr. 2032	100	141	156				
		284	311				
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,6 %</b>							
Communauté autonome de Madrid 3,596 %, échéant le 30 avr. 2033	50	71	76				
Instituto de Credito Oficial 3,050 %, échéant le 31 oct. 2027	50 EUR	72	74				
		143	150				
Total - Espagne		427	461				

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>SUPRANATIONAL 4,6 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 3,8 %</b>			
<b>Banque européenne d'investissement</b>			
0,750 %, échéant le 15 juill. 2027	400 AUD	303 \$	321 \$
3,750 %, échéant le 14 févr. 2033	260 USD	347	338
<b>Banque internationale pour la reconstruction et le développement</b>			
3,100 %, échéant le 14 avr. 2038	100 EUR	146	151
<b>International Development Association</b>			
0,750 %, échéant le 21 sept. 2028	50 GBP	87	74
		<u>883</u>	<u>884</u>
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,8 %</b>			
<b>Union européenne</b>			
0,400 %, échéant le 4 févr. 2037	50 EUR	71	54
2,625 %, échéant le 4 févr. 2048	90	118	123
		<u>189</u>	<u>177</u>
Total - Supranational		<u>1 072</u>	<u>1 061</u>
<b>SWEDEN 0,6 %</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,6 %</b>			
<b>Swedish Export Credit Corp.</b>			
2,000 %, échéant le 30 juin 2027	100 EUR	137	143
Total - Suède		<u>137</u>	<u>143</u>
<b>ROYAUME-UNI 9,0 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 9,0 %</b>			
<b>Berkeley Group PLC</b>			
2,500 %, échéant le 11 août 2031	100 GBP	173	131
<b>Chanel Ceres PLC</b>			
1,000 %, échéant le 31 juill. 2031	100 EUR	149	123
<b>Grainger PLC</b>			
3,000 %, échéant le 3 juill. 2030	100 GBP	186	145
<b>Marks &amp; Spencer PLC</b>			
4,500 %, échéant le 10 juill. 2027	100	186	163
<b>National Grid PLC</b>			
3,875 %, échéant le 16 janv. 2029	100 EUR	144	151
<b>NatWest Group PLC</b>			
2,057 %, échéant le 9 nov. 2028	200 GBP	316	302
<b>Reckitt Benckiser Treasury Services PLC</b>			
1,750 %, échéant le 19 mai 2032	100	177	142
<b>Santander U.K. Group Holdings PLC</b>			
2,896 %, échéant le 15 mars 2032	200 USD	259	227
<b>Severn Trent Utilities Finance PLC</b>			
2,625 %, échéant le 22 févr. 2033	100 GBP	171	142
<b>South Eastern Power Networks PLC</b>			
1,750 %, échéant le 30 sept. 2034	100	174	128
<b>Standard Chartered PLC</b>			
0,800 %, échéant le 17 nov. 2029	200 EUR	262	255
<b>Vmed O2 U.K. Financing PLC</b>			
4,750 %, échéant le 15 juill. 2031	45 USD	57	53
<b>Vodafone Group PLC</b>			
5,125 %, échéant le 4 juin 2081	10	12	10
<b>Workspace Group PLC</b>			
2,250 %, échéant le 11 mars 2028	100 GBP	176	145
Total - Royaume-Uni		<u>2 442</u>	<u>2 117</u>

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>ÉTATS-UNIS 26,0 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 3,9 %</b>			
<b>BMW Vehicle Lease Trust</b>			
5,950 %, échéant le 25 août 2025	50 USD	68 \$	67 \$
5,990 %, échéant le 25 sept. 2026	50	69	67
<b>GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust</b>			
2,100 %, échéant le 20 mai 2048	37	45	38
4,000 %, échéant le 20 avr. 2049	44	55	51
4,950 %, échéant le 20 juill. 2049	90	117	110
<b>Helios Issuer LLC</b>			
5,750 %, échéant le 20 déc. 2050	98	132	134
<b>Loanpal Solar Loan Ltd.</b>			
2,220 %, échéant le 20 mars 2048	18	22	17
<b>Sunnova Sol Issuer LLC</b>			
2,790 %, échéant le 22 févr. 2049	88	110	104
<b>Sunrun Demeter Issuer</b>			
2,270 %, échéant le 30 janv. 2057	179	229	201
<b>Tesla Auto Lease Trust</b>			
5,860 %, échéant le 20 août 2025	100	132	133
		<u>979</u>	<u>922</u>
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 18,1 %</b>			
<b>AES Corp.</b>			
2,450 %, échéant le 15 janv. 2031	100	106	111
<b>Alexandria Real Estate Equities, Inc.</b>			
2,000 %, échéant le 18 mai 2032	50	61	53
<b>Avangrid, Inc.</b>			
3,200 %, échéant le 15 avr. 2025	100	137	129
<b>Bank of America Corp.</b>			
2,456 %, échéant le 22 oct. 2025	100	133	129
4,134 %, échéant le 12 juin 2028	100 EUR	144	151
6,204 %, échéant le 10 nov. 2028	40 USD	54	55
<b>Boston Properties LP</b>			
6,500 %, échéant le 15 janv. 2034	30	40	42
<b>CBRE Services, Inc.</b>			
2,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2031	30	37	34
<b>CenterPoint Energy Houston Electric LLC</b>			
5,300 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2053	25	34	35
<b>Continental Wind LLC</b>			
6,000 %, échéant le 28 févr. 2033	52	71	70
<b>DTE Electric Co.</b>			
3,650 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2052	50	54	52
<b>Duke Energy Florida LLC</b>			
2,400 %, échéant le 15 déc. 2031	50	64	56
<b>Equinix, Inc.</b>			
3,900 %, échéant le 15 avr. 2032	50	62	61
<b>Equitable Financial Life Global Funding</b>			
1,300 %, échéant le 12 juill. 2026	50	62	60
<b>Ford Motor Co.</b>			
6,100 %, échéant le 19 août 2032	54	69	72
<b>Gap, Inc.</b>			
3,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2029	110	126	125
<b>Goodman U.S. Finance Five LLC</b>			
4,625 %, échéant le 4 mai 2032	100	128	123
<b>Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp.</b>			
5,000 %, échéant le 27 juill. 2028	200	262	268
<b>HAT Holdings LLC</b>			
3,750 %, échéant le 15 sept. 2030	100	126	112

## Inventaire du portefeuille Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Healthpeak OP LLC</b> 2,125 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2028	50 USD	62 \$	58 \$	<b>Verizon Communications, Inc.</b> 5,050 %, échéant le 9 mai 2033	100 USD	134 \$	135 \$
<b>Host Hotels &amp; Resorts LP</b> 2,900 %, échéant le 15 déc. 2031 3,375 %, échéant le 15 déc. 2029	50 100	61 127	56 119	<b>Weyerhaeuser Co.</b> 7,375 %, échéant le 15 mars 2032	15	27	23
<b>Hudson Pacific Properties LP</b> 5,950 %, échéant le 15 févr. 2028	50	65	59	<b>Wisconsin Power &amp; Light Co.</b> 4,950 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2033	8	11	11
<b>IHG Finance LLC</b> 4,375 %, échéant le 28 nov. 2029	100 EUR	149	152	<b>Wisconsin Public Service Corp.</b> 2,850 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2051	50	62	44
<b>John Deere Capital Corp.</b> 3,350 %, échéant le 18 avr. 2029	50 USD	63	63			<u>4 498</u>	<u>4 255</u>
<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b> 6,070 %, échéant le 22 oct. 2027	200	275	273	<b>OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX 0,2 %</b>			
<b>Micron Technology, Inc.</b> 2,703 %, échéant le 15 avr. 2032	25	31	28	<b>University of Michigan, obligations-recettes, série 2022</b> 3,504 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2052	50 USD	64	55
<b>MidAmerican Energy Co.</b> 2,700 %, échéant le 1 <sup>er</sup> août 2052	50	63	43	<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 1,0 %</b>			
<b>Mississippi Power Co.</b> 3,100 %, échéant le 30 juill. 2051	50	61	44	<b>JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b> 6,276 %, échéant le 15 avr. 2038	94	119	124
<b>Moody's Corp.</b> 2,000 %, échéant le 19 août 2031 3,100 %, échéant le 29 nov. 2061	50 30	62 37	55 27	<b>VASA Trust</b> 6,376 %, échéant le 15 juill. 2039	100	125	120
<b>MSCI, Inc.</b> 3,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> sept. 2030	200	220	240			<u>244</u>	<u>244</u>
<b>New York State Electric &amp; Gas Corp.</b> 2,150 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2031	100	128	106	<b>ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX AMÉRICAINS 2,2 %</b>			
<b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b> 1,900 %, échéant le 15 juin 2028	100	120	118	<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme</b> 5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2053	397	503	520
<b>NSTAR Electric Co.</b> 3,100 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2051	30	36	28	<b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR DES ÉTATS-UNIS 0,6 %</b>			
<b>Oberlin College</b> 2,874 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2051	75	95	65	<b>Obligations du Trésor des États-Unis</b> 3,625 %, échéant le 31 mars 2030	100	127	131
<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b> 6,700 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2053	21	28	30	Total - États-Unis		<u>6 415</u>	<u>6 127</u>
<b>PacifiCorp</b> 2,900 %, échéant le 15 juin 2052	160	153	137	<b>INSTRUMENTS À COURT TERME 14,0 %</b>			
<b>Principal Life Global Funding</b> 1,250 %, échéant le 16 août 2026	50	62	60	<b>PRISES EN PENSION<sup>e)</sup> 8,5 %</b>			
<b>Public Service Co. of Colorado</b> 2,700 %, échéant le 15 janv. 2051 3,200 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mars 2050	50 100	60 93	42 95			<u>2 000</u>	<u>2 000</u>
<b>Public Service Electric &amp; Gas Co.</b> 3,100 %, échéant le 15 mars 2032 4,650 %, échéant le 15 mars 2033	50 50	64 69	59 66	<b>BONS DU TRÉSOR DES ÉTATS-UNIS 5,5 %</b>			
<b>Southwestern Public Service Co.</b> 3,750 %, échéant le 15 juin 2049	50	51	51	<b>5,386 %, échéant le 13 juin 2024<sup>a), b)</sup></b> 1 000 USD		1 289	1 295
<b>TerraForm Power Operating LLC</b> 5,000 %, échéant le 31 janv. 2028	100	140	129	Total - Placements à court terme		<u>3 289</u>	<u>3 295</u>
<b>UDR, Inc.</b> 1,900 %, échéant le 15 mars 2033	100	119	101	Total - Placements dans des titres		<u>23 363</u>	<u>22 456</u>
				<b>Total - Placements 95,7 %</b>		<b><u>23 363</u> \$</b>	<b><u>22 456</u> \$</b>
				<b>Instruments financiers dérivés<sup>f), g)</sup> 1,9 %</b>		0	451
				<b>Autres actifs, moins les passifs 2,4 %</b>			547
				<b>Total de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables 100,0 %</b>			<b><u>23 454</u> \$</b>

### NOTES À L'INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE :

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

a) Titre à coupon zéro.

b) Coupon représentant un rendement à l'échéance.

c) Titre perpétuel; la date indiquée, le cas échéant, est la prochaine date de remboursement anticipé.

d) Titre convertible conditionnel.

## EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

## e) PRISES EN PENSION

Contrepartie	Taux de financement	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du capital	Garanti par	Garanties (reçues)	Prises en pension, à la valeur	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>
TOR	4,980 %	29 déc. 2023	2 janv. 2024	2 000 \$	Obligation du gouvernement du Canada, 4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2025	(2 043) \$	2 000 \$	2 001 \$
<b>Total - Prises en pension de titres</b>						<b>(2 043) \$</b>	<b>2 000 \$</b>	<b>2 001 \$</b>

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et des autres opérations de financement et des garanties données/(reçues).

## f) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE

## CONTRATS À TERME :

Description	Type	Mois de l'échéance	Nombre de contrats	Plus-value/(moins-value) latente	Marge de variation	
					Actif	Passif
Contrats à terme Euro-Bund, mars	Position courte	Mars 2024	5	(30) \$	10 \$	0 \$
Contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans, mars	Position courte	Mars 2024	1	(17)	6	0
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 5 ans, mars	Position longue	Mars 2024	21	70	2	0
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position longue	Mars 2024	21	103	0	0
Contrats à terme Ultra sur obligations à long terme du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position longue	Mars 2024	7	47	0	(1)
Contrats à terme Ultra sur obligations à long terme du Trésor des É.-U., mars	Position courte	Mars 2024	4	(62)	3	0
Contrats à terme sur obligations du Royaume-Uni à long terme, mars	Position courte	Mars 2024	3	(26)	6	0
<b>Total des contrats à terme</b>				<b>85 \$</b>	<b>27 \$</b>	<b>(1) \$</b>

## SWAPS :

## SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Plus-value/(moins-value) latente	Juste valeur	Marge de variation	
						Actif		Passif
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,250 %	20 mars 2029	200 EUR	(8) \$	(12) \$	1 \$	0 \$
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	2,750	20 mars 2054	90	(14)	(13)	3	0
<b>Total des swaps</b>					<b>(22) \$</b>	<b>(25) \$</b>	<b>4 \$</b>	<b>0 \$</b>

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée.

## g) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE

## CONTRATS DE CHANGE À TERME :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/(moins-value) latente	
				Actif	Passif
CBK	Janv. 2024	43 \$	32 USD	0 \$	(1) \$
	Janv. 2024	30 GBP	51 \$	1	0
	Janv. 2024	720 USD	979	24	0
GLM	Janv. 2024	31 \$	23 USD	0	0
	Janv. 2024	1 290 EUR	1 910 \$	22	0
	Janv. 2024	971 GBP	1 671	31	0
MBC	Janv. 2024	5 776 USD	7 848	196	0
	Janv. 2024	28	38	1	0
MYI	Janv. 2024	571	753	0	(4)
	Janv. 2024	255 AUD	229	0	(1)
SCX	Janv. 2024	138 \$	94 EUR	0	0
	Janv. 2024	111	12 100 JPY	3	0
	Janv. 2024	65	49 USD	0	0
	Janv. 2024	19 CHF	29 \$	0	(1)
	Janv. 2024	5 126 EUR	7 649	150	0
	Janv. 2024	8 GBP	14	0	0
<b>Total des contrats de change à terme</b>				<b>428 \$</b>	<b>(7) \$</b>

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues).

## Notes annexes propres au Fonds Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

### SOMMAIRE DES EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA) TOR	2 001 \$	0 \$	0 \$	2 001 \$	(2 043) \$	(42) \$
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement</b>	<b>2 001 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA) TOR	3 101 \$	0 \$	0 \$	3 101 \$	(3 162) \$	(61) \$
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement</b>	<b>3 101 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

<sup>2)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux emprunts et autres opérations de financement ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2023 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0 \$	27 \$	4 \$	31 \$	0 \$	(1) \$	0 \$	(1) \$

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2022 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0 \$	11 \$	2 \$	13 \$	0 \$	(9) \$	0 \$	(9) \$

**Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2023 :**

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
CBK	25 \$	0 \$	0 \$	25 \$	(1) \$	0 \$	0 \$	(1) \$	24 \$	0 \$	24 \$
GLM	249	0	0	249	0	0	0	0	249	0	249
MBC	1	0	0	1	0	0	0	0	1	0	1
MYI	0	0	0	0	(4)	0	0	(4)	(4)	0	(4)
SCX	153	0	0	153	(2)	0	0	(2)	151	0	151
<b>Total - Hors cote</b>	<b>428 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>428 \$</b>	<b>(7) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(7) \$</b>			

**Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2022 :**

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
AZD	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	(1) \$	0 \$	0 \$	(1) \$	(1) \$	0 \$	(1) \$
BOA	2	0	0	2	(48)	0	0	(48)	(46)	0	(46)
CBK	0	0	0	0	(241)	0	0	(241)	(241)	0	(241)
JPM	2	0	0	2	(1)	0	0	(1)	1	0	1
MBC	3	0	0	3	(1)	0	0	(1)	2	0	2
SCX	8	0	0	8	(19)	0	0	(19)	(11)	0	(11)
<b>Total - Hors cote</b>	<b>15 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>15 \$</b>	<b>(311) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(311) \$</b>			

<sup>1)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux instruments financiers dérivés hors cote ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

## ÉVALUATIONS DE LA JUSTE VALEUR

**Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2023 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :**

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Australie				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	140 \$	0 \$	140 \$
Autriche				
Obligations et billets de sociétés	0	149	0	149
Canada				
Titres provinciaux	0	274	0	274
Obligations et billets de sociétés	0	203	0	203
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0	343	0	343
Finlande				
Obligations et billets de sociétés	0	138	0	138
France				
Obligations et billets de sociétés	0	920	0	920
Émissions souveraines	0	838	0	838
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	1 748	0	1 748
Émissions souveraines	0	38	0	38
Guernesey, îles anglo-normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	122	0	122
Hong Kong				
Émissions souveraines	0	153	0	153
Inde				
Obligations et billets de sociétés	0	186	0	186
Irlande				
Obligations et billets de sociétés	0	311	0	311
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	130	0	130
Émissions souveraines	0	150	0	150

## Notes annexes propres au Fonds Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada) (suite)

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
Jersey, îles Anglo-Normandes				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	43 \$	0 \$	43 \$
Luxembourg				
Obligations et billets de sociétés	0	503	0	503
Multinational				
Obligations et billets de sociétés	0	45	0	45
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	2 182	0	2 182
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	294	0	294
Émissions souveraines	0	191	0	191
Norvège				
Obligations et billets de sociétés	0	151	0	151
Espagne				
Obligations et billets de sociétés	0	311	0	311
Émissions souveraines	0	150	0	150
Supranational				
Obligations et billets de sociétés	0	884	0	884
Émissions souveraines	0	177	0	177
Suède				
Émissions souveraines	0	143	0	143
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	2 117	0	2 117
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	922	0	922
Obligations et billets de sociétés	0	4 255	0	4 255
Obligations et billets municipaux	0	55	0	55
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	244	0	244
Organismes gouvernementaux américains	0	520	0	520
Obligations du Trésor américain	0	131	0	131
Instruments à court terme				
Prises en pension	0	2 000	0	2 000
Bons du Trésor des États-Unis	0	1 295	0	1 295
Total - Placements	0 \$	22 456 \$	0 \$	22 456 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	22	9	0	31
Hors cote	0	428	0	428
	22 \$	437 \$	0 \$	459 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	(1)	0	(1)
Hors cote	0	(7)	0	(7)
	0 \$	(8) \$	0 \$	(8) \$
Total - Instruments financiers dérivés	22 \$	429 \$	0 \$	451 \$
Totaux	22 \$	22 885 \$	0 \$	22 907 \$

**Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2022 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :**

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Australie				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	127 \$	0 \$	127 \$
Canada				
Titres du gouvernement fédéral	0	75	0	75
Titres provinciaux	0	93	0	93
Obligations et billets de sociétés	0	42	0	42
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0	109	0	109
Finlande				
Obligations et billets de sociétés	0	132	0	132
France				
Obligations et billets de sociétés	0	1 316	0	1 316
Émissions souveraines	0	495	0	495
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	1 676	0	1 676

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
Guernesey, îles anglo-normandes				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	100 \$	0 \$	100 \$
Inde				
Obligations et billets de sociétés	0	655	0	655
Irlande				
Obligations et billets de sociétés	0	124	0	124
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0	121	0	121
Japon				
Obligations et billets de sociétés	0	386	0	386
Jersey, îles Anglo-Normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	166	0	166
Luxembourg				
Obligations et billets de sociétés	0	530	0	530
Multinational				
Obligations et billets de sociétés	0	289	0	289
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	1 909	0	1 909
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	146	0	146
Corée du Sud				
Émissions souveraines	0	261	0	261
Espagne				
Obligations et billets de sociétés	0	361	0	361
Supranational				
Obligations et billets de sociétés	0	538	0	538
Suède				
Obligations et billets de sociétés	0	128	0	128
Émissions souveraines	0	137	0	137
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	1 860	0	1 860
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	545	0	545
Obligations et billets de sociétés	0	4 698	0	4 698
Obligations et billets municipaux	0	53	0	53
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	250	0	250
Obligations du Trésor américain	0	487	0	487
Îles Vierges britanniques				
Obligations et billets de sociétés	0	208	0	208
Instruments à court terme				
Prises en pension	0	3 100	0	3 100
Bons du Trésor du Canada	0	598	0	598
Bons du Trésor d'Autriche	0	253	0	253
Total - Placements	0 \$	21 968 \$	0 \$	21 968 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	9	4	0	13
Hors cote	0	15	0	15
	9 \$	19 \$	0 \$	28 \$
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(4)	(5)	0	(9)
Hors cote	0	(311)	0	(311)
	(4) \$	(316) \$	0 \$	(320) \$
Total - Instruments financiers dérivés	5 \$	(297) \$	0 \$	(292) \$
Totaux	5 \$	21 671 \$	0 \$	21 676 \$

Il n'y a eu aucun transfert significatif entre les niveaux 1, 2 ou 3 pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

CONCENTRATION DU PORTEFEUILLE

Le portefeuille de placements du Fonds est concentré dans les segments suivants :

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Australie	0,6 %	0,6 %
Autriche	0,6 %	0,0 %
Canada	2,1 %	1,0 %
Danemark	1,5 %	0,5 %
Finlande	0,6 %	0,6 %
France	7,5 %	8,1 %
Allemagne	7,7 %	7,5 %
Guernesey, Îles anglo-normandes	0,5 %	0,5 %
Hong Kong	0,7 %	0,0 %
Inde	0,8 %	2,9 %
Irlande	1,3 %	0,6 %
Italie	0,0 %	0,5 %
Japon	1,2 %	1,7 %
Jersey, Îles Anglo-Normandes	0,2 %	0,7 %
Luxembourg	2,1 %	2,4 %
Multinational	0,2 %	1,3 %
Pays-Bas	11,4 %	9,2 %
Norvège	0,6 %	0,0 %
Corée du Sud	0,0 %	1,2 %
Espagne	1,9 %	1,6 %
Supranational	4,6 %	2,4 %
Suède	0,6 %	1,2 %
Royaume-Uni	9,0 %	8,3 %
États-Unis	26,0 %	26,9 %
Îles Vierges britanniques	0,0 %	0,9 %
Instruments à court terme	14,0 %	17,7 %
Instruments financiers dérivés	1,9 %	(1,3) %
Autres actifs, moins les passifs	2,4 %	3,0 %
Total (% de l'actif net)	100,0 %	100,0 %

RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

RISQUE DE CHANGE

Les tableaux ci-dessous indiquent l'exposition globale au risque de change, sauf celui afférent à la monnaie fonctionnelle du Fonds.

Au 31 décembre 2023	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Dollar australien	345 \$	(275) \$	70 \$	Dollar australien	22 \$	(21) \$	1 \$
Livre sterling	1 707	(1 750)	(43)	Livre sterling	1 440	(1 469)	(29)
Euro	9 410	(9 480)	(70)	Euro	8 089	(8 168)	(79)
Yen japonais	1	114	115	Yen japonais	0	0	0
Peso mexicain	0	0	0	Peso mexicain	0	1	1
Franc suisse	1	(30)	(29)	Franc suisse	0	0	0
Dollar américain	8 917	(8 942)	(25)	Dollar américain	8 876	(8 939)	(63)
	20 381 \$	(20 363) \$	18 \$		18 427 \$	(18 596) \$	(169) \$

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport aux autres monnaies, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 1 \$ [(8) \$ au 31 décembre 2022]. Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

## RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt. Ils incluent les instruments financiers du Fonds à la juste valeur, classés en fonction de la date d'échéance. Certains actifs ou passifs figurant dans l'état de la situation financière, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, ont été regroupés pour permettre la présentation ci-dessous.

<b>Actif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	2 000 \$	1 295 \$	6 264 \$	12 897 \$	0 \$	22 456 \$
Instruments financiers dérivés	428	0	0	4	27	459
Trésorerie et devises	0	0	0	0	255	255
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	251	251
Montants à recevoir	0	0	0	0	228	228
<b>Total - Actif</b>	<b>2 428 \$</b>	<b>1 295 \$</b>	<b>6 264 \$</b>	<b>12 901 \$</b>	<b>761 \$</b>	<b>23 649 \$</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	(7) \$	0 \$	0 \$	0 \$	(1) \$	(8) \$
Montants à payer	0	0	0	0	(187)	(187)
<b>Total - Passif</b>	<b>(7) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(188) \$</b>	<b>(195) \$</b>

  

<b>Actif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	3 952 \$	0 \$	4 333 \$	13 683 \$	0 \$	21 968 \$
Instruments financiers dérivés	15	0	0	2	11	28
Trésorerie et devises	0	0	0	0	320	320
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	230	230
Montants à recevoir	0	0	0	0	179	179
<b>Total - Actif</b>	<b>3 967 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>4 333 \$</b>	<b>13 685 \$</b>	<b>740 \$</b>	<b>22 725 \$</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	(311) \$	0 \$	0 \$	0 \$	(9) \$	(320) \$
Montants à payer	0	0	0	0	(64)	(64)
<b>Total - Passif</b>	<b>(311) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(73) \$</b>	<b>(384) \$</b>

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si les taux d'intérêt en vigueur avaient progressé ou reculé de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 1 117 \$ ou 4,8 % (1 064 \$, ou 4,8 %, au 31 décembre 2022). La sensibilité du Fonds à la variation des taux d'intérêt a été estimée d'après la durée moyenne pondérée des instruments de créance. Dans les faits, les résultats des opérations peuvent différer et la différence peut être importante.

## AUTRE RISQUE DE PRIX

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'était pas exposé à l'autre risque de prix de façon importante, car il détenait surtout des titres de créance.

## RISQUE DE LIQUIDITÉ

Les tableaux ci-dessous font état des passifs du Fonds par date de paiement contractuel : moins de trois mois, de trois mois à un an ou plus d'un an, selon le cas.

<b>Passif courant au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	8 \$	0 \$	0 \$	8 \$
Montants à payer pour les parts rachetées	159	0	0	159
Distributions à payer	16	0	0	16
Frais de gestion à payer	12	0	0	12
<b>Total - Passif</b>	<b>195 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>195 \$</b>

  

<b>Passif courant au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	320 \$	0 \$	0 \$	320 \$
Montants à payer pour les parts rachetées	37	0	0	37
Distributions à payer	15	0	0	15
Frais de gestion à payer	12	0	0	12
<b>Total - Passif</b>	<b>384 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>384 \$</b>

## RISQUE DE CRÉDIT

Les tableaux ci-dessous résument la composition des notations des instruments financiers du Fonds.

	<b>Au 31 décembre 2023</b>	<b>Au 31 décembre 2022</b>
Catégorie investissement	95 %	88 %
Inférieur à la catégorie investissement	5 %	12 %
Sans notation	0 %	0 %
Total (% des placements et des instruments financiers dérivés)	100 %	100 %

Les notations sont fournies par Standard & Poor's Ratings Services (S&P), Moody's Investors Services, Inc. (Moody's), Fitch Ratings, Inc. (Fitch) ou DBRS Limited (DBRS). Lorsqu'il existe plus d'une notation pour un titre, la plus élevée a été retenue. Si la notation d'un instrument n'est pas fournie par l'une de ces agences, un titre reçoit une notation interne. Les notations inférieures à la catégorie investissement sont celles inférieures à Baa3 selon Moody's, à BAA- selon la notation interne, à BBB- selon S&P et Fitch, et à BBBL selon DBRS.

## RISQUE D'INVESTISSEMENT LIÉ AUX CHANGEMENTS CLIMATIQUES

Le risque d'investissement lié aux changements climatiques s'entend du risque que la performance du Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada) soit différente de celle d'autres fonds qui n'utilisent pas de stratégie de placement liée aux changements climatiques puisque le Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada) peut sélectionner ou exclure des titres de certains émetteurs pour des raisons autres que le rendement en vertu de cette stratégie. L'investissement lié aux changements climatiques est, par nature, qualitatif et subjectif. Il n'y a aucune garantie que les facteurs utilisés par PIMCO ni que le jugement exercé par PIMCO refléteront l'opinion d'un investisseur particulier.

## États de la situation financière Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 déc. 2023	31 déc. 2022
<b>Actif :</b>		
Actif courant :		
<i>Placements, à la juste valeur</i>		
Placements dans des titres <sup>†</sup>	65 360 \$	56 237 \$
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	60	28
Hors cote	1 278	142
Trésorerie	543	246
Dépôts auprès de contreparties	586	346
Devises	176	133
Montants à recevoir pour les placements vendus	6 384	8 623
Montants à recevoir pour les parts vendues	33	286
Intérêts et dividendes à recevoir	385	312
	74 805	66 353
<b>Passif :</b>		
Passif courant :		
<i>Emprunts et autres opérations de financement</i>		
Montant à payer pour les ventes à découvert, à la juste valeur	2 231	0
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	15	10
Hors cote	49	503
Achats de placements à payer	5 874	16 775
Dépôts de contreparties	371	0
Montants à payer pour les parts rachetées	0	140
Distributions à payer	76	32
Frais de gestion à payer	48	33
	8 664	17 493
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>66 141 \$</b>	<b>48 860 \$</b>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A	7 206 \$	4 894 \$
Nombre de parts rachetables - série A	790	533
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	9,13 \$	9,18 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F	55 934 \$	39 131 \$
Nombre de parts rachetables - série F	6 129	4 262
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	9,13 \$	9,18 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I	3 001 \$	4 835 \$
Nombre de parts rachetables - série I	329	527
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	9,13 \$	9,18 \$
<sup>†</sup> Comprend les prises en pension de :	800 \$	2 800 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États du résultat global Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Revenus :</b>		
<b>Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés</b>		
Intérêts à distribuer	2 878 \$	1 688 \$
Revenu (perte) sur instruments dérivés	(14)	4
Gain (perte) net réalisé à la vente de placements	(553)	(251)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	154	1 359
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés hors cote	(1 327)	(934)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements en portefeuille	(164)	(3 347)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	53	132
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés hors cote	1 579	(431)
Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés	2 606	(1 780)
<b>Autres revenus (pertes)</b>		
Gain (perte) net réalisé sur opérations en devises	250	(619)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente à la conversion des actifs et des passifs libellés en devises	61	(53)
Autres revenus (pertes)	311	(672)
Total - Revenus (pertes)	2 917	(2 452)
<b>Charges :</b>		
Frais de gestion	453	360
Frais liés au CEI	0	0
Charges d'intérêts	6	9
Retenues d'impôts	1	0
Coûts de transaction	1	0
Total - Charges	461	369
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	2 456 \$	(2 821) \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série</b>		
Série A	207 \$	(221) \$
Série F	2 083	(2 278)
Série I	166	(322)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part</b>		
Série A	0,31 \$	(0,60) \$
Série F	0,42	(0,56)
Série I	0,36	(0,55)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

	Exercice clos le 31 déc. 2023			
	Série A	Série F	Série I	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	4 894 \$	39 131 \$	4 835 \$	48 860 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	207	2 083	166	2 456
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>				
Provenant du revenu net de placement	(230)	(2 004)	(216)	(2 450)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(230)	(2 004)	(216)	(2 450)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>				
Produit de la vente de parts rachetables	4 475	26 313	0	30 788
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	207	1 375	216	1 798
Coût des parts rachetables rachetées	(2 347)	(10 964)	(2 000)	(15 311)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	2 335	16 724	(1 784)	17 275
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	2 312	16 803	(1 834)	17 281
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	7 206 \$	55 934 \$	3 001 \$	66 141 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Parts rachetables vendues	493	2 917	0	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	23	151	24	S.O.
Parts rachetables rachetées	(259)	(1 201)	(222)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	257	1 867	(198)	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	533	4 262	527	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	790	6 129	329	S.O.

	Exercice clos le 31 déc. 2022			
	Série A	Série F	Série I	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	2 652 \$	24 648 \$	6 657 \$	33 957 \$
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(221)	(2 278)	(322)	(2 821)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>				
Provenant du revenu net de placement	(78)	(1 067)	(193)	(1 338)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(78)	(1 067)	(193)	(1 338)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>				
Produit de la vente de parts rachetables	3 445	45 650	0	49 095
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	72	636	193	901
Coût des parts rachetables rachetées	(976)	(28 458)	(1 500)	(30 934)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	2 541	17 828	(1 307)	19 062
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	2 242	14 483	(1 822)	14 903
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	4 894 \$	39 131 \$	4 835 \$	48 860 \$
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Parts rachetables vendues	365	4 823	0	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	8	68	21	S.O.
Parts rachetables rachetées	(104)	(3 083)	(157)	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	269	1 808	(136)	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	264	2 454	663	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	533	4 262	527	S.O.

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## Tableaux des flux de trésorerie Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)

(en milliers*)	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 456 \$	(2 821) \$
<b>Ajustements au titre du rapprochement de l'augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et des entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation :</b>		
Achats de titres	(1 711 028)	(217 608)
Produit de la vente de placements	1 692 702	198 994
(Augmentation) diminution des dépôts auprès de contreparties	(240)	(127)
(Augmentation) diminution des intérêts et des dividendes à recevoir	(73)	(121)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	180	1 457
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés hors cote	(1 338)	(914)
Augmentation (diminution) des dépôts de contreparties	371	(197)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	15	12
Produit des opérations de vente à découvert	34 831	7 344
Paiements au titre des opérations de vente à découvert	(32 587)	(7 344)
Produit (paiements) au titre des opérations en devises	311	(675)
<i>(Gain) perte nette réalisée</i>		
Placements	553	251
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(154)	(1 359)
Instruments financiers dérivés hors cote	1 327	934
Opérations en devises	(250)	619
<i>Variation nette de la (plus-value) moins-value latente</i>		
Placements	164	3 347
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(53)	(132)
Instruments financiers dérivés hors cote	(1 579)	431
Conversion de passifs et d'actifs libellés en devises	(61)	53
Amortissement net des primes (des escomptes) sur les placements	(189)	(238)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation</b>	<b>(14 642)</b>	<b>(18 094)</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement :</b>		
Produit de la vente de parts rachetables**	28 952	46 891
Montant payé au titre du rachat de parts rachetables**	(13 362)	(28 861)
Distributions en trésorerie versées aux porteurs de parts rachetables	(608)	(416)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement</b>	<b>14 982</b>	<b>17 614</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des devises</b>	<b>340</b>	<b>(480)</b>
<b>Trésorerie (découvert) et devises :</b>		
Ouverture de l'exercice	379	856
Gain (perte) de change sur la trésorerie	0	3
Clôture de l'exercice	719 \$	379 \$
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie :</b>		
Intérêts payés liés aux activités de financement	6 \$	9 \$
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	2 604 \$	1 336 \$

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

\*\* Ne comprend pas les transferts hors trésorerie entre les séries.

# Inventaire du portefeuille Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)

31 décembre 2023

(en milliers\*, sauf le nombre d'actions, de contrats, de parts ou d'onces, selon le cas)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES 98,8 %</b>						
<b>AUSTRALIE 0,5 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>						
GPT Wholesale Office Fund No1 3,222 %, échéant le 5 nov. 2031	100 AUD	93 \$	72 \$			
Lendlease Finance Ltd. 3,400 %, échéant le 27 oct. 2027	150	150	123			
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 2,450 %, échéant le 16 mars 2031	100 USD	107	110			
Total - Australie		350	305			
<b>BELGIQUE 0,5 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>						
KBC Group NV 8,000 %, échéant le 5 sept. 2028 <sup>d), e)</sup>	200 EUR	295	311			
Total - Belgique		295	311			
<b>BRÉSIL 0,4 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,4 %</b>						
Banco BTG Pactual SA 2,750 %, échéant le 11 janv. 2026	200 USD	245	250			
Total - Brésil		245	250			
<b>CANADA 0,1 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,1 %</b>						
Brookfield Finance, Inc. 2,724 %, échéant le 15 avr. 2031	50 USD	63	56			
Total - Canada		63	56			
<b>CHILI 0,3 %</b>						
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,3 %</b>						
Obligations internationales du gouvernement du Chili 3,500 %, échéant le 31 janv. 2034	200 USD	255	237			
Total - Chili		255	237			
<b>DANEMARK 1,1 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,1 %</b>						
GN Store Nord AS 0,875 %, échéant le 25 nov. 2024	100 EUR	142	140			
TDC Net AS 5,056 %, échéant le 31 mai 2028	100	127	152			
5,618 %, échéant le 6 févr. 2030	300	438	454			
Total - Danemark		707	746			
<b>FRANCE 1,1 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,1 %</b>						
BNP Paribas SA 7,750 %, échéant le 16 août 2029 <sup>d), e)</sup>	200 USD	257	271			
CNP Assurances SACA 1,250 %, échéant le 27 janv. 2029	100 EUR	114	129			
Crédit Agricole Assurances SA 1,500 %, échéant le 6 oct. 2031	200	284	240			
Vilmorin & Cie SA 1,375 %, échéant le 26 mars 2028	100	147	124			
Total - France		802	764			
<b>ALLEMAGNE 0,5 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>						
Deutsche Bank AG 1,875 %, échéant le 23 févr. 2028	100 EUR	144 \$	137 \$			
3,742 %, échéant le 7 janv. 2033	200 USD	254	218			
Total - Allemagne		398	355			
<b>GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES 0,6 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,6 %</b>						
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 %, échéant le 29 juill. 2026	100 EUR	164	121			
Sirius Real Estate Ltd. 1,125 %, échéant le 22 juin 2026	100	144	132			
1,750 %, échéant le 24 nov. 2028	100	141	122			
Total - Guernesey, Îles anglo-normandes		449	375			
<b>INDE 0,2 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>						
ReNew Pvt Ltd. 5,875 %, échéant le 5 mars 2027	104 USD	138	132			
Total - Inde		138	132			
<b>IRLANDE 0,2 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>						
AIB Group PLC 2,875 %, échéant le 30 mai 2031	100 EUR	161	140			
Total - Irlande		161	140			
<b>ITALIE 0,5 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>						
Intesa Sanpaolo SpA 6,625 %, échéant le 31 mai 2033	100 GBP	165	179			
Nexi SpA 1,625 %, échéant le 30 avr. 2026	100 EUR	143	139			
Total - Italie		308	318			
<b>LUXEMBOURG 1,2 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,2 %</b>						
Acef Holding SCA 1,250 %, échéant le 26 avr. 2030	100 EUR	143	118			
CPI Property Group SA 1,750 %, échéant le 14 janv. 2030	100	141	83			
Logicor Financing SARL 2,000 %, échéant le 17 janv. 2034	100	141	115			
Segro Capital SARL 1,875 %, échéant le 23 mars 2030	100	138	135			
SELP Finance SARL 3,750 %, échéant le 10 août 2027	250	327	366			
Total - Luxembourg		890	817			
<b>MEXICO 0,4 %</b>						
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>						
Nemak SAB de CV 2,250 %, échéant le 20 juill. 2028	100 EUR	150	130			

## Inventaire du portefeuille Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,2 %</b>				<b>SUPRANATIONAL 0,2 %</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement du Mexique</b>				<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,2 %</b>			
2,250 %, échéant le 12 août 2036	120 EUR	177 \$	139 \$	<b>Banque ouest-africaine de développement</b>			
Total - Mexique		327	269	2,750 %, échéant le 22 janv. 2033	100 EUR	150 \$	113 \$
<b>MULTINATIONAL 0,5 %</b>				<b>Total - Supranational</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>						150	113
<b>Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC</b>				<b>SWEDEN 0,3 %</b>			
3,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> sept. 2029	100 EUR	151	119	<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,3 %</b>			
<b>NXP BV</b>				<b>EQT AB</b>			
2,500 %, échéant le 11 mai 2031	200 USD	216	225	0,875 %, échéant le 14 mai 2031	200 EUR	206	233
Total - Multinational		367	344	<b>Total - Suède</b>			
<b>PAYS-BAS 2,0 %</b>						206	233
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 2,0 %</b>				<b>ROYAUME-UNI 5,7 %</b>			
<b>Citycon Treasury BV</b>				<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 4,7 %</b>			
1,625 %, échéant le 12 mars 2028	100 EUR	143	117	<b>Barclays PLC</b>			
<b>CTP NV</b>				7,385 %, échéant le 2 nov. 2028	200 USD	271	283
1,250 %, échéant le 21 juin 2029	100	146	122	<b>Brookfield Finance U.K. PLC</b>			
<b>Digital Dutch Finco BV</b>				2,340 %, échéant le 30 janv. 2032	40	50	42
0,625 %, échéant le 15 juill. 2025	200	246	277	<b>Derwent London PLC</b>			
<b>Iberdrola International BV</b>				1,875 %, échéant le 17 nov. 2031	100 GBP	167	135
6,750 %, échéant le 15 sept. 2033	40 USD	70	57	<b>Grainger PLC</b>			
<b>ING Groep NV</b>				3,000 %, échéant le 3 juill. 2030	100	181	145
4,125 %, échéant le 24 août 2033	100 EUR	130	147	<b>HSBC Holdings PLC</b>			
<b>JDE Peet's NV</b>				6,254 %, échéant le 9 mars 2034	200 USD	280	282
2,250 %, échéant le 24 sept. 2031	200 USD	200	212	<b>InterContinental Hotels Group PLC</b>			
4,125 %, échéant le 23 janv. 2030	100 EUR	148	151	3,375 %, échéant le 8 oct. 2028	100 GBP	188	158
<b>NE Property BV</b>				<b>John Lewis PLC</b>			
3,375 %, échéant le 14 juill. 2027	100	167	139	6,125 %, échéant le 21 janv. 2025	50	95	84
<b>VIA Outlets BV</b>				<b>Marks &amp; Spencer PLC</b>			
1,750 %, échéant le 15 nov. 2028	100	143	130	4,500 %, échéant le 10 juill. 2027	100	188	163
Total - Pays-Bas		1 393	1 352	<b>Santander U.K. Group Holdings PLC</b>			
<b>ROUMANIE 0,5 %</b>				<b>Standard Chartered PLC</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,5 %</b>				3,603 %, échéant le 12 janv. 2033	200	255	220
<b>Obligations internationales du gouvernement de la Roumanie</b>				6,301 %, échéant le 9 janv. 2029	200	270	272
5,500 %, échéant le 18 sept. 2028	100 EUR	146	151	<b>Travis Perkins PLC</b>			
6,375 %, échéant le 18 sept. 2033	100	145	155	3,750 %, échéant le 17 févr. 2026	100 GBP	188	159
Total - Roumanie		291	306	<b>Vmed O2 U.K. Financing PLC</b>			
<b>SERBIE 0,2 %</b>				4,750 %, échéant le 15 juill. 2031	200 USD	246	237
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,2 %</b>				<b>Vodafone Group PLC</b>			
<b>Obligations internationales du gouvernement de la Serbie</b>				5,125 %, échéant le 4 juin 2081	100	102	100
1,000 %, échéant le 23 sept. 2028	100 EUR	141	124	<b>Weir Group PLC</b>			
Total - Serbie		141	124	2,200 %, échéant le 13 mai 2026	200	243	247
<b>AFRIQUE DU SUD 0,2 %</b>				<b>Workspace Group PLC</b>			
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 0,2 %</b>				2,250 %, échéant le 11 mars 2028	100 GBP	130	145
<b>Obligations internationales du gouvernement de l'Afrique du Sud</b>				<b>Zenith Finco PLC</b>			
10,500 %, échéant le 21 déc. 2026	1 700 ZAR	155	129	6,500 %, échéant le 30 juin 2027	100	170	138
Total - Afrique du Sud		155	129			3 297	3 085
<b>ESPAGNE 0,4 %</b>				<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 1,0 %</b>			
<b>TITRES PRIVILÉGIÉS 0,4 %</b>				<b>Bridggate Funding PLC</b>			
<b>CaixaBank SA</b>				9,220 %, échéant le 16 oct. 2062	190	297	320
6,750 %, échéant le 13 juin 2024 <sup>d), e)</sup>	200 000	276	293	10,220 %, échéant le 16 oct. 2062	190	296	319
Total - Espagne		276	293			593	639
				<b>Total - Royaume-Uni</b>			
						3 890	3 724

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>ÉTATS-UNIS 61,4 %</b>							
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 8,4 %</b>							
<b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b> 5,640 %, échéant le 25 nov. 2036	82 USD	60 \$	45 \$				
<b>Argent Securities Trust</b> 5,770 %, échéant le 25 juin 2036	101	101	87				
<b>Argent Securities, Inc., certificats à flux identiques adossés à des actifs</b> 7,270 %, échéant le 25 nov. 2034	50	63	60				
<b>Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b> 7,315 %, échéant le 25 mai 2035	101	125	122				
<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b> 5,823 %, échéant le 25 déc. 2034	42	53	55				
<b>FHF Trust</b> 2,290 %, échéant le 15 mars 2027 4,430 %, échéant le 18 janv. 2028	200 131	245 171	256 172				
<b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b> 4,757 %, échéant le 25 mars 2036 6,220 %, échéant le 25 déc. 2035	337 102	392 126	414 130				
<b>GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust</b> 4,000 %, échéant le 20 avr. 2049 4,950 %, échéant le 20 juill. 2049	132 360	164 469	154 439				
<b>Loanpal Solar Loan Ltd.</b> 2,220 %, échéant le 20 mars 2048	35	44	35				
<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b> 5,780 %, échéant le 25 août 2036	399	301	280				
<b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b> 6,070 %, échéant le 25 déc. 2036 6,595 %, échéant le 25 août 2036	293 14	348 17	365 18				
<b>Mosaic Solar Loan Trust</b> 2,640 %, échéant le 20 janv. 2053	80	98	91				
<b>New Century Home Equity Loan Trust</b> 6,205 %, échéant le 25 oct. 2035	600	662	672				
<b>Research-Driven Pagaya Motor Asset Trust</b> 4,320 %, échéant le 25 sept. 2030	89	112	112				
<b>Service Experts Issuer</b> 2,670 %, échéant le 2 févr. 2032	112	142	138				
<b>Structured Asset Investment Loan Trust</b> 6,445 %, échéant le 25 mai 2035	327	390	381				
<b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b> 5,760 %, échéant le 25 juill. 2036	308	393	395				
<b>Sunnova Helios Issuer LLC</b> 5,300 %, échéant le 20 mai 2050	194	253	252				
<b>Sunnova Sol Issuer LLC</b> 2,790 %, échéant le 22 févr. 2049 5,400 %, échéant le 30 avr. 2058	309 198	386 255	363 256				
<b>Sunrun Demeter Issuer</b> 2,270 %, échéant le 30 janv. 2057	224	286	252				
		5 656	5 544				
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 9,2 %</b>							
<b>AES Corp.</b> 2,450 %, échéant le 15 janv. 2031 5,450 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2028	40 100	49 135	45 135				
<b>Ally Financial, Inc.</b> 8,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2031	50	90	73				
<b>American Tower Corp.</b> 3,100 %, échéant le 15 juin 2050	50	57	45				
<b>Ball Corp.</b> 3,125 %, échéant le 15 sept. 2031	120	147	137				
<b>Bank of America Corp.</b> 2,687 %, échéant le 22 avr. 2032	50 USD	65 \$	56 \$				
<b>Boise Cascade Co.</b> 4,875 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juill. 2030	100	136	124				
<b>Boston Properties LP</b> 2,550 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2032	50	63	53				
<b>CDW LLC</b> 3,569 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2031	100	127	118				
<b>Duke Energy Carolinas LLC</b> 3,550 %, échéant le 15 mars 2052	78	99	79				
<b>Enel Finance America LLC</b> 7,100 %, échéant le 14 oct. 2027	200	273	283				
<b>Equinix, Inc.</b> 3,900 %, échéant le 15 avr. 2032	70	87	86				
<b>Fair Isaac Corp.</b> 4,000 %, échéant le 15 juin 2028	120	154	151				
<b>First American Financial Corp.</b> 2,400 %, échéant le 15 août 2031	50	62	52				
<b>Ford Motor Co.</b> 3,250 %, échéant le 12 févr. 2032	20	25	22				
<b>FS KKR Capital Corp.</b> 3,125 %, échéant le 12 oct. 2028	100	126	116				
<b>Gap, Inc.</b> 3,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2029	100	126	113				
<b>Goodman U.S. Finance Five LLC</b> 4,625 %, échéant le 4 mai 2032	200	256	247				
<b>Graphic Packaging International LLC</b> 2,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2029	100 EUR	146	136				
<b>HAT Holdings LLC</b> 3,375 %, échéant le 15 juin 2026 3,750 %, échéant le 15 sept. 2030	60 USD 141	76 177	75 158				
<b>HCA, Inc.</b> 3,625 %, échéant le 15 mars 2032	100	113	118				
<b>Hilton Domestic Operating Co., Inc.</b> 3,625 %, échéant le 15 févr. 2032	100	122	116				
<b>Host Hotels &amp; Resorts LP</b> 2,900 %, échéant le 15 déc. 2031 3,375 %, échéant le 15 déc. 2029 3,500 %, échéant le 15 sept. 2030	50 100 100	61 129 129	56 119 118				
<b>Howard Hughes Corp.</b> 4,375 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2031	150	189	173				
<b>Hudson Pacific Properties LP</b> 3,950 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2027 5,950 %, échéant le 15 févr. 2028	70 50	93 65	78 59				
<b>Jones Lang LaSalle, Inc.</b> 6,875 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2028	100	137	140				
<b>Kilroy Realty LP</b> 2,500 %, échéant le 15 nov. 2032 2,650 %, échéant le 15 nov. 2033	100 50	123 63	100 50				
<b>Liberty Utilities Finance GP 1</b> 2,050 %, échéant le 15 sept. 2030	40	50	43				
<b>Lindblad Expeditions LLC</b> 6,750 %, échéant le 15 févr. 2027	70	88	92				
<b>Micron Technology, Inc.</b> 2,703 %, échéant le 15 avr. 2032	100	124	111				
<b>MSCI, Inc.</b> 3,625 %, échéant le 1 <sup>er</sup> sept. 2030	100	114	120				
<b>Nationstar Mortgage Holdings, Inc.</b> 5,750 %, échéant le 15 nov. 2031	60	75	74				

## Inventaire du portefeuille Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Newell Brands, Inc.</b> 4,875 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juin 2025	40 USD	56 \$	52 \$	<b>Credit Suisse Mortgage Capital Trust</b> 1,796 %, échéant le 27 déc. 2060	71 USD	87 \$	92 \$
<b>NextEra Energy Operating Partners LP</b> 7,250 %, échéant le 15 janv. 2029	200	271	278	<b>DBGS Mortgage Trust</b> 6,254 %, échéant le 15 juin 2033	200	245	244
<b>OneMain Finance Corp.</b> 3,500 %, échéant le 15 janv. 2027	183	226	225	<b>DOLP Trust</b> 3,704 %, échéant le 10 mai 2041	220	268	185
<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b> 6,700 %, échéant le 1 <sup>er</sup> avr. 2053	200	271	288	<b>DROP Mortgage Trust</b> 7,726 %, échéant le 15 oct. 2043	200	253	215
<b>Pattern Energy Operations LP</b> 4,500 %, échéant le 15 août 2028	100	128	125	8,226 %, échéant le 15 oct. 2043	100	125	96
<b>PennyMac Financial Services Inc.</b> 5,750 %, échéant le 15 sept. 2031	50	62	61	<b>Extended Stay America Trust</b> 7,726 %, échéant le 15 juill. 2038	140	172	183
<b>SLM Corp.</b> 3,125 %, échéant le 2 nov. 2026	200	248	247	<b>Independence Plaza Trust</b> 3,911 %, échéant le 10 juill. 2035	350	447	438
<b>Standard Industries, Inc.</b> 2,250 %, échéant le 21 nov. 2026	100 EUR	140	139	<b>IndyMac INDX Mortgage Loan Trust</b> 5,990 %, échéant le 25 juill. 2035	91	98	79
<b>SVB Financial Group</b> 4,570 %, échéant le 29 avr. 2033 <sup>^</sup>	180 USD	195	158	<b>JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b> 7,176 %, échéant le 15 avr. 2038	300	371	392
<b>VeriSign, Inc.</b> 2,700 %, échéant le 15 juin 2031	100	120	114	7,316 %, échéant le 15 juin 2038	200	247	216
<b>Verizon Communications, Inc.</b> 5,050 %, échéant le 9 mai 2033	300	401	406	7,776 %, échéant le 15 mars 2036	300	380	189
<b>Warnermedia Holdings, Inc.</b> 4,054 %, échéant le 15 mars 2029	80	102	101	8,576 %, échéant le 15 mars 2036	50	64	28
		<u>6 371</u>	<u>6 065</u>	<b>KREST Commercial Mortgage Securities Trust</b> 2,927 %, échéant le 5 nov. 2044	415	464	341
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 15,7 %</b>				<b>MAD Mortgage Trust</b> 3,366 %, échéant le 15 août 2034	460	576	512
<b>1211 Avenue of the Americas Trust</b> 4,142 %, échéant le 10 août 2035	500	600	602	<b>Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust</b> 5,870 %, échéant le 25 mars 2037	98	59	36
<b>American Home Mortgage Assets Trust</b> 5,660 %, échéant le 25 déc. 2046	41	42	45	<b>Morgan Stanley Capital Trust</b> 6,426 %, échéant le 15 déc. 2036	230	291	236
5,890 %, échéant le 25 juin 2037	30	36	38	6,776 %, échéant le 15 déc. 2036	200	245	129
<b>BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust</b> 8,226 %, échéant le 15 sept. 2038	500	636	551	7,276 %, échéant le 15 déc. 2036	300	374	147
<b>Barclays Commercial Mortgage Securities Trust</b> 3,688 %, échéant le 15 févr. 2053	300	350	264	8,553 %, échéant le 15 déc. 2038	300	380	304
4,957 %, échéant le 10 août 2035	300	384	290	<b>MortgageIT Mortgage Loan Trust</b> 6,070 %, échéant le 25 août 2035	71	89	90
<b>Barclays Commercial Real Estate Trust</b> 4,216 %, échéant le 10 août 2033	55	72	65	<b>NYO Commercial Mortgage Trust</b> 8,021 %, échéant le 15 nov. 2038	300	371	259
4,563 %, échéant le 10 août 2033	530	675	565	<b>One New York Plaza Trust</b> 6,726 %, échéant le 15 janv. 2036	200	249	245
<b>Bear Stearns ALT-A Trust</b> 5,790 %, échéant le 25 juin 2046	74	85	87	<b>Residential Accredited Loans, Inc. Trust</b> 6,000 %, échéant le 25 juin 2037	33	40	33
<b>Beast Mortgage Trust</b> 7,426 %, échéant le 15 mars 2036	200	253	186	<b>SFO Commercial Mortgage Trust</b> 6,626 %, échéant le 15 mai 2038	200	242	249
7,976 %, échéant le 15 mars 2036	200	253	175	7,276 %, échéant le 15 mai 2038	200	246	233
<b>Beneria Cowen &amp; Pritzer Collateral Funding Corp.</b> 7,968 %, échéant le 15 juin 2038	150	183	143	7,876 %, échéant le 15 mai 2038	235	296	257
<b>BSST Mortgage Trust</b> 8,212 %, échéant le 15 févr. 2037	300	383	270	<b>Starwood Mortgage Trust</b> 7,726 %, échéant le 15 avr. 2034	235	295	302
<b>CitiMortgage Alternative Loan Trust</b> 6,000 %, échéant le 25 juin 2037	63	80	73	7,781 %, échéant le 15 nov. 2036	200	248	255
<b>Commercial Mortgage Trust</b> 3,832 %, échéant le 10 févr. 2036	200	245	243	<b>VASA Trust</b> 7,576 %, échéant le 15 juill. 2039	100	125	91
7,059 %, échéant le 15 juin 2034	150	178	129	<b>Worldwide Plaza Trust</b> 3,596 %, échéant le 10 nov. 2036	200	253	57
8,626 %, échéant le 15 déc. 2038	300	379	325			<u>12 641</u>	<u>10 375</u>
<b>Countrywide Alternative Loan Trust</b> 5,250 %, échéant le 25 juin 2035	67	80	68	<b>ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX AMÉRICAINS 23,9 %</b>			
5,730 %, échéant le 25 mars 2047	45	48	45	<b>Ginnie Mae, à déterminer</b> 5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2054	300	397	395
<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b> 4,159 %, échéant le 25 févr. 2047	69	79	78	<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme</b> 4,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2053 - 1 <sup>er</sup> août 2053	3 075	3 790	3 853
				4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> déc. 2052 - 1 <sup>er</sup> août 2053	1 088	1 386	1 398
				5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> mai 2053	2 514	3 387	3 297

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
5,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2053 - 1 <sup>er</sup> août 2053	3 930 USD	5 224 \$	5 240 \$
6,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> juill. 2053	200	267	269
<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, à déterminer</b>			
3,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	200	241	243
6,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2054	800	1 105	1 086
		<u>15 797</u>	<u>15 781</u>
<b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR DES ÉTATS-UNIS 4,2 %</b>			
<b>Titres du Trésor des É.-U. indexés sur l'inflation<sup>c)</sup></b>			
0,125 %, échéant le 15 juill. 2024	26	34	34
0,125 %, échéant le 15 oct. 2024	84	109	109
0,125 %, échéant le 15 juill. 2031	459	646	541
0,625 %, échéant le 15 janv. 2024	1 121	1 496	1 481
1,000 %, échéant le 15 févr. 2046	117	197	127
1,375 %, échéant le 15 févr. 2044	79	126	94
<b>Obligations du Trésor des États-Unis</b>			
3,875 %, échéant le 30 sept. 2029	300	408	397
		<u>3 016</u>	<u>2 783</u>
Total - États-Unis		<u>43 481</u>	<u>40 548</u>

**INSTRUMENTS À COURT TERME 19,8 %**

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PRISES EN PENSION<sup>f)</sup> 1,2 %</b>			
		800 \$	800 \$
<b>BONS DU TRÉSOR DU CANADA 18,6 %</b>			
5,011 %, échéant le 18 janv. 2024 <sup>a), b)</sup>	104 \$	104	104
5,021 %, échéant le 18 janv. 2024 <sup>a), b)</sup>	172	171	171
5,022 %, échéant le 1 <sup>er</sup> févr. 2024 <sup>a), b)</sup>	12 100	12 051	12 044
		<u>12 326</u>	<u>12 319</u>
Total - Placements à court terme		<u>13 126</u>	<u>13 119</u>
Total - Placements dans des titres		<u>68 864</u>	<u>65 360</u>
<b>Total - Placements 98,8 %</b>		<b>68 864 \$</b>	<b>65 360 \$</b>
Instrument financiers dérivés <sup>a), h)</sup> 1,9 %		(11)	1 274
Autres actifs, moins les passifs (0,7) %			(493)
<b>Total de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables 100,0 %</b>			<b>66 141 \$</b>

**NOTES À L'INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE :**

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

^ Titre en défaillance.

a) Titre à coupon zéro.

b) Coupon représentant un rendement à l'échéance.

c) Le montant du capital du titre est indexé selon l'inflation.

d) Titre perpétuel; la date indiquée, le cas échéant, est la prochaine date de remboursement anticipé.

e) Titre convertible conditionnel.

**EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT****f) PRISES EN PENSION :**

Contrepartie	Taux de financement	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du capital	Garanti par	Garanties (reçues)	Prises en pension, à la valeur	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>
TOR	4,980 %	29 déc. 2023	2 janv. 2024	800 \$	Obligation du gouvernement du Canada, 4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> nov. 2025	(818) \$	800 \$	800 \$
<b>Total - Prises en pension de titres</b>						<b>(818) \$</b>	<b>800 \$</b>	<b>800 \$</b>

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

**VENTES À DÉCOUVERT :**

Description	Intérêt	Date d'échéance	Montant du capital	Produits	Montants à payer pour les ventes à découvert
États-Unis					
Organismes gouvernementaux américains					
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, à déterminer	4,500 %	1 <sup>er</sup> févr. 2054	700 USD	(904) \$	(900) \$
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, à déterminer	5,500	1 <sup>er</sup> janv. 2054	1 000	(1 340)	(1 331)
Total - États-Unis				<u>(2 244)</u>	<u>(2 231)</u>
<b>Total des ventes à découvert</b>				<b>(2 244) \$</b>	<b>(2 231) \$</b>

**Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et des autres opérations de financement et des garanties données/(reçues).**

## Inventaire du portefeuille Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada) (suite)

### g) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE

#### CONTRATS À TERME :

Description	Type	Mois de l'échéance	Nombre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	Marge de variation	
					Actif	Passif
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, décembre	Position courte	Mars 2026	1	3 \$	0 \$	0 \$
Contrat actif sur SOFR à 3 mois, mars	Position courte	Juin 2026	1	3	0	0
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position longue	Mars 2024	20	109	0	0
Contrats à terme Ultra sur obligations à long terme du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position courte	Mars 2024	2	(14)	0	0
Contrats à terme Ultra sur obligations à long terme du Trésor des É.-U., mars	Position courte	Mars 2024	1	(15)	1	0
<b>Total des contrats à terme</b>				<b>86 \$</b>	<b>1 \$</b>	<b>0 \$</b>

#### SWAPS :

#### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/à recevoir	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	Marge de variation	
						Actif	Passif
À recevoir	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	4,500 %	20 mars 2034	600 GBP	(81) \$	(106) \$	9 \$ 0 \$
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,450	20 déc. 2024	1 900 USD	56	56	1 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,000	21 déc. 2024	3 500	(95)	124	1 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,350	17 janv. 2025	900	27	27	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,750	21 juin 2025	4 200	(52)	(53)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,250	20 déc. 2025	3 700	71	14	1 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,300	17 janv. 2026	100	4	4	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,000	20 déc. 2026	6 200	133	53	3 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,750	13 déc. 2027	100	(1)	(1)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,000	21 déc. 2027	800	7	(62)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,250	21 juin 2028	3 460	(67)	(58)	2 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,250	21 juin 2028	80	(2)	1	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,500	15 déc. 2028	200	(32)	(27)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,750	20 déc. 2028	3 300	197	43	2 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,518	20 janv. 2029	50	(7)	(7)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,630	26 janv. 2029	50	(7)	(7)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,100	9 sept. 2029	200	(3)	(5)	0 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,000	21 déc. 2029	330	(8)	35	0 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,870	6 juin 2030	4 900	(160)	(142)	0 (1)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,000	21 juin 2030	270	3	10	0 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	0,750	16 juin 2031	100	15	26	0 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,750	15 déc. 2031	290	61	53	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,735	12 janv. 2032	50	(9)	(9)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,655	24 janv. 2032	50	(10)	(10)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,770	14 févr. 2032	50	(8)	(8)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,765	16 mars 2032	50	(8)	(8)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,817	5 avr. 2032	50	(8)	(8)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	20 déc. 2032	2 000	204	7	0 (1)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,000	21 déc. 2032	730	(1)	(108)	0 (1)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,450	7 mars 2033	100	0	0	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,420	24 mai 2033	100	0	(1)	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,000	21 juin 2033	390	(10)	(19)	0 (1)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	21 juin 2033	100	1	0	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,760	23 août 2033	100	4	3	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,950	13 sept. 2033	100	6	5	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,170	3 oct. 2033	100	9	8	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,030	4 oct. 2033	100	6	6	0 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,175	10 oct. 2033	3 200	263	247	0 (2)
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,450	1 <sup>er</sup> nov. 2033	100	12	11	0 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	20 déc. 2033	4 500	(354)	(16)	4 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,500	20 déc. 2033	2 000	86	9	0 (3)
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	4,250	20 mars 2034	600	(5)	(55)	0 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,000	21 juin 2043	600	23	53	2 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	1,250	16 juin 2051	60	19	33	0 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,000	15 déc. 2051	80	37	30	0 0
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,750	21 juin 2053	600	31	81	4 0
À payer	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,370	12 juill. 2053	100	2	1	0 (1)
À recevoir	EURIBOR en EUR à 3 mois	2,920	13 déc. 2028	100	(3)	(3)	1 0
À recevoir	EURIBOR en EUR à 3 mois	2,760	3 janv. 2029	100 EUR	(2)	(2)	0 (2)
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	1,000	13 mai 2027	100	(7)	(7)	0 0
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	1,000	18 mai 2027	100	(7)	(7)	0 0
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,250	20 mars 2029	2 200	(117)	(134)	10 0

Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	Marge de variation		
							Actif	Passif	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	2,547 %	9 mars 2033	100 EUR	4 \$	1 \$	0 \$	(1) \$	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,300	3 oct. 2033	100	11	10	0	(2)	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	3,000	20 mars 2034	1 000	(83)	(69)	15	0	
À recevoir	EURIBOR en EUR à 6 mois	2,750	20 mars 2054	100	(15)	(14)	4	0	
<b>Total des swaps</b>						<b>130 \$</b>	<b>5 \$</b>	<b>59 \$</b>	<b>(15) \$</b>

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée.

## h) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE

### CONTRATS DE CHANGE À TERME :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
BOA	Janv. 2024	1 568 ZAR	81 USD	0 \$	(5) \$
CBK	Janv. 2024	1 189 \$	883	0	(20)
	Janv. 2024	136 EUR	200 \$	1	0
GLM	Janv. 2024	14 265 USD	19 389	490	0
	Janv. 2024	67	1161 MXN	1	0
	Mars 2024	1 026 450 IDR	67 USD	0	0
	Janv. 2024	388 \$	288	0	(6)
	Janv. 2024	44 EUR	64 \$	0	0
	Janv. 2024	1 180 GBP	2 031	37	0
MBC	Janv. 2024	15 990 USD	21 729	544	0
	Janv. 2024	428	7508 MXN	16	0
	Mars 2024	424 753 IDR	28 USD	0	0
	Janv. 2024	89 USD	121 \$	3	0
SCX	Mars 2024	107	1 652 402 IDR	0	0
	Janv. 2024	213 AUD	191 \$	0	(1)
	Janv. 2024	628 \$	68 300 JPY	15	0
	Janv. 2024	1 007	749 USD	0	(15)
	Janv. 2024	3 953 EUR	5 897 \$	114	0
	Janv. 2024	9 GBP	15	0	0
	Janv. 2024	2 071 USD	2 801	57	0
	Mars 2024	186 876 IDR	12 USD	0	0
<b>Total des contrats de change à terme</b>				<b>1 278 \$</b>	<b>(47) \$</b>

### SWAPS :

#### SWAPS SUR DÉFAILLANCE D'ÉMISSIONS SOUVERAINES - PROTECTION À LA VENTE <sup>1)</sup>

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>2)</sup>	Primes payées/ (reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Swaps, à la valeur <sup>3)</sup>		
							Actif	Passif	
BOA	Obligations internationales du gouvernement de l'Afrique du Sud	1,000 %	20 déc. 2026	USD 200	(11) \$	9 \$	0 \$	(2) \$	
<b>Total des swaps</b>						<b>(11) \$</b>	<b>9 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(2) \$</b>

<sup>1)</sup> Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, le Fonds soit i) versera à l'acheteur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et prendra livraison de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) paiera un montant net de règlement, sous forme de trésorerie, de titres ou d'autres obligations livrables, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence.

<sup>2)</sup> Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait devoir payer en tant que vendeur de protection de crédit ou recevoir en tant qu'acheteur de protection de crédit en cas d'incident de crédit, conformément aux dispositions du swap en question.

<sup>3)</sup> Les cours et les valeurs résultantes des swaps sur défaillance permettent de suivre l'évolution du risque de paiement/rendement et déterminent la probabilité qu'un passif (ou un actif) attendu sur le dérivé de crédit soit réalisé si le swap est dénoué ou si le notionnel est vendu à la clôture de la période. L'augmentation des justes valeurs en termes absolus, lorsque comparées aux valeurs notionnelles du swap, indique un affaiblissement du niveau de solvabilité de l'instrument référencé sous-jacent et une plus grande probabilité de défaillance ou de risque de défaillance, ou de survenance d'autres incidents de crédit définis dans les dispositions de l'accord.

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues).

## Notes annexes propres au Fonds Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

### SOMMAIRE DES EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA) TOR	800 \$	0 \$	0 \$	800 \$	(818) \$	(18) \$
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement</b>	<b>800 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA) TOR	2 801 \$	0 \$	0 \$	2 801 \$	(2 856) \$	(55) \$
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement</b>	<b>2 801 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>			

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

<sup>2)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux emprunts et autres opérations de financement ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2023 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0 \$	1 \$	59 \$	60 \$	0 \$	0 \$	(15) \$	(15) \$

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2022 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0 \$	3 \$	25 \$	28 \$	0 \$	(1) \$	(9) \$	(10) \$

## INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
BOA	0 \$	0 \$	0 \$	0 \$	(5) \$	0 \$	(2) \$	(7) \$	(7) \$	0 \$	(7) \$
CBK	492	0	0	492	(20)	0	0	(20)	472	(371)	101
GLM	597	0	0	597	(6)	0	0	(6)	591	(646)	(55)
MBC	3	0	0	3	0	0	0	0	3	0	3
SCX	186	0	0	186	(16)	0	0	(16)	170	0	170
<b>Total - Hors cote</b>	<b>1 278 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>1 278 \$</b>	<b>(47) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(2) \$</b>	<b>(49) \$</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
BOA	31 \$	0 \$	0 \$	31 \$	(344) \$	(3) \$	(10) \$	(357) \$	(326) \$	390 \$	64 \$
CBK	79	0	0	79	(19)	(2)	0	(21)	58	0	58
GLM	0	0	0	0	(2)	(9)	0	(11)	(11)	0	(11)
JPM	15	0	0	15	0	0	0	0	15	0	15
MBC	8	0	0	8	(68)	0	0	(68)	(60)	0	(60)
SCX	9	0	0	9	(46)	0	0	(46)	(37)	0	(37)
<b>Total - Hors cote</b>	<b>142 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>142 \$</b>	<b>(479) \$</b>	<b>(14) \$</b>	<b>(10) \$</b>	<b>(503) \$</b>			

<sup>1)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux instruments financiers dérivés hors cote ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

## ÉVALUATIONS DE LA JUSTE VALEUR

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2023 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Australie				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	305 \$	0 \$	305 \$
Belgique				
Obligations et billets de sociétés	0	311	0	311
Brésil				
Obligations et billets de sociétés	0	250	0	250
Canada				
Obligations et billets de sociétés	0	56	0	56
Chili				
Émissions souveraines	0	237	0	237
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0	746	0	746
France				
Obligations et billets de sociétés	0	764	0	764
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	355	0	355
Guernesey, îles anglo-normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	375	0	375
Inde				
Obligations et billets de sociétés	0	132	0	132
Irlande				
Obligations et billets de sociétés	0	140	0	140
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0	318	0	318

## Notes annexes propres au Fonds Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada) (suite)

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
Luxembourg				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	817 \$	0 \$	817 \$
Mexique				
Obligations et billets de sociétés	0	130	0	130
Émissions souveraines	0	139	0	139
Multinational				
Obligations et billets de sociétés	0	344	0	344
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	1 352	0	1 352
Roumanie				
Émissions souveraines	0	306	0	306
Serbie				
Émissions souveraines	0	124	0	124
Afrique du Sud				
Émissions souveraines	0	129	0	129
Espagne				
Actions privilégiées	0	293	0	293
Supranational				
Obligations et billets de sociétés	0	113	0	113
Suède				
Obligations et billets de sociétés	0	233	0	233
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	3 085	0	3 085
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	639	0	639
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	5 544	0	5 544
Obligations et billets de sociétés	0	6 065	0	6 065
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	10 342	33	10 375
Organismes gouvernementaux américains	0	15 781	0	15 781
Obligations du Trésor américain	0	2 783	0	2 783
Instruments à court terme				
Prises en pension	0	800	0	800
Bons du Trésor du Canada	0	12 319	0	12 319
<b>Total - Placements</b>	<b>0 \$</b>	<b>65 327 \$</b>	<b>33 \$</b>	<b>65 360 \$</b>
<b>Ventes à découvert, à la valeur - Passifs</b>				
États-Unis				
Organismes gouvernementaux américains	0 \$	(2 231) \$	0 \$	(2 231) \$
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	60	0	60
Hors cote	0	1 278	0	1 278
	<b>0 \$</b>	<b>1 338 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>1 338 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	(15)	0	(15)
Hors cote	0	(49)	0	(49)
	<b>0 \$</b>	<b>(64) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(64) \$</b>
<b>Total - Instruments financiers dérivés</b>	<b>0 \$</b>	<b>1 274 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>1 274 \$</b>
<b>Totaux</b>	<b>0 \$</b>	<b>64 370 \$</b>	<b>33 \$</b>	<b>64 403 \$</b>

**Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2022 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :**

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Australie				
Obligations et billets de sociétés	0 \$	299 \$	0 \$	299 \$
Autriche				
Obligations et billets de sociétés	0	284	0	284
Bésil				
Obligations et billets de sociétés	0	499	0	499
Canada				
Obligations et billets de sociétés	0	54	0	54

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
Chili				
Émissions souveraines	0 \$	231 \$	0 \$	231 \$
Danemark				
Obligations et billets de sociétés	0	273	0	273
France				
Obligations et billets de sociétés	0	1 771	0	1 771
Allemagne				
Obligations et billets de sociétés	0	563	0	563
Guernesey, îles anglo-normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	329	0	329
Inde				
Obligations et billets de sociétés	0	493	0	493
Irlande				
Obligations et billets de sociétés	0	130	0	130
Italie				
Obligations et billets de sociétés	0	132	0	132
Jersey, îles Anglo-Normandes				
Obligations et billets de sociétés	0	155	0	155
Luxembourg				
Obligations et billets de sociétés	0	852	0	852
Mexique				
Obligations et billets de sociétés	0	116	0	116
Émissions souveraines	0	124	0	124
Multinational				
Obligations et billets de sociétés	0	323	0	323
Pays-Bas				
Obligations et billets de sociétés	0	1 307	0	1 307
Serbie				
Émissions souveraines	0	105	0	105
Afrique du Sud				
Émissions souveraines	0	152	0	152
Espagne				
Titres privilégiés	0	284	0	284
Supranational				
Obligations et billets de sociétés	0	110	0	110
Suède				
Obligations et billets de sociétés	0	201	0	201
Royaume-Uni				
Obligations et billets de sociétés	0	2 190	0	2 190
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	5 537	0	5 537
Obligations et billets de sociétés	0	5 743	0	5 743
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	12 519	0	12 519
Organismes gouvernementaux américains	0	8 104	0	8 104
Obligations du Trésor américain	0	2 311	0	2 311
Instruments à court terme				
Prises en pension	0	2 800	0	2 800
Bons du Trésor du Canada	0	8 246	0	8 246
<b>Total - Placements</b>	<b>0 \$</b>	<b>56 237 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>56 237 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	28	0	28
Hors cote	0	142	0	142
	<b>0 \$</b>	<b>170 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>170 \$</b>
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	0	(10)	0	(10)
Hors cote	0	(503)	0	(503)
	<b>0 \$</b>	<b>(513) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(513) \$</b>
<b>Total - Instruments financiers dérivés</b>	<b>0 \$</b>	<b>(343) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(343) \$</b>
<b>Totaux</b>	<b>0 \$</b>	<b>55 894 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>55 894 \$</b>

Il n'y a eu aucun transfert significatif entre les niveaux 1, 2 ou 3 pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

CONCENTRATION DU PORTEFEUILLE

Le portefeuille de placements du Fonds est concentré dans les segments suivants :

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Australie	0,5 %	0,6 %
Autriche	0,0 %	0,6 %
Belgique	0,5 %	0,0 %
Brésil	0,4 %	1,0 %
Canada	0,1 %	0,1 %
Chili	0,3 %	0,5 %
Danemark	1,1 %	0,6 %
France	1,1 %	3,6 %
Allemagne	0,5 %	1,1 %
Guernesey, Îles anglo-normandes	0,6 %	0,7 %
Inde	0,2 %	1,0 %
Irlande	0,2 %	0,3 %
Italie	0,5 %	0,3 %
Jersey, Îles Anglo-Normandes	0,0 %	0,3 %
Luxembourg	1,2 %	1,7 %
Mexique	0,4 %	0,5 %
Multinational	0,5 %	0,7 %
Pays-Bas	2,0 %	2,7 %
Roumanie	0,5 %	0,0 %
Serbie	0,2 %	0,2 %
Afrique du Sud	0,2 %	0,3 %
Espagne	0,4 %	0,6 %
Supranational	0,2 %	0,2 %
Suède	0,3 %	0,4 %
Royaume-Uni	5,7 %	4,5 %
États-Unis	61,4 %	70,0 %
Instruments à court terme	19,8 %	22,6 %
Instruments financiers dérivés	1,9 %	(0,7) %
Passifs, moins les autres actifs	(0,7) %	(14,4) %
Total (% de l'actif net)	100,0 %	100,0 %

RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

RISQUE DE CHANGE

Les tableaux ci-dessous indiquent l'exposition globale au risque de change, sauf celui afférent à la monnaie fonctionnelle du Fonds.

Au 31 décembre 2023	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Dollar australien	197 \$	(192) \$	5 \$
Réal brésilien	0	0	0
Livre sterling	1 520	(2 009)	(489)
Euro	5 562	(6 047)	(485)
Roupie indonésienne	0	1	1
Yen japonais	1	642	643
Peso mexicain	0	673	673
Couronne norvégienne	0	0	0
Rand sud-africain	136	(113)	23
Dollar américain	42 672	(40 951)	1 721
	50 088 \$	(47 996) \$	2 092 \$

Au 31 décembre 2022	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Dollar australien	194 \$	17 \$	211 \$
Réal brésilien	0	5	5
Livre sterling	934	(1 404)	(470)
Euro	5 356	(6 090)	(734)
Roupie indonésienne	0	2	2
Yen japonais	15	961	976
Peso mexicain	0	492	492
Couronne norvégienne	1	199	200
Rand sud-africain	160	(154)	6
Dollar américain	30 021	(29 959)	62
	36 681 \$	(35 931) \$	750 \$

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si le dollar canadien avait progressé ou reculé de 5 % par rapport aux autres monnaies, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 105 \$ (38 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

## RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt. Ils incluent les instruments financiers du Fonds à la juste valeur, classés en fonction de la date d'échéance. Certains actifs ou passifs figurant dans l'état de la situation financière, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, ont été regroupés pour permettre la présentation ci-dessous.

	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	1 an à 5 ans	Plus de 5 ans	Non productif d'intérêts	Total
<b>Actif au 31 décembre 2023</b>						
Placements, à la juste valeur	14 599 \$	283 \$	6 718 \$	43 760 \$	0 \$	65 360 \$
Instruments financiers dérivés	1 278	2	8	49	1	1 338
Trésorerie et devises	0	0	0	0	719	719
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	586	586
Montants à recevoir	0	0	0	0	6 802	6 802
<b>Total - Actif</b>	<b>15 877 \$</b>	<b>285 \$</b>	<b>6 726 \$</b>	<b>43 809 \$</b>	<b>8 108 \$</b>	<b>74 805 \$</b>
<b>Passif au 31 décembre 2023</b>						
Emprunts et autres opérations de financement	0 \$	0 \$	0 \$	(2 231) \$	0 \$	(2 231) \$
Instruments financiers dérivés	(47)	0	(1)	(14)	(2)	(64)
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(371)	(371)
Montants à payer	0	0	0	0	(5 998)	(5 998)
<b>Total - Passif</b>	<b>(47) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(1) \$</b>	<b>(2 245) \$</b>	<b>(6 371) \$</b>	<b>(8 664) \$</b>
<b>Actif au 31 décembre 2022</b>						
Placements, à la juste valeur	10 849 \$	564 \$	5 201 \$	39 339 \$	284 \$	56 237 \$
Instruments financiers dérivés	139	2	7	19	3	170
Trésorerie et devises	0	0	0	0	379	379
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	346	346
Montants à recevoir	0	0	0	0	9 221	9 221
<b>Total - Actif</b>	<b>10 988 \$</b>	<b>566 \$</b>	<b>5 208 \$</b>	<b>39 358 \$</b>	<b>10 233 \$</b>	<b>66 353 \$</b>
<b>Passif au 31 décembre 2022</b>						
Instruments financiers dérivés	(478) \$	0 \$	(2) \$	(6) \$	(27) \$	(513) \$
Montants à payer	0	0	0	0	(16 980)	(16 980)
<b>Total - Passif</b>	<b>(478) \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>(2) \$</b>	<b>(6) \$</b>	<b>(17 007) \$</b>	<b>(17 493) \$</b>

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, si les taux d'intérêt en vigueur avaient progressé ou reculé de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 2 130 \$ ou 3,2 % (1 738 \$, ou 3,6 %, au 31 décembre 2022). La sensibilité du Fonds à la variation des taux d'intérêt a été estimée d'après la durée moyenne pondérée des instruments de créance. Dans les faits, les résultats des opérations peuvent différer et la différence peut être importante.

## AUTRE RISQUE DE PRIX

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'était pas exposé à l'autre risque de prix de façon importante, car les fonds sous-jacents détenaient surtout des titres de créance.

## RISQUE DE LIQUIDITÉ

Les tableaux ci-dessous font état des passifs du Fonds, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, par date de paiement contractuel : moins de trois mois, de trois mois à un an ou plus d'un an, selon le cas.

<b>Passif courant au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Emprunts et autres opérations de financement	0 \$	0 \$	2 231 \$	2 231 \$
Instruments financiers dérivés	49	0	15	64
Achats de placements à payer	5 874	0	0	5 874
Dépôts de contreparties	371	0	0	371
Distributions à payer	76	0	0	76
Frais de gestion à payer	48	0	0	48
<b>Total - Passif</b>	<b>6 418 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>2 246 \$</b>	<b>8 664 \$</b>

  

<b>Passif courant au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	513 \$	0 \$	0 \$	513 \$
Achats de placements à payer	16 775	0	0	16 775
Montants à payer pour les parts rachetées	140	0	0	140
Distributions à payer	32	0	0	32
Frais de gestion à payer	33	0	0	33
<b>Total - Passif</b>	<b>17 493 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>0 \$</b>	<b>17 493 \$</b>

## RISQUE DE CRÉDIT

Les tableaux ci-dessous résument la composition des notations des instruments financiers du Fonds.

	<b>Au 31 décembre 2023</b>	<b>Au 31 décembre 2022</b>
Catégorie investissement	87 %	81 %
Inférieur à la catégorie investissement	13 %	19 %
Sans notation	0 %	0 %
Total (% des placements et des instruments financiers dérivés)	100 %	100 %

Les notations sont fournies par Standard & Poor's Ratings Services (S&P), Moody's Investors Services, Inc. (Moody's), Fitch Ratings, Inc. (Fitch) ou DBRS Limited (DBRS). Lorsqu'il existe plus d'une notation pour un titre, la plus élevée a été retenue. Si la notation d'un instrument n'est pas fournie par l'une de ces agences, un titre reçoit une notation interne. Les notations inférieures à la catégorie investissement sont celles inférieures à Baa3 selon Moody's, à BAA- selon la notation interne, à BBB- selon S&P et Fitch, et à BBBL selon DBRS.

## RISQUE D'INVESTISSEMENT LIÉ AUX ENJEUX ENVIRONNEMENTAUX, SOCIAUX ET DE GOUVERNANCE

Le risque d'investissement lié aux enjeux environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) s'entend du risque que la performance du Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada) soit différente de celle d'autres fonds qui n'utilisent pas de stratégie ESG puisque le Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada) peut sélectionner ou exclure des titres de certains émetteurs pour des raisons autres que le rendement en vertu de cette stratégie. L'investissement ESG est, par nature, qualitatif et subjectif. Il n'y a aucune garantie que les facteurs utilisés par PIMCO ni que le jugement exercé par PIMCO refléteront l'opinion d'un investisseur particulier.

## États de la situation financière Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	31 déc. 2023	31 déc. 2022
<b>Actif :</b>		
Actif courant :		
<i>Placements, à la juste valeur</i>		
Placements dans des titres <sup>†</sup>	36 597 USD	73 629 USD
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	47	352
Hors cote	971	1 541
Trésorerie	400	620
Dépôts auprès de contreparties	1 415	4 773
Devises	402	803
Montants à recevoir pour les placements vendus	4 163	257
Montants à recevoir au titre du revenu provenant de swaps	0	11
Montants à recevoir pour les parts vendues	0	45
Intérêts et dividendes à recevoir	214	138
	44 209	82 169
<b>Passif :</b>		
Passif courant :		
<i>Instruments financiers dérivés</i>		
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	198	362
Hors cote	471	2 500
Achats de placements à payer	12 661	426
Montants à payer pour l'intérêt sur les swaps	3	0
Dépôts de contreparties	1 008	806
Montants à payer pour les parts rachetées	0	66
Frais de gestion à payer	23	78
	14 364	4 238
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>29 845 USD</b>	<b>77 931 USD</b>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A (\$ US)	299 USD	1 106 USD
Nombre de parts rachetables - série A (\$ US)	34	126
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A (\$ US)	8,55 USD	8,70 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F (\$ US)	2 193 USD	7 150 USD
Nombre de parts rachetables - série F (\$ US)	256	813
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F (\$ US)	8,58 USD	8,80 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I (\$ US)	122 USD	118 USD
Nombre de parts rachetables - série I (\$ US)	14	13
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I (\$ US)	8,80 USD	8,95 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série A	3 122 USD	6 994 USD
Nombre de parts rachetables - série A	488	1 105
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	6,40 USD	6,33 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série A	8,48 \$	8,57 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série F	15 739 USD	54 573 USD
Nombre de parts rachetables - série F	2 446	8 488
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	6,43 USD	6,43 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série F	8,53 \$	8,71 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables - série I	8 370 USD	7 990 USD
Nombre de parts rachetables - série I	1 286	1 226
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	6,51 USD	6,52 USD
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part - série I	8,63 \$	8,83 \$
<sup>†</sup> Comprend les prises en pension de :	3 700 USD	8 800 USD

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États du résultat global Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)

(en milliers\*, sauf pour les montants par part)

	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Revenus :</b>		
<b>Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés</b>		
Intérêts à distribuer	2 010 USD	715 USD
Revenu (perte) sur dividendes	270	851
Revenu (perte) sur instruments dérivés	264	279
Gain (perte) net réalisé à la vente de placements	(8 024)	(7 056)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(3 700)	(3 221)
Gain (perte) net réalisé sur instruments financiers dérivés hors cote	1 603	(3 933)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements en portefeuille	8 173	(8 258)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(168)	973
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des instruments financiers dérivés hors cote	1 465	(1 563)
Gain (perte) net sur placements et instruments financiers dérivés	1 893	(21 213)
<b>Autres revenus (pertes)</b>		
Gain (perte) net réalisé sur opérations en devises	(827)	2 745
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente à la conversion des actifs et des passifs libellés en devises	15	(35)
Autres revenus (pertes)	(812)	2 710
Total - Revenus (pertes)	1 081	(18 503)
<b>Charges :</b>		
Frais de gestion	596	1 209
Frais liés au CEI	1	0
Charges d'intérêts	34	18
Retenues d'impôts	44	124
Coûts de transaction	38	61
Total - Charges	713	1 412
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>368 USD</b>	<b>(19 915) USD</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série</b>		
Série A (\$ US)	(18) USD	(151) USD
Série F (\$ US)	(15)	(817)
Série I (\$ US)	4	(13)
Série A	46	(2 110)
Série F	(29)	(15 280)
Série I	380	(1 544)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part</b>		
Série A (\$ US)	(0,20) USD	(1,12) USD
Série F (\$ US)	(0,02)	(1,01)
Série I (\$ US)	0,29	(1,00)
Série A	0,06	(1,41)
Série F	(0,00)	(1,28)
Série I	0,30	(1,28)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)

(en milliers\*)

	Exercice clos le 31 déc. 2023						
	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Série I (\$ US)	Série A	Série F	Série I	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	1 106 USD	7 150 USD	118 USD	6 994 USD	54 573 USD	7 990 USD	77 931 USD
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(18)	(15)	4	46	(29)	380	368
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>							
Provenant du revenu net de placement	(25)	(233)	(6)	(91)	(1 407)	(381)	(2 143)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(25)	(233)	(6)	(91)	(1 407)	(381)	(2 143)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>							
Produit de la vente de parts rachetables	0	2 521	0	381	9 257	0	12 159
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	24	228	6	83	1 093	381	1 815
Coût des parts rachetables rachetées	(788)	(7 458)	0	(4 291)	(47 748)	0	(60 285)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(764)	(4 709)	6	(3 827)	(37 398)	381	(46 311)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	(807)	(4 957)	4	(3 872)	(38 834)	380	(48 086)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	299 USD	2 193 USD	122 USD	3 122 USD	15 739 USD	8 370 USD	29 845 USD
<b>Transactions sur parts rachetables</b>							
Parts rachetables vendues	0	280	0	60	1 432	0	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	3	27	1	13	175	60	S.O.
Parts rachetables rachetées	(95)	(864)	0	(690)	(7 649)	0	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(92)	(557)	1	(617)	(6 042)	60	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	126	813	13	1 105	8 488	1 226	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	34	256	14	488	2 446	1 286	S.O.

  

	Exercice clos le 31 déc. 2022						
	Série A (\$ US)	Série F (\$ US)	Série I (\$ US)	Série A	Série F	Série I	Total
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	954 USD	5 335 USD	131 USD	9 060 USD	45 600 USD	9 534 USD	70 614 USD
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(151)	(817)	(13)	(2 110)	(15 280)	(1 544)	(19 915)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables :</b>							
Provenant du revenu net de placement	(12)	(116)	(1)	(172)	(1 470)	(157)	(1 928)
Total - Distributions aux porteurs de parts rachetables	(12)	(116)	(1)	(172)	(1 470)	(157)	(1 928)
<b>Transactions sur parts rachetables :</b>							
Produit de la vente de parts rachetables	690	6 618	0	11 647	108 697	0	127 652
Parts émises au réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	12	112	1	162	978	157	1 422
Coût des parts rachetables rachetées	(387)	(3 982)	0	(11 593)	(83 952)	0	(99 914)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	315	2 748	1	216	25 723	157	29 160
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période</b>	152	1 815	(13)	(2 066)	8 973	(1 544)	7 317
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	1 106 USD	7 150 USD	118 USD	6 994 USD	54 573 USD	7 990 USD	77 931 USD
<b>Transactions sur parts rachetables</b>							
Parts rachetables vendues	72	710	0	1 563	14 607	0	S.O.
Parts émises au réinvestissement des distributions	1	13	0	26	157	25	S.O.
Parts rachetables rachetées	(43)	(443)	0	(1 633)	(12 039)	0	S.O.
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	30	280	0	(44)	2 725	25	S.O.
<b>Parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	96	533	13	1 149	5 763	1 201	S.O.
<b>Parts rachetables à la clôture de la période</b>	126	813	13	1 105	8 488	1 226	S.O.

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## Tableaux des flux de trésorerie Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)

(en milliers*)	Exercice clos le 31 déc. 2023	Exercice clos le 31 déc. 2022
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	368 USD	(19 915) USD
<b>Ajustements au titre du rapprochement de l'augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et des entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation :</b>		
Achats de titres	(1 735 521)	(2 631 341)
Produit de la vente de placements	1 781 165	2 603 834
(Augmentation) diminution des dépôts auprès de contreparties	3 358	(3 837)
(Augmentation) diminution des montants à recevoir au titre du revenu provenant de swaps	11	(11)
(Augmentation) diminution des intérêts et des dividendes à recevoir	(76)	(122)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(3 727)	(2 250)
Produit (paiements) au titre des instruments financiers dérivés hors cote	1 609	(3 946)
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les swaps	3	0
Augmentation (diminution) des dépôts de contreparties	202	716
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(55)	24
Produit des opérations de vente à découvert	20 041	0
Paiements au titre des opérations de vente à découvert	(20 041)	0
Produit (paiements) au titre des opérations en devises	(809)	2 709
<i>(Gain) perte nette réalisée</i>		
Placements	8 024	7 056
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	3 700	3 221
Instruments financiers dérivés hors cote	(1 603)	3 933
Opérations en devises	827	(2 745)
<i>Variation nette de la (plus-value) moins-value latente</i>		
Placements	(8 173)	8 258
Instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	168	(973)
Instruments financiers dérivés hors cote	(1 465)	1 563
Conversion de passifs et d'actifs libellés en devises	(15)	35
Amortissement net des primes (des escomptes) sur les placements	(134)	(200)
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation</b>	<b>47 857</b>	<b>(33 991)</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement :</b>		
Produit de la vente de parts rachetables**	8 277	115 639
Montant payé au titre du rachat de parts rachetables**	(56 424)	(80 696)
Distributions en trésorerie versées aux porteurs de parts rachetables	(328)	(506)
Produit des accords cadres sur transactions à livrer	3 846	0
Paiements au titre des accords cadres sur transactions à livrer	(3 846)	0
<b>Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement</b>	<b>(48 475)</b>	<b>34 437</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des devises</b>	<b>(618)</b>	<b>446</b>
<b>Trésorerie (découvert) et devises :</b>		
Ouverture de l'exercice	1 423	976
Gain (perte) de change sur la trésorerie	(3)	1
Clôture de l'exercice	802 USD	1 423 USD
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie :</b>		
Intérêts payés liés aux activités de financement	33 USD	16 USD
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	1 788 USD	415 USD
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts étrangers liés aux activités d'exploitation	239 USD	706 USD

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

\*\* Ne comprend pas les transferts hors trésorerie entre les séries.

# Inventaire du portefeuille Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)

31 décembre 2023

(en milliers\*, sauf le nombre d'actions, de contrats, de parts ou d'onces, selon le cas)

	ACTIONS	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>PLACEMENTS DANS DES TITRES 122,6 %</b>			
<b>AUSTRALIE 0,1 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,1 %</b>			
Calix Ltd. <sup>a)</sup>	9 408	43 USD	22 USD
Total - Australie		43	22
<b>BELGIQUE 0,1 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,1 %</b>			
Umicore SA	1 300	49	36
Total - Belgique		49	36
		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	
<b>CANADA 2,6 %</b>			
<b>TITRES DU GOUVERNEMENT FÉDÉRAL 0,8 %</b>			
<b>Exportation et développement Canada</b>			
4,000 %, échéant le 19 févr. 2026	200 GBP	244	254
	ACTIONS		
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,6 %</b>			
Ballard Power Systems, Inc. <sup>a)</sup>	3 700	36	14
Canadian Solar, Inc. <sup>a)</sup>	1 400	51	37
Canfor Corp. <sup>a)</sup>	4 321	98	58
West Fraser Timber Co. Ltd.	662	59	56
		244	165
		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,2 %</b>			
<b>La Banque de Nouvelle-Écosse</b>			
4,750 %, échéant le 2 févr. 2026	100 USD	100	100
<b>La Banque Toronto-Dominion</b>			
4,443 %, échéant le 20 janv. 2025	200 EUR	217	221
5,532 %, échéant le 17 juill. 2026	50 USD	50	51
		367	372
Total - Canada		855	791
<b>ÎLES CAÏMANS 0,3 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 0,3 %</b>			
<b>GoldenTree Loan Management U.S. CLO Ltd.</b>			
6,587 %, échéant le 20 nov. 2030	86 USD	86	85
Total - Îles Caïmans		86	85
<b>RÉPUBLIQUE TCHÈQUE 0,7 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,7 %</b>			
<b>EP Infrastructure AS</b>			
1,698 %, échéant le 30 juill. 2026	200 EUR	179	199
Total - République tchèque		179	199
	ACTIONS		
<b>DANEMARK 0,6 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,6 %</b>			
Vestas Wind Systems AS	6 054	180	192
Total - Danemark		180	192

	ACTIONS	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>FINLANDE 1,4 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 1,4 %</b>			
Neste Oyj	3 300	155 USD	117 USD
Stora Enso Oyj, R	6 327	110	88
UPM-Kymmene Oyj	3 522	129	133
Valmet Oyj	2 741	104	79
Total - Finlande		498	417
<b>FRANCE 3,8 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,7 %</b>			
Rexel SA	3 600	89	99
Schneider Electric SE	585	98	118
		187	217
		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 1,4 %</b>			
<b>Arkea Home Loans SFH SA</b>			
3,000 %, échéant le 30 mars 2027	100 EUR	109	111
<b>Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA</b>			
5,896 %, échéant le 13 juill. 2026	200 USD	200	204
<b>Crédit Agricole Public Sector SCF SA</b>			
3,750 %, échéant le 13 juill. 2026	100 EUR	109	113
		418	428
<b>ÉMISSIONS SOUVERAINES 1,7 %</b>			
<b>Caisse des Dépôts et Consignations</b>			
3,375 %, échéant le 25 nov. 2030	100	106	116
<b>SNCF Réseau</b>			
4,500 %, échéant le 30 janv. 2024	200	215	221
<b>Ville de Paris</b>			
0,010 %, échéant le 2 janv. 2024	150	164	165
		485	502
Total - France		1 090	1 147
	ACTIONS		
<b>ALLEMAGNE 1,5 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,6 %</b>			
Siemens AG	500	82	94
SMA Solar Technology AG <sup>a)</sup>	800	36	54
thyssenkrupp AG	6 550	52	45
		170	193
		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,9 %</b>			
<b>Deutsche Bank AG</b>			
7,146 %, échéant le 13 juill. 2027	150 USD	150	156
<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b>			
2,875 %, échéant le 7 juin 2033	100 EUR	104	113
		254	269
Total - Allemagne		424	462
<b>IRLANDE 12,3 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 12,3 %</b>			
<b>Ares European CLO DAC</b>			
4,575 %, échéant le 15 avr. 2030	479 EUR	524	525



	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>SUPRANATIONAL 0,4 %</b>			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,4 %</b>			
Banque nordique d'investissement 3,875 %, échéant le 19 févr. 2026	100 GBP	122 USD	127 USD
Total - Supranational		122	127
ACTIONS			
<b>SWEDEN 0,5 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,5 %</b>			
Holmen AB, B	3 200	159	135
PowerCell Sweden AB <sup>a)</sup>	1 391	22	7
Total - Suède		181	142
<b>SUISSE 0,5 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,5 %</b>			
ABB Ltd.	3 040	106	135
Total - Suisse		106	135
<b>TAÏWAN 1,3 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 1,3 %</b>			
Chipbond Technology Corp.	6 000	15	14
Delta Electronics, Inc.	6 300	60	64
Elan Microelectronics Corp.	5 000	30	26
GlobalWafers Co. Ltd.	1 400	38	27
MediaTek, Inc.	600	22	20
Nanya Technology Corp.	7 700	20	20
Novatek Microelectronics Corp.	1 700	28	29
Realtek Semiconductor Corp.	1 700	31	26
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	4 100	91	79
Unimicron Technology Corp.	4 400	33	25
United Microelectronics Corp.	30 800	66	52
Total - Taiwan		434	382
<b>ROYAUME-UNI 1,3 %</b>			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 0,3 %</b>			
DS Smith PLC	15 800	62	62
ITM Power PLC <sup>a)</sup>	18 273	62	14
		124	76
VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 0,5 %</b>			
HSBC Holdings PLC 5,887 %, échéant le 14 août 2027	32 USD	32	32
Lloyds Bank PLC 3,250 %, échéant le 2 févr. 2026	100 EUR	109	111
		141	143
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 0,5 %</b>			
Precise Mortgage Funding PLC 6,420 %, échéant le 12 déc. 2055	39 GBP	46	50
Towd Point Mortgage Funding 6,365 %, échéant le 20 oct. 2051	29	35	36
Tower Bridge Funding PLC 6,120 %, échéant le 21 juill. 2064	43	52	55
		133	141
Total - Royaume-Uni		398	360

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>ÉTATS-UNIS 68,9 %</b>			
<b>TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS 0,9 %</b>			
MF1 Ltd. 7,176 %, échéant le 15 nov. 2035	256 USD	256 USD	255 USD
ACTIONS			
<b>ACTIONS ORDINAIRES 10,3 %</b>			
Airbnb, Inc., A <sup>a)</sup>	340	44	46
Alphabet, Inc., A <sup>a)</sup>	900	121	126
Applied Materials, Inc.	700	103	114
Arista Networks, Inc. <sup>a)</sup>	400	74	94
Best Buy Co., Inc.	500	35	39
Booking Holdings, Inc. <sup>a)</sup>	22	70	78
Centene Corp. <sup>a)</sup>	1 600	120	119
CF Industries Holdings, Inc.	1 300	106	103
Cisco Systems, Inc.	1 800	94	91
Elevance Health, Inc.	230	106	109
Enphase Energy, Inc. <sup>a)</sup>	1 225	210	162
EPAM Systems, Inc. <sup>a)</sup>	350	85	104
Exxon Mobil Corp.	900	99	90
Fastenal Co.	900	52	58
First Solar, Inc. <sup>a)</sup>	802	71	138
Flex Ltd. <sup>a)</sup>	3 000	53	91
FuelCell Energy, Inc. <sup>a)</sup>	15 800	54	25
Humana, Inc.	115	57	53
Incyte Corp. <sup>a)</sup>	750	48	47
Keysight Technologies, Inc. <sup>a)</sup>	700	108	111
KLA Corp.	230	116	134
Lam Research Corp.	170	118	133
Luminar Technologies, Inc. <sup>a)</sup>	5 714	90	19
NetApp, Inc.	1 100	87	97
Nucor Corp.	600	101	104
Psychex, Inc.	500	60	60
QUALCOMM, Inc.	800	103	116
QuantumScape Corp. <sup>a)</sup>	1 200	26	8
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. <sup>a)</sup>	160	127	141
Rockwell Automation, Inc.	110	30	34
Sensata Technologies Holding PLC	1 633	95	61
Steel Dynamics, Inc.	900	95	106
Teradyne, Inc.	900	95	98
Trimble, Inc. <sup>a)</sup>	1 200	84	64
Vertex Pharmaceuticals, Inc. <sup>a)</sup>	240	83	98
		3 020	3 071
VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)			
<b>OBLIGATIONS ET BILLETS DE SOCIÉTÉS 6,8 %</b>			
American Express Co. 4,900 %, échéant le 13 févr. 2026	200 USD	200	201
6,156 %, échéant le 13 févr. 2026	200	200	200
CVS Health Corp. 5,000 %, échéant le 20 févr. 2026	400	398	402
Goldman Sachs Group, Inc. 4,956 %, échéant le 7 févr. 2025	300 EUR	341	332
KeyBank NA 4,700 %, échéant le 26 janv. 2026	200 USD	200	195
Morgan Stanley Bank NA 5,479 %, échéant le 16 juill. 2025	250	250	252
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. 4,450 %, échéant le 13 mars 2026	37	37	37
Oracle Corp. 4,500 %, échéant le 6 mai 2028	11	11	11
State Street Corp. 4,857 %, échéant le 26 janv. 2026	200	200	199

## Inventaire du portefeuille Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada) (suite)

	VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)		VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)	COÛT MOYEN (EN MILLIERS)	JUSTE VALEUR (EN MILLIERS)
<b>Union Pacific Corp.</b>							
4,750 %, échéant le 21 févr. 2026	200 USD	200 USD	201 USD				
		2 037	2 030				
<b>TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES D'ORGANISMES NON GOUVERNEMENTAUX 6,3 %</b>							
<b>BIG Commercial Mortgage Trust</b>							
6,704 %, échéant le 15 févr. 2039	383	367	376				
<b>BX Commercial Mortgage Trust</b>							
6,352 %, échéant le 17 janv. 2039	400	380	393				
<b>BX Trust</b>							
6,111 %, échéant le 15 avr. 2039	749	691	728				
<b>New Orleans Hotel Trust</b>							
6,398 %, échéant le 15 avr. 2032	400	377	386				
		1 815	1 883				
ACTIONS							
<b>FIDUCIES DE PLACEMENT IMMOBILIER 0,2 %</b>							
<b>Weyerhaeuser Co.</b>							
	1 532	56	53				
VALEUR NOMINALE (EN MILLIERS)							
<b>ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX AMÉRICAINS 38,4 %</b>							
<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme</b>							
4,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> août 2053 - 1 <sup>er</sup> oct. 2053	987 USD	925	957				
6,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> oct. 2053 - 1 <sup>er</sup> janv. 2054	2 000	1 968	2 031				
<b>Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme, à déterminer</b>							
5,000 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2054	3 800	3 630	3 760				
5,500 %, échéant le 1 <sup>er</sup> janv. 2054	4 700	4 562	4 721				
		11 085	11 469				
<b>OBLIGATIONS DU TRÉSOR DES ÉTATS-UNIS 6,0 %</b>							
<b>Titres du Trésor des É.-U. indexés sur l'inflation <sup>d)</sup></b>							
0,625 %, échéant le 15 juill. 2032	741 USD	692 USD	677 USD				
1,125 %, échéant le 15 janv. 2033	413	408	391				
1,625 %, échéant le 15 oct. 2027	727	735	722				
		1 835	1 790				
Total - États-Unis		20 104	20 551				
<b>INSTRUMENTS À COURT TERME 17,8 %</b>							
<b>BILLETTS DE TRÉSORERIE 0,5 %</b>							
<b>Oesterreichische Kontrollbank AG</b>							
3,995 %, échéant le 2 avr. 2024	150 EUR	163 USD	164 USD				
<b>PRISES EN PENSION <sup>e)</sup> 12,4 %</b>							
		3 700	3 700				
<b>BONS DU TRÉSOR DU JAPON 3,9 %</b>							
(0,261 %), échéant le 4 avr. 2024 <sup>b), c)</sup>	80 000 JPY	562	568				
(0,174 %), échéant le 18 mars 2024 <sup>b), c)</sup>	74 000	510	525				
(0,156 %), échéant le 18 mars 2024 <sup>b), c)</sup>	12 000	83	85				
		1 155	1 178				
<b>BONS DU TRÉSOR DES ÉTATS-UNIS 1,0 %</b>							
5,468 %, échéant le 4 janv. 2024 <sup>b), c)</sup>	122 USD	122	122				
5,480 %, échéant le 4 janv. 2024 <sup>b), c)</sup>	175	175	175				
		297	297				
Total - Placements à court terme		5 315	5 339				
Total - Placements dans des titres		36 645	36 597				
<b>Total - Placements 122,6 %</b>		<b>36 645 USD</b>	<b>36 597 USD</b>				
<b>Instruments financiers dérivés <sup>f), g)</sup> 1,2 %</b>							
		11	349				
<b>Passifs, moins les autres actifs (23,8) %</b>							
			(7 101)				
<b>Total de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables 100,0 %</b>							<b>29 845 USD</b>

### NOTES À L'INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE :

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

a) Titre n'ayant produit aucun revenu au cours des douze derniers mois.

b) Coupon représentant un rendement à l'échéance.

c) Titre à coupon zéro.

d) Le montant du capital du titre est indexé selon l'inflation.

### EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

#### e) PRISES EN PENSION

Contrepartie	Taux de financement	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du capital	Garanti par	Garanties (reçues)	Prises en pension, à la valeur	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	
TDM	5,450 %	29 déc. 2023	2 janv. 2024	3 700 USD	Obligations du Trésor des États-Unis, 2,375 %, échéant le 15 févr. 2042	(3 794) USD	3 700 USD	3 702 USD	
<b>Total - Prises en pension de titres</b>							<b>(3 794) USD</b>	<b>3 700 USD</b>	<b>3 702 USD</b>

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

Le solde moyen des emprunts pendant l'exercice clos le 31 décembre 2023 était de (36) \$ à un taux d'intérêt pondéré moyen de 4,958 %. Les emprunts peuvent comprendre des mises en pension et des accords cadres sur transactions à livrer.

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et des autres opérations de financement et des garanties données(reçues).

## f) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE

### OPTIONS ACHETÉES

#### OPTIONS SUR INDICES

Description	Valeur d'exercice	Date d'expiration	Nombre de contrats	Coût	Juste valeur
Vente - CBOE S&P 500	4 250,000	19 janv. 2024	4	45 USD	1 USD
Vente - CBOE S&P 500	4 400,000	15 mars 2024	2	12	4
<b>Total des options achetées</b>				<b>57 USD</b>	<b>5 USD</b>

### OPTIONS VENDUES :

#### OPTIONS SUR INDICES

Description	Valeur d'exercice	Date d'expiration	Nombre de contrats	Primes (reçues)	Juste valeur
Vente - CBOE S&P 500	4 000,000	19 janv. 2024	4	(23) USD	0 USD
Achat - CBOE S&P 500	4 650,000	19 janv. 2024	4	(12)	(58)
Vente - CBOE S&P 500	4 200,000	15 mars 2024	2	(7)	(3)
Achat - CBOE S&P 500	4 900,000	15 mars 2024	2	(4)	(12)
<b>Total - options vendues</b>				<b>(46) USD</b>	<b>(73) USD</b>

### CONTRATS À TERME :

Description	Type	Mois de l'échéance	Nombre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	Marge de variation	
					Actif	Passif
Contrats à terme sur obligations du gouvernement de l'Australie à 10 ans, mars	Position longue	Mars 2024	63	143 USD	31 USD	(25) USD
Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada à 10 ans, mars	Position longue	Mars 2024	4	17	0	0
Contrats à terme E-Mini sur l'indice Russell 2000, mars	Position longue	Mars 2024	9	47	0	(14)
Contrats à terme E-Mini sur l'indice S&P 500, mars	Position longue	Mars 2024	20	162	0	(12)
Contrats à terme Euro STOXX 50, mars	Position longue	Mars 2024	5	(2)	0	(1)
Contrats à terme Euro-BTP, mars	Position longue	Mars 2024	8	38	0	(18)
Contrats à terme Euro-Bund, mars	Position longue	Mars 2024	21	96	0	(33)
Contrats à terme sur titres du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position courte	Mars 2024	10	(41)	0	0
Contrats à terme Ultra sur obligations à long terme du Trésor des É.-U. à 10 ans, mars	Position courte	Mars 2024	19	(97)	2	0
Contrats à terme sur obligations du Royaume-Uni à long terme, mars	Position longue	Mars 2024	6	53	0	(9)
<b>Total des contrats à terme</b>				<b>416 USD</b>	<b>33 USD</b>	<b>(112) USD</b>

### SWAPS :

#### SWAPS SUR DÉFAILLANCE D'INDICES DE CRÉDIT - PROTECTION À LA VENTE <sup>1)</sup>

Indice/tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Valeur notionnelle <sup>2)</sup>	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur <sup>3)</sup>	Marge de variation	
						Actif	Passif
Indice CDX.IG-41 à 05 ans	1,000 %	20 déc. 2028	9 600	73 USD	186 USD	0 USD	(2) USD

<sup>1)</sup> Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, le Fonds soit i) versera à l'acheteur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et prendra livraison de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) paiera un montant net de règlement, sous forme de trésorerie, de titres ou d'autres obligations livrables, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence.

<sup>2)</sup> Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait devoir payer en tant que vendeur de protection de crédit ou recevoir en tant qu'acheteur de protection de crédit en cas d'incident de crédit, conformément aux dispositions du swap en question.

<sup>3)</sup> Les cours et les valeurs résultantes des swaps sur défaillance permettent de suivre l'évolution du risque de paiement/rendement et déterminent la probabilité qu'un passif (ou un actif) attendu sur le dérivé de crédit soit réalisé si le swap est dénoué ou si le notionnel est vendu à la clôture de la période. L'augmentation des justes valeurs en termes absolus, lorsque comparées aux valeurs notionnelles du swap, indique un affaiblissement du niveau de solvabilité de l'instrument référencé sous-jacent et une plus grande probabilité de défaillance ou de risque de défaillance, ou de survenance d'autres incidents de crédit définis dans les dispositions de l'accord.

## Inventaire du portefeuille Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada) (suite)

### SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	Marge de variation		
							Actif	Passif	
À payer	SONIO en GBP à un jour-OIS composé	5,000 %	20 mars 2029	2 350 GBP	172 USD	233 USD	0 USD	(8) USD	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	2,750	21 juin 2053	1 200 USD	19	122	5	0	
À recevoir	SOFR en USD à un jour-OIS composé	3,250	20 déc. 2053	400	9	3	2	0	
À payer	Acceptations bancaires en CAD à 3 mois	1,250	16 juin 2031	2 220 \$	87	(235)	2	0	
À payer	EURIBOR en EUR à 6 mois	2,547	9 mars 2033	300 EUR	9	2	0	(3)	
						296 USD	125 USD	9 USD	(11) USD
<b>Total des swaps</b>						<b>369 USD</b>	<b>311 USD</b>	<b>9 USD</b>	<b>(13) USD</b>

Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée.

### g) INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE

#### CONTRATS DE CHANGE À TERME :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente		
				Actif	Passif	
BOA	Janv. 2024	552 AUD	365 USD	0 USD	(11) USD	
	Janv. 2024	2 599 139 COP	679	10	0	
	Janv. 2024	72 GBP	92	0	0	
	Janv. 2024	56 098 HUF	160	0	(1)	
	Janv. 2024	1 307 NOK	123	0	(6)	
	Janv. 2024	1 877 SEK	180	0	(6)	
	Janv. 2024	646 USD	2 599 139 COP	24	0	
	Janv. 2024	83	66 GBP	1	0	
	Févr. 2024	141	998 CNY	0	0	
	Mars 2024	670	2 599 139 COP	0	(9)	
	Mars 2024	206	17 217 INR	0	0	
	Mars 2024	22	679 TWD	1	0	
	BPS	Janv. 2024	166 EUR	181 USD	0	(2)
		Janv. 2024	1 283 GBP	1 621	0	(14)
		Janv. 2024	3 163 HUF	9	0	0
		Janv. 2024	47 637 JPY	325	0	(13)
		Janv. 2024	117 USD	175 AUD	2	0
Janv. 2024		90	121 \$	1	0	
Janv. 2024		47	320 DKK	1	0	
Janv. 2024		157	144 EUR	2	0	
Janv. 2024		102	14 900 JPY	4	0	
Janv. 2024		284	5 258 ZAR	3	0	
Févr. 2024		397	2 818 CNY	1	0	
Févr. 2024		205	6 531 TWD	10	0	
Mars 2024		112 370 TWD	3 563 USD	0	(159)	
Mars 2024		715 USD	59 804 INR	1	0	
Mars 2024		1 508	46 878 TWD	45	0	
CBK		Janv. 2024	180 007 KRW	138 USD	0	(3)
		Janv. 2024	1 288 \$	947	0	(25)
	Janv. 2024	136 CHF	156	0	(6)	
	Janv. 2024	49 EUR	53	0	(1)	
	Janv. 2024	4 825 HUF	14	0	0	
	Janv. 2024	316 NOK	30	0	(2)	
	Janv. 2024	97 USD	144 AUD	1	0	
	Janv. 2024	26	128 BRL	0	0	
	Janv. 2024	191	173 EUR	1	0	
	Janv. 2024	82	65 GBP	1	0	
	Janv. 2024	1 196	20 837	25	0	
	Janv. 2024	16	64 PLN	0	0	
	Janv. 2024	316	5 820 ZAR	2	0	
	Févr. 2024	923	4 732 BRL	50	0	
	Mars 2024	830 BRL	169 USD	0	(1)	
	Mars 2024	3 518 ILS	966	0	(8)	
	Mars 2024	10 USD	35 ILS	0	0	
Mars 2024	632	2 381 PEN	10	0		
Avril 2024	130 BRL	26 USD	0	0		
Avril 2024	80 000 JPY	571	0	(4)		
Juin 2024	96 046 KRW	75	0	0		

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
DUB	Janv. 2024	44 USD	38 CHF	2 USD	0 USD
	Janv. 2024	635	561 124 CLP	1	0
	Janv. 2024	22	20 EUR	0	0
	Févr. 2024	240 BRL	49 USD	0	0
	Mars 2024	153	31	0	(1)
	Juin 2024	86 383 KRW	66	0	(1)
GLM	Janv. 2024	129 BRL	26	0	(1)
	Janv. 2024	1 260 DKK	186	0	(1)
	Janv. 2024	208 EUR	225	0	(5)
	Janv. 2024	74 937 HUF	213	0	(2)
	Janv. 2024	22 955 MXN	1 309	0	(37)
	Janv. 2024	61 USD	82 \$	1	0
	Janv. 2024	83	11 800 JPY	1	0
	Janv. 2024	38	696 MXN	2	0
	Janv. 2024	452	4 710 NOK	12	0
	Janv. 2024	225 ZAR	12 USD	0	(1)
	Févr. 2024	8 BRL	2	0	0
	Févr. 2024	110 USD	3 362 TRY	0	(1)
	Mars 2024	37	1 161	0	0
	Janv. 2024	8 415 EUR	9 201 USD	0	(91)
MBC	Janv. 2024	336 PLN	77	0	(9)
	Janv. 2024	99 USD	150 AUD	3	0
	Janv. 2024	243	222 EUR	2	0
	Janv. 2024	54	43 GBP	0	0
	Janv. 2024	947	347 326 HUF	52	0
	Janv. 2024	40	425 NOK	2	0
	Janv. 2024	56	580 SEK	2	0
	Févr. 2024	3 747 CNY	521 USD	0	(9)
	Mars 2024	2 548 HKD	327	0	0
	Mars 2024	86 000 JPY	609	0	(8)
	Mars 2024	8 767 CLP	10	0	0
	Mars 2024	40 030 COP	10	0	0
	Mars 2024	1 082 INR	13	0	0
	Mars 2024	34 PEN	9	0	0
Mars 2024	9 USD	278 TWD	0	0	
Avril 2024	33 MXN	2 USD	0	0	
				276 USD	(438) USD

**CONTRATS DE CHANGE À TERME EN COURS, EN CAD, SÉRIE COUVERTE† :**

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value/ (moins-value) latente	
				Actif	Passif
BOA	Janv. 2024	14 \$	10	0 USD	0 USD
BPS	Janv. 2024	44	32	0	(1)
	Janv. 2024	114 USD	155 \$	3	0
CBK	Janv. 2024	1 141 \$	846 USD	0	(15)
	Janv. 2024	9 002 USD	12 236 \$	234	0
GLM	Janv. 2024	811 \$	602 USD	0	(10)
	Janv. 2024	17 005 USD	23 100 \$	430	0
MBC	Janv. 2024	423 \$	313 USD	0	(7)
	Janv. 2024	1 309 USD	1 771 \$	28	0
MYI	Janv. 2024	1 029	1 364	0	0
				695 USD	(33) USD
<b>Total des contrats de change à terme</b>				<b>971 USD</b>	<b>(471) USD</b>

† Le Fonds offre des séries en CAD, couvertes, et utilise des techniques et des instruments pour réduire l'exposition au dollar américain, en totalité ou en partie. Il est impossible de garantir que les séries CAD, couvertes, seront couvertes en tout temps ni que la technique de couverture sera efficace.

## SWAPS :

## SWAPS SUR LE RENDEMENT TOTAL D'INDICES BOURSIERS

Contrepartie	À payer/ à recevoir <sup>1)</sup>	Entité de référence sous-jacente	Nombre de parts	Taux de financement	Date d'échéance	Valeur notionnelle	Primes payées/ (reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Swaps, à la valeur	
									Actif	Passif
BOA	À recevoir	Indice IXUTR	233	5,730 % (USD-LIBOR à 1 mois plus un écart précisé)	2 oct. 2024	745 USD	0 USD	0 USD	0 USD	0 USD
BPS	À payer	Indice EURO STOXX Banks	3 900	3,909 % (USD-LIBOR à 1 mois plus un écart précisé)	23 oct. 2024	462 EUR	0	0	0	0
	À recevoir	Indice EURO STOXX Insurance	1 300	4,009 % (USD-LIBOR à 1 mois plus un écart précisé)	23 oct. 2024	455	0	0	0	0
RBC	À payer	Indice SPSIHOTR	13	5,760 % (USD-LIBOR à 1 mois plus un écart précisé)	1 <sup>er</sup> mai 2024	160 USD	0	0	0	0
<b>Total des swaps</b>							<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>

<sup>1)</sup> « À recevoir » signifie que le Fonds reçoit des paiements pour tout rendement net positif de l'entité de référence sous-jacente. Le Fonds effectue des paiements pour tout rendement net négatif de l'entité de référence sous-jacente. « À payer » signifie que le Fonds reçoit des paiements pour tout rendement net négatif de l'entité de référence sous-jacente. Le Fonds effectue des paiements pour tout rendement net positif de l'entité de référence sous-jacente.

**Vous trouverez dans les notes annexes propres au Fonds un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues).**

(en milliers\*)

\* Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

**SOMMAIRE DES EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA) TDM	3 702 USD	0 USD	0 USD	3 702 USD	(3 794) USD	(92) USD
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement <sup>3)</sup></b>	<b>3 702 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des emprunts et autres opérations de financement et des garanties données/(reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Produit à recevoir au titre des prises en pension <sup>1)</sup>	Montant à payer pour les mises en pension	Montant à payer pour les accords cadres sur transactions à livrer	Total des emprunts et autres opérations de financement	Garanties données/(reçues)	Exposition nette <sup>2)</sup>
Accords cadres de mise en pension (MRA et GMRA) TOR	8 804 USD	0 USD	0 USD	8 804 USD	(9 186) USD	(382) USD
<b>Total des emprunts et des autres opérations de financement <sup>3)</sup></b>	<b>8 804 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>			

<sup>1)</sup> Comprend les intérêts courus.

<sup>2)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux emprunts et autres opérations de financement ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

<sup>3)</sup> Les emprunts se sont établis entre 0 USD et 2 026 USD pour la période close le 31 décembre 2023 (entre 0 USD et 0 USD pour la période close le 31 décembre 2022).

**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : NÉGOCIÉS EN BOURSE OU FAISANT L'OBJET D'UNE COMPENSATION CENTRALISÉE - SOMMAIRE**

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2023 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
<b>Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée</b>	<b>5 USD</b>	<b>33 USD</b>	<b>9 USD</b>	<b>47 USD</b>	<b>(73) USD</b>	<b>(112) USD</b>	<b>(13) USD</b>	<b>(198) USD</b>

Vous trouverez ci-dessous un sommaire de la juste valeur et de la marge de variation des instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée au 31 décembre 2022 :

	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés			
	Juste valeur	Marge de variation des actifs			Juste valeur	Marge de variation des passifs		
		Options achetées	Contrats à terme	Swaps		Total	Options vendues	Contrats à terme
<b>Total - Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée</b>	<b>3 USD</b>	<b>348 USD</b>	<b>1 USD</b>	<b>352 USD</b>	<b>(28) USD</b>	<b>(306) USD</b>	<b>(28) USD</b>	<b>(362) USD</b>

## Notes annexes propres au Fonds Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada) (suite)

### INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS : HORS COTE - SOMMAIRE

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2023 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
BOA	36 USD	0 USD	0 USD	36 USD	(33) USD	0 USD	0 USD	(33) USD	3 USD	0 USD	3 USD
BPS	73	0	0	73	(192)	0	0	(192)	(119)	0	(119)
CBK	324	0	0	324	(62)	0	0	(62)	262	(300)	(38)
DUB	3	0	0	3	(2)	0	0	(2)	1	0	1
GLM	446	0	0	446	(58)	0	0	(58)	388	(450)	(62)
MBC	89	0	0	89	(124)	0	0	(124)	(35)	0	(35)
RBC	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Total - Hors cote</b>	<b>971 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>971 USD</b>	<b>(471) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(471) USD</b>			

Vous trouverez ci-dessous un sommaire, par contrepartie, de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et des garanties données (reçues) au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Actifs financiers dérivés				Passifs financiers dérivés				Juste valeur nette des dérivés hors cote	Garanties données/ (reçues)	Exposition nette <sup>1)</sup>
	Contrats de change à terme	Options achetées	Swaps	Total - Hors cote	Contrats de change à terme	Options vendues	Swaps	Total - Hors cote			
BOA	178 USD	0 USD	0 USD	178 USD	(51) USD	0 USD	0 USD	(51) USD	127 USD	0 USD	127 USD
BPS	411	132	0	543	(40)	(36)	0	(76)	467	(260)	207
CBK	180	0	0	180	(56)	(13)	0	(69)	111	0	111
DUB	356	0	0	356	0	0	0	0	356	(300)	56
GLM	264	0	0	264	(195)	(30)	0	(225)	39	(90)	(51)
MBC	16	0	0	16	(746)	0	0	(746)	(730)	563	(167)
RBC	4	0	0	4	(19)	0	0	(19)	(15)	0	(15)
TOR	0	0	0	0	(1 314)	0	0	(1 314)	(1 314)	1 378	64
<b>Total - Hors cote</b>	<b>1 409 USD</b>	<b>132 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>1 541 USD</b>	<b>(2 421) USD</b>	<b>(79) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(2 500) USD</b>			

<sup>1)</sup> L'exposition nette représente le montant net qui devrait être reçu ou payé par la contrepartie en cas de défaillance. L'exposition aux instruments financiers dérivés hors cote ne peut être compensée que pour les opérations régies par le même accord cadre avec la même entité juridique. Pour de plus amples renseignements, consultez la note 9 « Accords de compensation cadres ».

### ÉVALUATIONS DE LA JUSTE VALEUR

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2023 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Australie				
Actions ordinaires	0 USD	22 USD	0 USD	22 USD
Belgique				
Actions ordinaires	0	36	0	36
Canada				
Titres du gouvernement fédéral	0	254	0	254
Actions ordinaires	165	0	0	165
Obligations et billets de sociétés	0	372	0	372
Îles Caïmans				
Titres adossés à des actifs	0	85	0	85
République tchèque				
Obligations et billets de sociétés	0	199	0	199
Danemark				
Actions ordinaires	0	192	0	192
Finlande				
Actions ordinaires	0	417	0	417
France				
Actions ordinaires	0	217	0	217
Obligations et billets de sociétés	0	428	0	428
Émissions souveraines	0	502	0	502
Allemagne				
Actions ordinaires	0	193	0	193
Obligations et billets de sociétés	0	269	0	269

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2023
Irlande				
Titres adossés à des actifs	0 USD	3 671 USD	0 USD	3 671 USD
Israël				
Actions ordinaires	74	0	0	74
Italie				
Titres adossés à des actifs	0	40	0	40
Actions ordinaires	0	16	0	16
Obligations et billets de sociétés	0	114	0	114
Japon				
Actions ordinaires	0	158	0	158
Obligations et billets de sociétés	0	200	0	200
Luxembourg				
Titres adossés à des actifs	0	313	0	313
Pays-Bas				
Titres adossés à des actifs	0	212	0	212
Obligations et billets de sociétés	0	222	0	222
Norvège				
Actions ordinaires	0	113	0	113
Obligations et billets de sociétés	0	111	0	111
Roumanie				
Émissions souveraines	0	397	0	397
Singapour				
Obligations et billets de sociétés	0	167	0	167
Corée du Sud				
Actions ordinaires	0	199	0	199
Obligations et billets de sociétés	0	202	0	202
Titres privilégiés	0	1	0	1
Supranational				
Obligations et billets de sociétés	0	127	0	127
Suède				
Actions ordinaires	0	142	0	142
Suisse				
Actions ordinaires	0	135	0	135
Taiwan				
Actions ordinaires	0	382	0	382
Royaume-Uni				
Actions ordinaires	0	76	0	76
Obligations et billets de sociétés	0	143	0	143
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	141	0	141
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	255	0	255
Actions ordinaires	3 071	0	0	3 071
Obligations et billets de sociétés	0	2 030	0	2 030
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	1 883	0	1 883
Fiducies de placement immobilier	53	0	0	53
Organismes gouvernementaux américains	0	11 469	0	11 469
Obligations du Trésor américain	0	1 790	0	1 790
Instruments à court terme				
Billets de trésorerie	0	164	0	164
Prises en pension	0	3 700	0	3 700
Bons du Trésor du Japon	0	1 178	0	1 178
Bons du Trésor des États-Unis	0	297	0	297
Total - Placements	3 363 USD	33 234 USD	0 USD	36 597 USD
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	31	16	0	47
Hors cote	0	971	0	971
	31 USD	987 USD	0 USD	1 018 USD
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(112)	(86)	0	(198)
Hors cote	0	(471)	0	(471)
	(112) USD	(557) USD	0 USD	(669) USD
Total - Instruments financiers dérivés	(81) USD	430 USD	0 USD	349 USD
Totaux	3 282 USD	33 664 USD	0 USD	36 946 USD

## Notes annexes propres au Fonds Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada) (suite)

Vous trouverez ci-dessous un sommaire des évaluations de la juste valeur fondées sur les données d'entrée utilisées au 31 décembre 2022 lors de l'évaluation des actifs et des passifs du Fonds :

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Placements dans des titres, à la valeur</b>				
Australie				
Actions ordinaires	0 USD	54 USD	0 USD	54 USD
Autriche				
Actions ordinaires	0	161	0	161
Canada				
Actions ordinaires	759	0	0	759
Îles Caïmans				
Titres adossés à des actifs	0	5 489	0	5 489
Chine				
Actions ordinaires	455	933	0	1 388
Danemark				
Actions ordinaires	0	699	0	699
Finlande				
Actions ordinaires	0	1 271	0	1 271
France				
Actions ordinaires	0	405	0	405
Allemagne				
Actions ordinaires	0	595	0	595
Irlande				
Titres adossés à des actifs	0	4 846	0	4 846
Actions ordinaires	306	0	0	306
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	470	0	470
Israël				
Actions ordinaires	734	0	0	734
Italie				
Titres adossés à des actifs	0	116	0	116
Japon				
Actions ordinaires	0	5 055	0	5 055
Luxembourg				
Titres adossés à des actifs	0	678	0	678
Obligations et billets de sociétés	0	104	0	104
Pays-Bas				
Titres adossés à des actifs	0	321	0	321
Actions ordinaires	291	79	0	370
Norvège				
Actions ordinaires	0	413	0	413
Corée du Sud				
Actions ordinaires	0	1 893	0	1 893
Suède				
Actions ordinaires	0	376	0	376
Suisse				
Actions ordinaires	0	512	0	512
Taiwan				
Actions ordinaires	0	2 784	0	2 784
Royaume-Uni				
Actions ordinaires	0	76	0	76
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	366	0	366
États-Unis				
Titres adossés à des actifs	0	357	0	357
Actions ordinaires	14 298	0	0	14 298
Obligations et billets de sociétés	0	370	0	370
Titres adossés à des créances hypothécaires d'organismes non gouvernementaux	0	1 980	0	1 980
Fiducies de placement immobilier	277	0	0	277
Instruments à court terme				
Billets de trésorerie	0	2 992	0	2 992
Prises en pension	0	8 800	0	8 800
Billets à court terme	0	2 100	0	2 100
Bons du Trésor d'Israël	0	284	0	284
Bons du Trésor du Japon	0	9 450	0	9 450
Bons du Trésor des États-Unis	0	2 480	0	2 480
Total - Placements	17 120 USD	56 509 USD	0 USD	73 629 USD

Catégorie et sous-catégorie	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Juste valeur au 31 déc. 2022
<b>Instruments financiers dérivés - Actifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	348 USD	4 USD	0 USD	352 USD
Hors cote	0	1 541	0	1 541
	348 USD	1 545 USD	0 USD	1 893 USD
<b>Instruments financiers dérivés - Passifs</b>				
Négoiés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée	(202) USD	(160) USD	0 USD	(362) USD
Hors cote	0	(2 500)	0	(2 500)
	(202) USD	(2 660) USD	0 USD	(2 862) USD
Total - Instruments financiers dérivés	146 USD	(1 115) USD	0 USD	(969) USD
Totaux	17 266 USD	55 394 USD	0 USD	72 660 USD

Il n'y a eu aucun transfert significatif entre les niveaux 1, 2 ou 3 pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

## CONCENTRATION DU PORTEFEUILLE

Le portefeuille de placements du Fonds est concentré dans les segments suivants :

Placements, à la juste valeur	31 déc. 2023	31 déc. 2022
Australie	0,1 %	0,1 %
Autriche	0,0 %	0,2 %
Belgique	0,1 %	0,0 %
Canada	2,6 %	1,0 %
Îles Caïmans	0,3 %	7,0 %
Chine	0,0 %	1,8 %
République tchèque	0,7 %	0,0 %
Danemark	0,6 %	0,9 %
Finlande	1,4 %	1,6 %
France	3,8 %	0,5 %
Allemagne	1,5 %	0,8 %
Irlande	12,3 %	7,2 %
Israël	0,2 %	0,9 %
Italie	0,6 %	0,1 %
Japon	1,2 %	6,5 %
Luxembourg	1,0 %	1,0 %
Pays-Bas	1,4 %	0,9 %
Norvège	0,8 %	0,5 %
Roumanie	1,3 %	0,0 %
Singapour	0,6 %	0,0 %
Corée du Sud	1,4 %	2,4 %
Supranational	0,4 %	0,0 %
Suède	0,5 %	0,5 %
Suisse	0,5 %	0,7 %
Taiwan	1,3 %	3,6 %
Royaume-Uni	1,3 %	0,6 %
États-Unis	68,9 %	22,2 %
Instruments à court terme	17,8 %	33,5 %
Instruments financiers dérivés	1,2 %	(1,3) %
Passifs, moins les autres actifs	(23,8) %	6,8 %
Total (% de l'actif net)	100,0 %	100,0 %

RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

RISQUE DE CHANGE

Les tableaux ci-dessous indiquent l'exposition globale au risque de change, sauf celui afférent à la monnaie fonctionnelle du Fonds.

Au 31 décembre 2023	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Devises et placements, à la valeur	Contrats de change à terme	Exposition nette
Dollar australien	72 USD	(88) USD	(16) USD	Dollar australien	141 USD	(318) USD	(177) USD
Réal brésilien	0	694	694	Réal brésilien	0	1 861	1 861
Livre sterling	452	(1 505)	(1 053)	Livre sterling	534	(2 889)	(2 355)
Dollar canadien	(6 728)	(819)	(7 547)	Dollar canadien	(5 685)	381	(5 304)
Peso chilien	0	626	626	Peso chilien	0	1 874	1 874
Yuan renminbi chinois (continental)	0	10	10	Yuan renminbi chinois (continental)	0	2 182	2 182
Peso colombien	0	650	650	Peso colombien	0	637	637
Couronne danoise	197	(139)	58	Couronne danoise	704	(767)	(63)
Euro	8 690	(9 291)	(601)	Euro	12 965	(16 492)	(3 527)
Dollar de Hong Kong	0	(327)	(327)	Dollar de Hong Kong	933	(1 387)	(454)
Forint hongrois	0	599	599	Forint hongrois	0	2 181	2 181
Roupie indienne	0	909	909	Roupie indienne	0	1 885	1 885
Shekel israélien	0	(964)	(964)	Shekel israélien	284	(2 150)	(1 866)
Yen japonais	1 380	(1 341)	39	Yen japonais	14 751	(14 875)	(124)
Won coréen	201	(283)	(82)	Won coréen	1 897	(1 771)	126
Peso mexicain	0	(85)	(85)	Peso mexicain	2	(960)	(958)
Dollar néo-zélandais	1	0	1	Dollar néo-zélandais	1	0	1
Couronne norvégienne	113	346	459	Couronne norvégienne	413	1 898	2 311
Nouveau sol péruvien	0	633	633	Nouveau sol péruvien	0	899	899
Zloty polonais	0	(69)	(69)	Zloty polonais	0	1 638	1 638
Rand sud-africain	0	593	593	Rand sud-africain	0	0	0
Couronne suédoise	142	(129)	13	Couronne suédoise	377	352	729
Franc suisse	139	(117)	22	Franc suisse	443	(760)	(317)
Dollar de Taïwan	386	(1 922)	(1 536)	Dollar de Taïwan	2 791	(6 145)	(3 354)
Nouvelle livre turque	0	146	146	Nouvelle livre turque	0	0	0
	5 045 USD	(11 873) USD	(6 828) USD		30 551 USD	(32 726) USD	(2 175) USD

Les tableaux ci-dessous résument le risque de change lié aux séries en CAD, couvertes, qui est compensé par des contrats de change à terme.

Au 31 décembre 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables en CAD, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en CAD, série couverte	Exposition nette	Au 31 décembre 2022	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables en CAD, série couverte	Contrats de change à terme en cours, en CAD, série couverte	Exposition nette
	27 231 USD	(27 318) USD	(87) USD		69 557 USD	(69 507) USD	50 USD

Au 31 décembre 2023, si le dollar américain avait progressé ou reculé de 5 % par rapport aux autres monnaies, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ (341) USD [(108) USD au 31 décembre 2022]. Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Au 31 décembre 2023, si le dollar américain avait progressé ou reculé de 5 % par rapport au dollar canadien, tous les autres facteurs demeurant constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables des séries couvertes aurait diminué ou augmenté d'environ (4) USD (3 USD au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

## RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt. Ils incluent les instruments financiers du Fonds à la juste valeur, classés en fonction de la date d'échéance. Certains actifs ou passifs figurant dans l'état de la situation financière, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, ont été regroupés pour permettre la présentation ci-dessous.

<b>Actif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	4 993 USD	732 USD	6 102 USD	19 109 USD	5 661 USD	36 597 USD
Instruments financiers dérivés	971	0	0	9	38	1 018
Trésorerie et devises	0	0	0	0	802	802
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	1 415	1 415
Montants à recevoir	0	0	0	0	4 377	4 377
<b>Total - Actif</b>	<b>5 964 USD</b>	<b>732 USD</b>	<b>6 102 USD</b>	<b>19 118 USD</b>	<b>12 293 USD</b>	<b>44 209 USD</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	(463) USD	(8) USD	0 USD	(11) USD	(187) USD	(669) USD
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(1 008)	(1 008)
Montants à payer	0	0	0	0	(12 687)	(12 687)
<b>Total - Passif</b>	<b>(463) USD</b>	<b>(8) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(11) USD</b>	<b>(13 882) USD</b>	<b>(14 364) USD</b>

  

<b>Actif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Placements, à la juste valeur	26 105 USD	154 USD	320 USD	14 624 USD	32 426 USD	73 629 USD
Instruments financiers dérivés	1 388	21	0	0	484	1 893
Trésorerie et devises	0	0	0	0	1 423	1 423
Dépôts auprès de contreparties	0	0	0	0	4 773	4 773
Montants à recevoir	0	0	0	0	451	451
<b>Total - Actif</b>	<b>27 493 USD</b>	<b>175 USD</b>	<b>320 USD</b>	<b>14 624 USD</b>	<b>39 557 USD</b>	<b>82 169 USD</b>

  

<b>Passif au 31 décembre 2022</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>1 an à 5 ans</b>	<b>Plus de 5 ans</b>	<b>Non productif d'intérêts</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	(2 416) USD	(5) USD	0 USD	(27) USD	(414) USD	(2 862) USD
Dépôts de contreparties	0	0	0	0	(806)	(806)
Montants à payer	0	0	0	0	(570)	(570)
<b>Total - Passif</b>	<b>(2 416) USD</b>	<b>(5) USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>(27) USD</b>	<b>(1 790) USD</b>	<b>(4 238) USD</b>

Au 31 décembre 2023, si les taux d'intérêt en vigueur avaient progressé ou reculé de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 1 348 USD, ou 4,5 % (2 221 USD, ou 2,8 %, au 31 décembre 2022). La sensibilité du Fonds à la variation des taux d'intérêt a été estimée d'après la durée moyenne pondérée des instruments de créance. Dans les faits, les résultats des opérations peuvent différer et la différence peut être importante.

## AUTRE RISQUE DE PRIX

Au 31 décembre 2023, si le prix des actions avait augmenté ou diminué de 5 %, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué de 283 USD (1 621 USD au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

## RISQUE DE LIQUIDITÉ

Les tableaux ci-dessous font état des passifs du Fonds, à l'exception de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables exigible à vue, par date de paiement contractuel : moins de trois mois, de trois mois à un an ou plus d'un an, selon le cas.

<b>Passif courant au 31 décembre 2023</b>	<b>Moins de 3 mois</b>	<b>3 mois à 1 an</b>	<b>Plus de 1 an</b>	<b>Total</b>
Instruments financiers dérivés	650 USD	8 USD	11 USD	669 USD
Achats de placements à payer	12 661	0	0	12 661
Montants à payer pour l'intérêt sur les swaps	3	0	0	3
Dépôts de contreparties	1 008	0	0	1 008
Frais de gestion à payer	23	0	0	23
<b>Total - Passif</b>	<b>14 345 USD</b>	<b>8 USD</b>	<b>11 USD</b>	<b>14 364 USD</b>

Passif courant au 31 décembre 2022	Moins de 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Total
Instruments financiers dérivés	2 857 USD	5 USD	0 USD	2 862 USD
Achats de placements à payer	426	0	0	426
Dépôts de contreparties	806	0	0	806
Montants à payer pour les parts rachetées	66	0	0	66
Frais de gestion à payer	78	0	0	78
<b>Total - Passif</b>	<b>4 233 USD</b>	<b>5 USD</b>	<b>0 USD</b>	<b>4 238 USD</b>

#### RISQUE DE CRÉDIT

Les tableaux ci-dessous résument la composition des notations des instruments financiers du Fonds.

	Au 31 décembre 2023	Au 31 décembre 2022
Catégorie investissement	100 %	97 %
Inférieur à la catégorie investissement	0 %	3 %
Sans notation	0 %	0 %
Total (% des placements et des instruments financiers dérivés)	100 %	100 %

Les notations sont fournies par Standard & Poor's Ratings Services (S&P), Moody's Investors Services, Inc. (Moody's), Fitch Ratings, Inc. (Fitch) ou DBRS Limited (DBRS). Lorsqu'il existe plus d'une notation pour un titre, la plus élevée a été retenue. Si la notation d'un instrument n'est pas fournie par l'une de ces agences, un titre reçoit une notation interne. Les notations inférieures à la catégorie investissement sont celles inférieures à Baa3 selon Moody's, à BAA- selon la notation interne, à BBB- selon S&P et Fitch, et à BBBL selon DBRS.

## 1. INFORMATIONS GÉNÉRALES

Chacun des Fonds (les « Fonds ») ci-dessous a été constitué en fiducie de fonds commun de placement en vertu des lois de la province d'Ontario et est régi par les dispositions d'une convention de fiducie.

	Début des activités
<b>Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO</b>	
Série A	20 janvier 2011
Série F	20 janvier 2011
Série I	20 janvier 2011
Série M	31 janvier 2012
Série O	20 janvier 2011
<b>Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)</b>	
Série A	20 janvier 2011
Série F	20 janvier 2011
Série I	20 janvier 2011
<b>Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)</b>	
Série A	30 septembre 2014
Série F	30 septembre 2014
Série I	30 septembre 2014
Série M	30 septembre 2014
Série O	30 septembre 2014
Série A (\$ US)	30 janvier 2015
Série F (\$ US)	30 janvier 2015
Série I (\$ US)	30 janvier 2015
Série M (\$ US)	30 janvier 2015
<b>Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada)</b>	
Série A (\$ US)	14 septembre 2015
Série F (\$ US)	14 septembre 2015
Série I (\$ US)	14 septembre 2015
Série M (\$ US)	14 septembre 2015
Série O (\$ US)	14 septembre 2015
Série A	14 septembre 2015
Série F	14 septembre 2015
Série I	14 septembre 2015
Série M	14 septembre 2015
Série O	14 septembre 2015
Série FNB	29 septembre 2017
<b>Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)</b>	
Série A	1 <sup>er</sup> février 2019
Série F	1 <sup>er</sup> février 2019
Série I	10 février 2020
Série FNB	1 <sup>er</sup> février 2019
Série A (\$ US)	31 juillet 2019
Série F (\$ US)	31 juillet 2019
<b>Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)</b>	
Série A (\$ US)	8 février 2019
Série F (\$ US)	8 février 2019
Série I (\$ US)	8 février 2019
Série M (\$ US)	8 février 2019
Série O (\$ US)	8 février 2019
Série A	8 février 2019

	Début des activités
Série F	8 février 2019
Série I	8 février 2019
Série M	8 février 2019
Série O	8 février 2019
Série FNB	8 février 2019
<b>Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence</b>	
Série A	14 février 2020
Série F	14 février 2020
Série FNB	14 février 2020
Série A (\$ US)	23 décembre 2020
Série F (\$ US)	23 décembre 2020
<b>Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base</b>	
Série A	14 février 2020
Série F	14 février 2020
Série FNB	14 février 2020
Série A (\$ US)	23 décembre 2020
Série F (\$ US)	23 décembre 2020
<b>Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)</b>	
Série A	26 février 2021
Série F	26 février 2021
Série I	26 février 2021
<b>Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)</b>	
Série A	26 février 2021
Série F	26 février 2021
Série I	26 février 2021
<b>Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)</b>	
Série A (\$ US)	27 août 2021
Série F (\$ US)	27 août 2021
Série I (\$ US)	27 août 2021
Série A	27 août 2021
Série F	27 août 2021
Série I	27 août 2021

Les états financiers des Fonds comprennent les états de la situation financière au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, s'il y a lieu, et les états du résultat global, les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et les tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022, sauf pour les Fonds lancés au cours de l'une de ces périodes, auquel cas les données sont fournies pour la période allant de la date de début des activités au 31 décembre 2023 ou au 31 décembre 2022, selon le cas.

PIMCO Canada Corp. (« PIMCO Canada ») est le gestionnaire de fonds de placement (le « gestionnaire ») et le conseiller en valeurs des Fonds, et le fiduciaire du Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada). Pacific Investment Management Company LLC (« PIMCO ») est le sous-conseiller des Fonds, et State Street Trust Company Canada est le fiduciaire des Fonds, à l'exception du Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada), et le dépositaire des Fonds. La publication de ces états financiers annuels a été autorisée par PIMCO Canada le 14 mars 2024.

Les parts de série A sont offertes à tous les investisseurs. Les parts de série F sont réservées aux investisseurs qui participent à un programme de comptes sur honoraires ou de compte intégré auprès de certains courtiers inscrits. Les parts de série I sont réservées aux investisseurs institutionnels admissibles et à d'autres investisseurs admissibles par l'intermédiaire de courtiers ayant signé

un accord avec PIMCO Canada, qui investissent au moins 10 M\$ dans un même Fonds. Les parts de série M sont réservées aux investisseurs qui investissent au moins 100 000 \$ dans un même Fonds et qui participent à un programme de comptes sur honoraires ou de compte intégré auprès de certains courtiers inscrits. Les parts de série O sont réservées aux particuliers qui investissent au moins 100 000 \$ dans un même Fonds. Les parts de série FNB du Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada), du Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada), Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada), du Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence et du Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base sont offertes aux investisseurs qui achètent ces parts sur la Bourse de Toronto (TSX) ou sur toute autre bourse ou tout autre marché par le biais de courtiers en FNB. Le Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada), le Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada), le Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada), le Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada), le Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence, le Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base et le Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada) offrent également une version en \$ US, couverte, de certaines séries susmentionnées, notamment les parts de série A (\$ US), de série F (\$ US), de série I (\$ US), de série M (\$ US) et de série O (\$ US), selon le cas.

Chaque Fonds est conçu pour mettre en commun et gérer les sommes reçues des investisseurs (les « porteurs de parts ») qui ont des objectifs de placement similaires. Les Fonds peuvent investir dans des titres de capitaux propres, des titres à revenu fixe, des instruments financiers dérivés, des fonds sous-jacents ou une combinaison de ceux-ci, selon leurs objectifs et stratégies de placement particuliers. Les placements peuvent être détenus dans le but de générer un revenu ou une plus-value, ou les deux. Les porteurs de parts se partagent les revenus, les charges et tout gain ou toute perte qu'un Fonds génère sur ses placements, et ce, en général proportionnellement à la valeur des titres du Fonds qu'ils détiennent.

## 2. MODE DE PRÉSENTATION

Les présents états financiers ont été préparés conformément aux Normes internationales d'information financière (IFRS) publiées par l'International Accounting Standard Board (normes IFRS de comptabilité) et selon le principe du coût historique, sauf en ce qui concerne la réévaluation des actifs et des passifs financiers (y compris les instruments financiers dérivés) à la juste valeur par le biais du résultat net (JVRN).

Dans l'inventaire du portefeuille, les titres étrangers (non canadiens) sont classés en fonction du pays de constitution de l'émetteur. Dans certains cas, le pays de constitution d'une société peut différer de celui de son exposition économique.

## 3. INFORMATIONS SIGNIFICATIVES SUR LES MÉTHODES COMPTABLES

Les méthodes comptables significatives et les techniques d'évaluation adoptées par le Fonds et appliquées lors de la préparation des états financiers sont résumées ci-après.

**a) Opérations sur titres et revenu de placement** Les opérations sur titres sont inscrites à la date de la transaction aux fins de la présentation de l'information financière. Le règlement des opérations sur titres achetés ou vendus avant l'émission ou avec livraison différée peut avoir lieu après le délai de règlement standard. Les gains (les pertes) réalisés et latents sont comptabilisés selon la méthode du coût moyen. Les revenus de dividendes sont inscrits à la date ex-dividende, sauf en ce qui concerne certains dividendes provenant de titres étrangers, pour lesquels cette date pourrait être passée; ces dividendes sont enregistrés dès qu'un Fonds connaît la date ex-dividende. Les intérêts à distribuer figurant à l'état du résultat global représentent les intérêts nominaux sur les instruments de créance comptabilisés selon la méthode de la comptabilité d'exercice (à l'exception des obligations ne portant pas intérêt, qui sont amorties). Les distributions de revenus et de gains en capital provenant des fonds sous-jacents sont comptabilisées à la date ex-distribution selon la méthode de la comptabilité d'exercice. Les distributions considérées comme un remboursement de capital à des fins fiscales à la fin de l'année d'imposition des Fonds, le cas échéant, sont comptabilisées à l'état de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables. Les distributions reçues des fonds

sous-jacents considérées comme étant un remboursement de capital, le cas échéant, seront comptabilisées à titre d'ajustement de la variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements dans les fonds sous-jacents de l'état du résultat global. Les distributions reçues du Fonds ou des fonds sous-jacents à titre de remboursement de capital sont comptabilisées comme une réduction du prix de base rajusté du placement pour le porteur de parts. Dans le cas des titres convertibles, les primes attribuables au droit de conversion ne sont pas amorties. Les passifs estimés au titre des retenues d'impôts sur certains titres étrangers sont comptabilisés en suivant la méthode de la comptabilité d'exercice et figurent dans les charges, à l'état du résultat global, selon le cas. Les gains (pertes) dus aux remboursements anticipés sur les titres adossés à des créances hypothécaires et à d'autres actifs, selon le cas, sont comptabilisés comme des éléments des intérêts à distribuer dans l'état du résultat global.

Un titre de créance peut être qualifié d'improductif et le revenu d'intérêts s'y rapportant peut s'en trouver réduit: les intérêts cessent de courir et les intérêts à recevoir sont radiés lorsque, sur la base de procédures appliquées de façon constante, le recouvrement d'une partie ou de la totalité des intérêts se rapportant à ce titre de créance devient douteux. Lorsqu'un émetteur reprend le versement des intérêts ou lorsque le recouvrement des intérêts redevient probable, le titre de créance n'est plus considéré comme improductif. Dans certains cas, un titre de créance peut faire l'objet d'une entente contractuelle ou non d'abstention de versement des intérêts à payer après les dates convenues.

**b) Coûts de transaction** Les coûts de transaction, comme les commissions de courtage découlant de l'achat et de la vente de titres par les Fonds, sont comptabilisés en charges dans l'état du résultat global. Les coûts de transaction sont des coûts différentiels directement imputables à l'acquisition, à l'émission ou à la cession d'un placement. Ils incluent les honoraires et les commissions versés aux agents, aux conseillers, aux courtiers et aux maisons de courtage de valeurs, les droits prélevés par les organismes de réglementation et les bourses de valeurs mobilières, ainsi que les droits et les taxes de transfert.

**c) Trésorerie et devises** La monnaie fonctionnelle et de présentation de tous les Fonds, à l'exception du Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada), du Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) et du Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada), est le dollar canadien. La monnaie fonctionnelle et de présentation du Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada), du Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) et du Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada) est le dollar américain. La juste valeur des titres étrangers, du portefeuille de devises et des autres actifs et passifs, selon le cas, est convertie dans la monnaie fonctionnelle et de présentation de chaque Fonds au taux de change en vigueur chaque jour ouvrable. Les fluctuations de la valeur du portefeuille de devises et des autres actifs et passifs provenant des variations des taux de change sont comptabilisées comme des gains (pertes) de change latents. Les gains (pertes) réalisés, les variations de la plus-value (moins-value) latente des placements et les revenus et les charges sont convertis aux dates respectives des transactions. Les répercussions de la fluctuation des taux de change sur les placements ne sont pas inscrites séparément des effets de la variation de la juste valeur de ces titres dans l'état du résultat global; elles sont plutôt incluses dans les gains (pertes) nets réalisés et les variations de la plus-value (moins-value) latente des placements.

**d) Variation de la plus-value et de la moins-value latente des placements** La variation de la plus-value (moins-value) latente des placements correspond à la différence entre leur coût moyen et leur juste valeur entre les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

**e) Augmentation ou diminution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part** L'augmentation ou la diminution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, figurant dans l'état du résultat global correspond à l'augmentation ou à la diminution nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables de chaque série pour la période, divisée par le nombre moyen pondéré de parts en circulation de chaque série pendant la période.

**f) Distributions aux porteurs de parts rachetables** Les revenus nets de placement imposables sont attribués et distribués trimestriellement, sauf ceux

du Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada), du Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada), du Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) et du Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada), qui sont attribués et distribués mensuellement pour les parts de série FNB, selon le cas, et attribués quotidiennement et distribués mensuellement pour les autres séries de parts. Les gains en capital nets réalisés, le cas échéant, sont distribués annuellement aux porteurs de parts rachetables. Les Fonds peuvent aussi faire l'objet d'autres distributions si le gestionnaire le décide.

Aucune charge d'impôt canadien n'est constatée dans les états financiers, car les revenus nets et les gains en capital nets sont distribués aux porteurs de parts rachetables. Toutes les distributions effectuées par les Fonds sont réinvesties dans des parts supplémentaires des Fonds ou dans des fractions de parts des Fonds, à la valeur liquidative par part, sauf si le porteur de parts souhaite recevoir ses distributions en trésorerie.

**g) Répartition des revenus et des charges** Chaque série d'un Fonds comporte des droits égaux à ceux des autres séries du Fonds sur l'actif de ce Fonds. Les revenus, les charges non spécifiques à une série et les gains (pertes) en capital réalisés et latents non spécifiques à une série sont répartis entre les séries de parts selon la valeur liquidative relative de chaque série de chaque Fonds, à l'exception des gains et pertes relatifs aux opérations de couverture de change attribuables spécifiquement à une série.

**h) Estimations comptables et jugements critiques** Les revenus de placement des Fonds, sauf ceux du Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada), du Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) et du Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada) (les « Fonds en dollars américains »), génèrent des rendements en dollars canadiens, en dollars américains et, dans une moindre mesure, dans d'autres devises selon les placements détenus. Les charges engagées par les Fonds sont principalement en dollars canadiens. Puisque les rendements des Fonds ne sont pas uniquement en dollars canadiens, les principaux indicateurs de la monnaie fonctionnelle sont considérés comme mixtes et des indicateurs secondaires sont examinés. Les souscriptions et les rachats de parts rachetables des Fonds sont en dollars canadiens et le rendement est évalué et présenté aux porteurs de parts rachetables en dollars canadiens. Le gestionnaire considère que le dollar canadien est la monnaie qui représente le plus fidèlement les effets économiques des transactions, des conditions et des événements sous-jacents pour tous les Fonds, sauf les Fonds en dollars américains. Les états financiers de tous les Fonds, à l'exception des Fonds en dollars américains, sont donc présentés en dollars canadiens, leur monnaie fonctionnelle et de présentation.

Les revenus de placement du Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada), du Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) et du Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada) génèrent des rendements en dollars américains, en dollars canadiens et, dans une moindre mesure, dans d'autres devises selon les placements détenus. Les charges engagées par les Fonds en dollars américains sont principalement en dollars américains. Puisque les rendements des Fonds en dollars américains ne sont pas uniquement en dollars américains, les principaux indicateurs de la monnaie fonctionnelle sont considérés comme mixtes et des indicateurs secondaires sont examinés. Les souscriptions et les rachats de parts rachetables des Fonds sont en dollars canadiens et en dollars américains, cependant le rendement est évalué et présenté aux porteurs de parts rachetables en dollars américains. Le gestionnaire considère que le dollar américain est la monnaie qui représente le plus fidèlement les effets économiques des transactions, des conditions et des événements sous-jacents liés au Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada), au Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) et au Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada). Par conséquent, les états financiers du Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada), du Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) et du Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada) sont présentés en dollars américains, la monnaie fonctionnelle et de présentation de ces Fonds.

**i) Classement des actifs et des passifs financiers** Pour classer et évaluer les instruments financiers détenus par les Fonds, le gestionnaire est tenu de poser des jugements importants afin d'en déterminer le classement approprié,

conformément à la norme IFRS 9 *Instruments financiers*. Au moment de poser ce jugement, le gestionnaire a évalué le modèle économique adopté par les Fonds pour gérer le portefeuille ainsi que les caractéristiques des flux de trésorerie contractuels, et a déterminé que les placements sont gérés sur la base de leur juste valeur, et cette juste valeur est utilisée pour évaluer le rendement et prendre des décisions d'investissement. Les flux de trésorerie contractuels des titres de créance et des instruments des Fonds sont uniquement composés du capital et des intérêts, mais ces titres ne sont pas détenus aux fins de perception des flux de trésorerie contractuels ni pour la perception des flux de trésorerie contractuels et la vente. La perception des flux de trésorerie contractuels n'est qu'accessoire à l'atteinte des objectifs du modèle économique des Fonds. Par conséquent, tous les placements et les instruments financiers dérivés sont évalués à la juste valeur par le biais du résultat net. Le gestionnaire a donc déterminé que la JVRN, conformément à la norme IFRS 9, représente l'évaluation et la présentation des investissements des Fonds les plus appropriées.

**j) Rapprochement de la valeur liquidative par part et de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part** Les méthodes comptables pour l'évaluation de la juste valeur des placements et des instruments financiers dérivés des Fonds sont sensiblement similaires à celles utilisées pour évaluer la valeur liquidative des transactions avec les porteurs de parts. La valeur liquidative aux fins de traitement des transactions des porteurs de parts est la valeur de l'ensemble des actifs d'un Fonds moins la valeur de l'ensemble de ses passifs, déterminées chaque jour d'évaluation conformément à la partie 14 du *Règlement 81-106 sur l'information continue des fonds d'investissement*. L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables désigne l'actif net calculé conformément aux IFRS de comptabilité. À toutes les dates présentées, il n'y avait aucun écart significatif entre la valeur liquidative des Fonds, par part, et l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part.

**k) Compensation des instruments financiers** Les actifs et passifs financiers sont compensés et le montant net est inscrit à l'état de la situation financière lorsqu'il existe un droit juridiquement exécutoire de compensation des montants comptabilisés et qu'il y a une intention de procéder à un règlement net ou de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément. L'information concernant la compensation, le cas échéant, figure dans les notes annexes propres au Fonds.

**l) Changements concernant les informations à fournir sur les méthodes comptables** Avec prise d'effet le 1<sup>er</sup> janvier 2023, le Fonds a adopté les normes comptables nouvelles et modifiées suivantes : Informations à fournir sur les méthodes comptables — Modifications d'IAS 1 et de l'énoncé de pratiques en IFRS 2. Les Fonds ont adopté les modifications d'IAS 1 concernant la communication des méthodes comptables significatives le 1<sup>er</sup> janvier 2023. Ce changement n'a pas eu d'incidence significative sur les présents états financiers. Aucune autre norme, modification de norme ou interprétation n'a eu d'effet important sur les états financiers des Fonds.

## 4. ÉVALUATION DES PLACEMENTS ET DE LA JUSTE VALEUR

**a) Méthode d'évaluation des placements** La valorisation d'une série de parts d'un Fonds est fondée sur la valeur liquidative de la série. La valeur liquidative par part d'une série est déterminée en divisant la valeur totale du portefeuille de placements et des autres actifs, déduction faite de tout passif attribuable à la série, par le nombre total de parts de la série en circulation.

Chaque jour où la TSX est ouverte, les parts d'un Fonds sont généralement évaluées à la clôture de la séance de bourse ordinaire (la « clôture de la TSX »). Les informations qui deviennent accessibles aux Fonds ou à leurs placeurs pour compte après le calcul de la valeur liquidative un jour donné ne sont habituellement pas utilisées de manière rétrospective pour ajuster le prix d'un titre ou la valeur liquidative déterminée plus tôt le même jour.

Aux fins du calcul de la valeur liquidative, les titres en portefeuille et les autres éléments d'actif pour lesquels les cours boursiers sont facilement accessibles sont évalués à la juste valeur. Un cours boursier est facilement accessible seulement lorsque ce cours est un cours (non ajusté) sur un marché actif pour un placement identique que le Fonds peut obtenir à la date d'évaluation. Un cours n'est pas facilement accessible s'il n'est pas fiable. La juste valeur est

habituellement calculée au moyen du cours de clôture officiel ou du dernier prix de vente enregistré. Les Fonds utiliseront habituellement des données sur les prix pour les titres de participation du marché intérieur reçues peu de temps après la clôture de la TSX et qui ne tiennent généralement pas compte des opérations, compensations et règlements qui ont eu lieu après la clôture de la TSX. Les placements pour lesquels les cours boursiers ne sont pas disponibles sont évalués à la juste valeur sur la déclaration de bonne foi du gestionnaire ou de personnes agissant selon ses directives. De manière générale, la juste valeur d'un titre ou d'un autre actif est le montant que le Fonds recevrait à la vente d'un actif ou qu'il paierait pour transférer un passif dans le cadre d'une transaction normale entre participants du marché à la date d'évaluation. Le gestionnaire a prévu des méthodes d'évaluation des titres et des autres éléments d'actif dans les cas où les cours boursiers ne sont pas facilement accessibles. La responsabilité d'appliquer les méthodes d'évaluation de la juste valeur lui incombe. Le gestionnaire peut évaluer les titres du portefeuille du Fonds pour lesquels des cours boursiers ne sont pas facilement accessibles et d'autres actifs du Fonds en utilisant des données d'entrée provenant de services d'évaluation des cours, de systèmes de publication des cours, d'agents d'évaluation et d'autres sources tierces (ensemble, les « sources d'évaluation des cours »). Un titre de participation étranger (non canadien) négocié sur une bourse étrangère ou sur plus d'une bourse est généralement évalué à partir de données sur les prix de la bourse principale, selon le gestionnaire. Si le juste prix de marché est utilisé, un titre de participation étranger (non canadien) sera évalué à la clôture de la séance de la bourse étrangère, ou à la clôture de la TSX, si la clôture de la TSX a lieu avant la clôture des marchés de la bourse étrangère. Les Fonds utilisent le dernier cours pour les actifs et passifs financiers lorsque ce cours s'inscrit dans l'écart acheteur-vendeur du jour. Lorsque le dernier cours ne s'inscrit pas dans l'écart acheteur-vendeur, le gestionnaire détermine le prix qui est le plus représentatif de la juste valeur compte tenu des faits et circonstances en cause. Les titres à revenu fixe nationaux et étrangers (non canadiens), les dérivés négociés hors bourse et les options sur actions sont généralement évalués selon les cours obtenues de la part de courtiers et de maisons de courtage de valeurs ou de sources d'évaluation des cours établies à partir de données reflétant celles des principaux marchés pour ces titres. Les prix obtenus de sources d'évaluation des cours peuvent se fonder, entre autres, sur des renseignements fournis par les teneurs de marchés ou par des estimations des justes valeurs obtenues à partir de données de rendement associées aux placements ou aux titres ayant des caractéristiques similaires. Certains titres à revenu fixe, achetés sur la base d'une livraison différée, sont inscrits au marché quotidiennement jusqu'à la date du règlement différé. Les options négociables en bourse, sauf les options sur actions, les contrats à terme et les options sur contrats à terme, sont évaluées au cours de compensation établi par la bourse concernée ou les cours obtenus de systèmes de publication des cours, de teneurs de marchés ou de sources d'évaluation des cours. Les swaps sont évalués sur la base des prix de marché générés par des sources d'évaluation des cours ou de cours fournis par des courtiers et des maisons de courtage de valeurs. Les placements d'un Fonds dans des sociétés de gestion de placement à capital variable, autres que les fonds négociables en bourse (FNB), sont évalués selon leur valeur liquidative.

Si la valeur d'un titre de participation étranger (non canadien) a changé significativement après la clôture de la bourse principale ou du marché principal du titre, mais avant la clôture de la TSX, le titre peut être évalué à sa juste valeur selon les procédures établies et approuvées par le comité d'évaluation de PIMCO ou des personnes agissant selon ses directives. Les titres de participation étrangers (non canadiens) qui ne sont pas négociés lorsque la TSX est ouverte sont également évalués selon leur juste valeur. En ce qui concerne les titres de participation étrangers (non canadiens), le Fonds peut déterminer la juste valeur des placements selon les renseignements fournis par des sources d'évaluation des cours, qui pourraient recommander la juste valeur ou un ajustement relatif à d'autres titres, indices ou actifs. Lorsqu'il détermine si une juste évaluation est nécessaire et lorsqu'il détermine les justes valeurs, le Fonds peut, entre autres, tenir compte d'événements significatifs (qui pourraient inclure des changements de la valeur de titres canadiens ou d'indices de titres) ayant eu lieu après la clôture du marché concerné et avant la clôture de la TSX. Un Fonds peut utiliser des outils de modélisation provenant de fournisseurs tiers afin de déterminer les justes valeurs de titres

non canadiens. Des bourses étrangères pourraient permettre la négociation de titres de participation étrangers (non canadiens) les jours non ouvrables pour les Fonds, ce qui pourrait affecter les placements des portefeuilles des Fonds alors que les porteurs de parts ne pourront acheter ni vendre des parts.

Les prêts de premier rang garantis à taux variable pour lesquels il existe un marché secondaire actif assez fiable seront évalués selon la moyenne des derniers prix acheteur/vendeur disponibles sur le marché pour de tels prêts, fournis par une source d'évaluation des cours. Les prêts de premier rang garantis à taux variable pour lesquels il n'existe aucun marché secondaire actif assez fiable seront évalués à la juste valeur. Lors de l'évaluation d'un prêt de premier rang garanti à la juste valeur, les facteurs considérés peuvent inclure, sans s'y limiter, les éléments suivants : a) la solvabilité de l'emprunteur et de tout participant intermédiaire; b) les modalités du prêt; c) les prix récents sur le marché pour des prêts similaires, le cas échéant; et d) les prix récents sur le marché pour des instruments ayant une qualité, un taux, un délai avant la prochaine réinitialisation du taux d'intérêt et une échéance similaires.

Les placements évalués dans une monnaie autre que la monnaie fonctionnelle d'un Fonds sont convertis dans la monnaie fonctionnelle à l'aide des taux de change fournis par des sources d'évaluation des cours. Il en résulte que la valeur de tels placements et, par conséquent, la valeur liquidative des parts des Fonds pourraient être influencées par la fluctuation du cours des devises par rapport à la monnaie fonctionnelle. La valeur des placements négociés sur les marchés étrangers ou libellés dans des devises autres que la monnaie fonctionnelle pourrait être significativement touchée lors d'un jour non ouvrable pour les Fonds. Par conséquent, dans la mesure où un Fonds détient des placements étrangers (non canadiens), la valeur de ces placements pourrait varier à des moments où les porteurs de parts ne peuvent acheter ni vendre des parts et la valeur de tels placements ne sera comptabilisée qu'au prochain calcul de la valeur liquidative des Fonds.

L'évaluation de la juste valeur peut exiger la détermination subjective de la valeur d'un titre. Bien que la politique des Fonds ait été conçue pour permettre de calculer une valeur liquidative qui reflète de façon juste la valeur des titres au moment de l'évaluation du cours, les Fonds ne peuvent pas assurer que la juste valeur déterminée par le gestionnaire ou les personnes agissant selon ses directives pourra refléter avec exactitude le cours que les Fonds pourraient obtenir pour un titre s'ils devaient le céder au moment de l'évaluation dudit cours (par exemple, en cas de vente forcée ou de liquidation). Les prix utilisés par un Fonds peuvent différer de la valeur qui serait réalisée si les titres étaient vendus.

**b) Hiérarchie des justes valeurs** Les IFRS de comptabilité décrivent la juste valeur comme étant le montant qu'un Fonds recevrait à la vente d'un actif ou qu'il paierait pour transférer un passif dans le cadre d'une transaction normale entre participants du marché à la date d'évaluation. Les IFRS de comptabilité prescrivent une hiérarchie des justes valeurs qui établit un ordre de priorité des données d'entrée utilisées dans les méthodes d'évaluation, exige la présentation de cette hiérarchie séparément pour chaque catégorie importante d'actif et de passif, et classe les évaluations de la juste valeur sur plusieurs niveaux (niveaux 1, 2 ou 3). Les données d'entrée ou la méthode utilisées pour évaluer les titres ne sont pas nécessairement une indication des risques inhérents à un placement dans ces titres. Les niveaux 1, 2 et 3 de la hiérarchie des justes valeurs se définissent comme suit :

- Niveau 1 — Cours (non ajustés) des marchés actifs ou en devises étrangères pour des actifs ou passifs identiques.
- Niveau 2 — Autres données d'entrée observables importantes pouvant inclure, mais sans s'y limiter, les cours pour des actifs ou des passifs similaires sur des marchés actifs, les cours pour des actifs ou des passifs identiques ou similaires sur des marchés inactifs, des données d'entrée autres que les cours qui sont observables pour des actifs ou des passifs (par exemple, les taux d'intérêt, les courbes des taux, la volatilité, la rapidité des remboursements anticipés, la sévérité des pertes, les risques de crédit et les taux de défaillance) ou d'autres données d'entrée corroborées par le marché.

- Niveau 3 — Données d'entrée non observables importantes fondées sur les meilleures informations disponibles dans ces circonstances, dans la mesure où des données observables ne sont pas disponibles, ce qui peut inclure des hypothèses du gestionnaire ou d'autres personnes agissant sous sa direction, qui servent à déterminer la juste valeur des placements.

Les actifs et les passifs classés au niveau 2 ou 3 à la clôture de la période ont été transférés entre les niveaux 2 et 3 depuis la période précédente en raison de changements dans la méthode utilisée pour évaluer les placements. Un transfert du niveau 2 au niveau 3 s'explique par l'adoption, dans le cours normal des activités, de méthodes qui consistent à utiliser un prix établi par les courtiers, par une technique d'évaluation ou par la restructuration d'actifs employant des données d'entrée non observables importantes en raison de l'absence de données de marché courantes ou fiables (niveau 3) en remplacement de méthodes d'évaluation qui consistent à utiliser des sources d'évaluation des cours (niveau 2). Les transferts du niveau 3 au niveau 2 sont attribuables à la disponibilité de données de marché courantes et fiables, grâce à des sources d'évaluation des cours ou à des techniques d'évaluation employant des données d'entrée observables importantes. Conformément aux exigences des IFRS de comptabilité, les montants des transferts entre les niveaux 1 et 2 et des transferts vers et depuis le niveau 3, s'ils sont significatifs, sont présentés dans les notes annexes propres à chaque Fonds.

Pour toute évaluation de la juste valeur utilisant des données d'entrée non observables importantes, les IFRS de comptabilité exigent un rapprochement des soldes d'ouverture et de clôture, expliquant les changements attribuables aux gains (pertes) réalisés, à la plus-value (moins-value) latente, aux achats et ventes, aux escomptes (primes) accumulés et aux transferts vers et depuis le niveau 3 pendant la période. Les transferts d'actifs et de passifs d'un Fonds entre les niveaux sont évalués à la clôture de la période. En outre, les IFRS de comptabilité exigent la présentation d'informations quantitatives relatives aux données d'entrée non observables importantes utilisées pour déterminer la juste valeur des actifs ou des passifs classés au niveau 3 de la hiérarchie des justes valeurs. Conformément aux exigences des IFRS de comptabilité, une hiérarchie des justes valeurs, un rapprochement du niveau 3 et les détails des données d'entrée non observables importantes, le cas échéant, ont été inclus dans les notes annexes propres à chaque Fonds.

**c) Techniques d'évaluation et hiérarchie des justes valeurs Actifs et passifs de niveaux 1, 2 et 3 détenus à des fins de transactions, à la juste valeur** Les techniques d'évaluation (les « techniques ») et les données d'entrée importantes utilisées pour déterminer la juste valeur des titres en portefeuille et des autres actifs et passifs classés aux niveaux 1, 2 et 3 de la hiérarchie des justes valeurs sont les suivantes :

Les titres à revenu fixe, y compris les obligations de sociétés, les obligations municipales et les obligations convertibles, les titres émis par des organismes publics des États-Unis ou du Canada, les obligations du Trésor des États-Unis et du Canada, les titres souverains, les prêts bancaires, les titres privilégiés convertibles, les obligations autres que canadiennes et les instruments de créance à court terme (comme les billets de trésorerie, les dépôts à terme et les certificats de dépôt) sont normalement évalués selon les cours obtenus auprès de courtiers et de maisons de courtage de valeurs ou de sources d'évaluation des cours qui utilisent les cours obtenus auprès de courtiers en valeurs mobilières, les cours enregistrés ou les estimations de leurs systèmes internes d'évaluation. Les modèles internes des sources d'évaluation des cours utilisent des données d'entrée observables comme les renseignements détaillés sur l'émetteur, les taux d'intérêt, les courbes des taux, la rapidité des remboursements anticipés, les risques ou les écarts de taux, les taux de défaillance et les cours pour des actifs similaires. Les titres pour lesquels sont utilisées des techniques d'évaluation et des données d'entrée similaires à celles indiquées ci-dessus sont classés au niveau 2 de la hiérarchie des justes valeurs.

Les titres à revenu fixe achetés avec livraison différée ou en vertu d'un accord cadre sur transactions à livrer sont évalués quotidiennement à la valeur de marché jusqu'au règlement et sont classés au niveau 2 de la hiérarchie des justes valeurs.

Les titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs sont habituellement émis en tranches ou en catégories distinctes en fonction de chaque contrat. Ces titres sont aussi généralement évalués par des sources d'évaluation des cours utilisant les cours fournis par des maisons de courtage de valeurs, les cours enregistrés ou les évaluations de leurs systèmes internes d'évaluation des cours. Les modèles d'évaluation des cours de ces titres prennent habituellement en compte les attributs de chaque tranche, les plus récentes informations boursières, les flux de trésorerie estimés et les écarts de rendement du marché pour chaque tranche, et intègrent également la performance de la garantie au contrat, selon le cas. Les titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs pour lesquels sont utilisées des techniques d'évaluation et des données d'entrée similaires à celles indiquées ci-dessus sont classés au niveau 2 de la hiérarchie des justes valeurs.

Les actions ordinaires, les FNB, les billets négociés en bourse ainsi que les instruments financiers dérivés, comme les contrats à terme, les droits et bons de souscription ou les options sur contrats à terme cotés sur une bourse nationale, sont inscrits au cours de la dernière opération ou du dernier règlement à la date d'évaluation. Dans la mesure où ces titres sont négociés activement et qu'aucun ajustement de valeur n'est effectué, ils sont classés au niveau 1 de la hiérarchie des justes valeurs.

Des ajustements de valeur peuvent être effectués sur certains titres qui ne se négocient que sur des bourses étrangères pour prendre en compte les fluctuations boursières survenues entre la clôture de la bourse étrangère et celle de la TSX. Ces titres sont évalués par les sources d'évaluation des cours qui prennent en compte la corrélation des tendances boursières du titre étranger par rapport aux échanges intrajournaliers des marchés boursiers canadiens. Les titres utilisant ces ajustements de valeur sont classés au niveau 2 de la hiérarchie des justes valeurs. Les actions privilégiées négociées sur des marchés inactifs ou évaluées par rapport à des instruments financiers similaires sont aussi classées au niveau 2 de la hiérarchie des justes valeurs.

Des ajustements de valeur peuvent être effectués sur certains contrats à terme et options cotés pour prendre en compte les fluctuations boursières survenues entre le règlement sur le marché concerné et la clôture de la TSX. Ces titres sont évalués selon les cours obtenus de systèmes de publication des cours, de teneurs de marchés ou de sources d'évaluation des cours. Les instruments financiers dérivés utilisant les ajustements de valeur sont classés au niveau 2 de la hiérarchie des justes valeurs.

Les placements dans des sociétés de placement à capital variable enregistrées (autre que les FNB) sont évalués à leur valeur liquidative et classés au niveau 1 de la hiérarchie des justes valeurs. Les placements dans des sociétés de placement à capital variable non enregistrées sont évalués à leur valeur liquidative et sont considérés de niveau 1, à condition que la valeur liquidative soit observable, calculée quotidiennement et soit la valeur à laquelle les achats et les ventes sont effectués. Les placements dans des fonds de placement privés qui sont soumis à des restrictions importantes en matière de rachat et dont la valeur liquidative est déterminée à l'aide de données d'entrée observables sont évalués à leur valeur liquidative et classés au niveau 2 de la hiérarchie des justes valeurs.

Les options sur actions cotées et les instruments financiers dérivés hors cote, comme les contrats de change à terme et les options, sont évalués en fonction de la valeur de l'actif sous-jacent, les indices, les taux de référence et d'autres données d'entrée, ou sur une combinaison de ces facteurs. Ces contrats sont généralement évalués selon les cours obtenus de systèmes de publication des cours, de teneurs de marchés reconnus ou de sources d'évaluation des cours (généralement à la clôture de la TSX). Selon le produit et les conditions de la transaction, la valeur des instruments financiers dérivés peut être déterminée par une source d'évaluation des cours au moyen d'une série de techniques, dont les modèles de simulation des cours. Ces modèles utilisent des données d'entrée observées sur des marchés actifs, telles que les cours, les renseignements détaillés sur les émetteurs, les indices, les écarts acheteur-vendeur, les taux d'intérêt, les volatilités implicites, les courbes de taux, les dividendes et les taux de change. Les instruments financiers dérivés auxquels sont appliquées des techniques d'évaluation et des données d'entrée de ce type sont classés au niveau 2 de la hiérarchie des justes valeurs.

Les swaps faisant l'objet d'une compensation centralisée et les swaps hors cote sont évalués en se fondant sur la valeur de l'actif sous-jacent, les indices, les taux de référence et d'autres données d'entrée, ou sur une combinaison de ces facteurs. Ils sont évalués selon le cours acheteur obtenu de maisons de courtage de valeurs ou selon des prix de marché fournis par des sources d'évaluation des cours ou d'autres sources (généralement à la clôture de la TSX). Les swaps faisant l'objet d'une compensation centralisée et les swaps hors cote peuvent être évalués par des sources d'évaluation des cours au moyen d'une série de techniques, dont des modèles de simulation des cours. Ces modèles peuvent utiliser des données d'entrée observées sur des marchés actifs, comme le taux des swaps indexés sur le taux à un jour (« OIS »), le taux à terme du taux interbancaire offert à Londres (« LIBOR »), les taux d'intérêt, les courbes de taux et les écarts de taux. Ces titres sont classés au niveau 2 de la hiérarchie des justes valeurs.

Lorsque les méthodes d'évaluation de la juste valeur utilisées par PIMCO ont recours à des données d'entrée non observables importantes, les placements sont évalués au moyen d'une méthode qui, selon le gestionnaire ou les personnes agissant selon ses directives, reflète avec exactitude la juste valeur et ils sont classés au niveau 3 de la hiérarchie des justes valeurs.

Le processus d'évaluation des cours de référence consiste à déterminer le prix de base d'un titre à revenu fixe et à l'ajuster ensuite au prorata en fonction des fluctuations de la juste valeur d'un titre prédéterminé jugé comparable, généralement un bon du Trésor américain ou un titre de créance souverain choisi en fonction du pays émetteur. Le prix de base peut être un cours obtenu de maisons de courtage de valeurs, un prix de transaction ou une valeur dérivée d'une analyse interne des données de marché. Le prix de base du titre peut être rajusté périodiquement en fonction des données de marché disponibles et des processus approuvés par le comité de surveillance de l'évaluation. Toute modification importante des données d'entrée non observables utilisées dans le cadre du processus d'évaluation des cours par comparaison (du prix de base) a un effet direct et proportionnel sur la juste valeur du titre. Ces titres sont classés au niveau 3 de la hiérarchie des justes valeurs.

Le modèle de flux de trésorerie actualisés est fondé sur les flux de trésorerie futurs générés par le placement et peut être normalisé en fonction du rendement escompté du placement. Les flux de trésorerie futurs sont actualisés à l'aide d'un taux de rendement approprié, généralement étalonné en fonction de la date de transaction initiale et ajusté en fonction du modèle d'évaluation des actifs financiers et/ou d'autres facteurs de marché. Des changements importants aux données d'entrée non observables utilisées dans un modèle pourraient donner lieu à une modification directe et proportionnelle de la juste valeur d'un titre. Ces titres sont classés au niveau 3 de la hiérarchie des justes valeurs.

Le modèle d'évaluation du prix des options est une méthode largement utilisée pour déterminer la valeur d'une entreprise en fonction de la structure de son capital. Cette méthode peut être utilisée lorsque la structure du capital comprend de nombreux instruments donnant des droits et des privilèges différents, lorsqu'il n'y a pas d'horizon de sortie à court terme ou que la nature de l'opération de sortie n'est pas connue ou encore lorsque la valeur de l'entreprise est insuffisante pour couvrir l'encours de sa dette et les créances de premier rang. Le modèle d'évaluation du prix des options peut aussi servir à estimer la valeur d'une entreprise par inférence si des transactions représentatives sur des titres du même émetteur ont été récemment conclues. Le modèle d'évaluation du prix des options utilise le modèle de Black et Scholes, modèle généralement reconnu pour l'évaluation des options d'achat et de vente, des bons de souscription et des titres privilégiés convertibles. Des changements importants des données d'entrée non observables utilisées dans un modèle pourraient donner lieu à une modification directe de la juste valeur d'un titre. Ces titres sont classés au niveau 3 de la hiérarchie des justes valeurs.

Le modèle des sociétés comparables est fondé sur l'application de multiples de valorisation de sociétés comparables cotées en bourse aux données financières de la société en question. Des ajustements peuvent être apportés aux multiples de valorisation dérivés du marché en fonction des divergences entre les sociétés comparables et la société en question. Des changements importants aux données d'entrée non observables utilisées dans un modèle pourraient donner

lieu à une modification directe et proportionnelle de la juste valeur d'un titre. Ces titres sont classés au niveau 3 de la hiérarchie des justes valeurs.

Les instruments de créance à court terme (comme les billets de trésorerie, les dépôts à terme et les certificats de dépôt) ayant une échéance de 60 jours ou moins peuvent être évalués au coût amorti, dans la mesure où la valeur au coût amorti de tels instruments de créance à court terme est environ la même que la juste valeur de l'instrument, telle qu'elle est déterminée sans l'utilisation de l'évaluation au coût amorti. Ces titres sont classés au niveau 2 et au niveau 3 de la hiérarchie des justes valeurs, selon la source du prix de base.

## 5. TITRES ET AUTRES PLACEMENTS

### a) Placements dans des titres

**Obligations indexées sur l'inflation** Certains Fonds peuvent investir dans des obligations indexées sur l'inflation. Les obligations indexées sur l'inflation sont des titres à revenu fixe dont la valeur du capital est périodiquement ajustée au taux d'inflation. Le taux d'intérêt de ces obligations est généralement fixé à l'émission à un taux inférieur à celui des obligations ordinaires. Cependant, pendant la durée de vie d'une obligation indexée sur l'inflation, les intérêts seront versés en fonction de la valeur du capital, qui est ajustée pour tenir compte de l'inflation. Toute augmentation ou diminution du capital d'une obligation indexée sur l'inflation est comptabilisée à titre d'intérêts à distribuer dans l'état du résultat global, même si les investisseurs ne touchent pas leur capital avant l'échéance. Le remboursement du capital initial de l'obligation arrivée à échéance (après rajustement en fonction de l'inflation) est garanti pour certaines obligations indexées sur l'inflation. Pour les obligations ne possédant pas de garantie similaire, la valeur rajustée du capital de l'obligation remboursée à échéance pourrait être inférieure au capital initial.

**Prêts avec participation, cession et origination** Certains Fonds peuvent investir dans des instruments de créance directs, qui sont des participations dans des montants dus par des sociétés, des entités publiques ou d'autres emprunteurs à des prêteurs ou à des syndicats de prêteurs. Les placements d'un Fonds dans ce type de créances peuvent prendre la forme de participations dans des prêts, de cessions partielles ou totales de prêts de la part de tiers, de placements dans des prêts ou d'originations de prêts par un Fonds ou des Fonds. Un prêt est souvent géré par une banque ou une institution financière (le « prêteur ») qui agit en tant que mandataire de tous les porteurs. Le mandataire administre les conditions du crédit en vertu du contrat de prêt. Un Fonds peut investir dans plusieurs séries ou tranches d'un prêt, qui peuvent avoir différentes échéances et comprendre des risques variés. Lorsqu'un Fonds achète des cessions à des prêteurs, il acquiert les droits directs à l'égard de l'emprunteur. Ces prêts peuvent inclure des participations dans des prêts-relais, c'est-à-dire des prêts que les emprunteurs contractent pour une courte durée (généralement moins d'un an), le temps de mettre en place un financement de plus longue durée, qui peut prendre la forme, par exemple, d'une émission d'obligations, souvent d'obligations à haut rendement émises aux fins des acquisitions.

Les types de prêts et les placements liés dans lesquels les Fonds peuvent investir comprennent, entre autres, des prêts de premier rang, des prêts subordonnés (y compris des prêts de deuxième rang, des billets de catégorie B et des prêts mezzanines), des prêts entiers, des prêts immobiliers commerciaux et d'autres prêts commerciaux, ainsi que des prêts structurés. Les Fonds peuvent octroyer des prêts ou acquérir des intérêts directs dans des prêts dans le cadre de placements initiaux de prêts ou d'opérations privées. Dans le cas de prêts subordonnés, il peut y avoir bien des dettes de rang supérieur à acquitter avant l'obligation de l'emprunteur envers le porteur de ce genre de prêt, notamment en cas d'insolvabilité de l'emprunteur. Les prêts mezzanines sont généralement garantis par une part des capitaux propres de l'emprunteur qui est propriétaire du bien immobilier plutôt que par une participation dans un prêt hypothécaire.

Les placements dans ce type de créances peuvent inclure des engagements de prêts non financés, qui sont des obligations contractuelles de financement futur. Les engagements de prêts non financés peuvent inclure des facilités de

crédit renouvelables, qui pourraient obliger un Fonds à fournir des liquidités supplémentaires sur demande de l'emprunteur. Les engagements de prêts non financés représentent une pleine obligation future, même si un pourcentage des montants engagés pourrait ne pas être utilisé par l'emprunteur. Lorsqu'il investit dans des participations dans des prêts, un Fonds a le droit de recevoir des remboursements de capital, des intérêts et les commissions dont il peut se prévaloir, mais uniquement du prêteur qui cède le prêt et seulement lorsque celui-ci a reçu les paiements de l'emprunteur. Un Fonds peut recevoir une commission d'engagement calculée sur la tranche non encore utilisée de la portion de marge de crédit sous-jacente d'un prêt. Dans certains cas, un Fonds peut recevoir de l'emprunteur des frais de pénalité pour remboursement anticipé d'un prêt. Les frais touchés ou payés sont respectivement comptabilisés dans les intérêts à distribuer ou les charges d'intérêts à l'état du résultat global. Les engagements de prêts non financés sont présentés comme un passif dans l'état de la situation financière.

### Titres adossés à des créances hypothécaires et à d'autres actifs

Certains Fonds peuvent investir dans des titres adossés à des créances hypothécaires et à d'autres actifs qui, directement ou indirectement, représentent une participation dans des hypothèques immobilières, ou sont garantis par de telles hypothèques. Les titres adossés à des créances hypothécaires sont créés à partir de portefeuilles de prêts hypothécaires résidentiels ou commerciaux, notamment de prêts hypothécaires accordés par des organismes d'épargne et de crédit, des banques de crédit hypothécaire, des banques commerciales et d'autres institutions. Ces titres rapportent un paiement mensuel constitué à la fois des intérêts et du capital. Les intérêts peuvent être déterminés selon des taux fixes ou ajustables. Le taux des remboursements anticipés des prêts hypothécaires sous-jacents a une incidence sur le prix et la volatilité du titre adossé à des créances hypothécaires, et peut avoir pour conséquence la réduction ou la prolongation de la durée réelle du titre par rapport à ce qui était prévu au moment de son achat. Le remboursement en temps opportun du capital et des intérêts de certains titres adossés à des créances hypothécaires est garanti par la réputation de solvabilité du gouvernement des États-Unis. Les portefeuilles créés et garantis par des émetteurs non gouvernementaux, notamment des sociétés d'État, peuvent être dotés de diverses formes d'assurance et de garanties, mais rien ne garantit que les assureurs privés ou les garants honoreront les obligations de leurs polices d'assurance ou d'autres clauses de garantie. Les risques liés aux placements dans des titres garantis par des prêts hypothécaires commerciaux reflètent en grande partie l'incidence de la conjoncture économique locale et d'autres facteurs économiques sur les marchés immobiliers, la capacité de paiement des locataires et la capacité du propriétaire à attirer et à conserver des locataires. Ces titres peuvent être moins liquides et plus volatils que d'autres types de titres adossés à des créances hypothécaires ou à des actifs. Les autres titres adossés à des actifs sont constitués à partir de divers types d'actifs sous-jacents, y compris, mais sans s'y limiter, les prêts automobiles, les créances telles que les soldes de cartes de crédit et les créances des hôpitaux, les prêts sur la valeur nette du bien foncier et les prêts aux étudiants, les prêts garantis par un bateau, une maison mobile, un véhicule récréatif ou une maison préfabriquée, les contrats de location d'aéronefs ou d'ordinateurs et les prêts bancaires syndiqués.

Les titres garantis par des créances (« TGC ») comprennent les titres garantis par des obligations (« TGO »), les titres garantis par des prêts (« TGP ») et d'autres titres structurés de la même façon. Les TGO et les TGP sont des titres adossés à des actifs. Un TGO est une fiducie garantie par un portefeuille diversifié de titres à haut risque, c'est-à-dire de qualité inférieure à la catégorie investissement. Un TGP est une fiducie habituellement garantie par un portefeuille de prêts pouvant inclure des prêts nationaux ou étrangers de premier rang garantis, des prêts de premier rang non garantis et des prêts aux sociétés de second rang, notamment des prêts ayant une notation inférieure à la catégorie investissement et les prêts équivalents non notés. Les risques de placement associés à un TGC dépendent largement du type d'actif donné en garantie et de la catégorie de TGC dans laquelle les Fonds investissent. Les TGC comportent d'autres risques, y compris, mais sans s'y limiter, l'éventualité que i) les distributions provenant des actifs donnés en garantie ne soient pas suffisantes pour verser des intérêts ou d'autres paiements, ii) la qualité de

l'actif donné en garantie se déprécie ou qu'il y ait une défaillance, iii) les Fonds investissent dans des TGO, TGP et autres TGC subordonnés à d'autres catégories, et iv) la structure complexe des titres ne soit pas complètement comprise au moment du placement et qu'elle génère des litiges avec l'émetteur ou produise des résultats inattendus.

Les titres adossés à des créances hypothécaires avec flux groupés (« TACI flux groupés ») sont des créances de personne morale garanties par des prêts hypothécaires complets ou des obligations hypothécaires du secteur privé, et divisées en catégories. Les TACI flux groupés sont structurés en plusieurs catégories, souvent appelées des « tranches ». Chaque catégorie comporte une échéance différente et a droit à un échéancier différent de remboursement du capital et des intérêts, notamment les remboursements par anticipation. Les TACI flux groupés peuvent offrir une moins grande liquidité et faire preuve de plus de volatilité que d'autres types de titres adossés à des créances hypothécaires ou à des actifs.

Les titres adossés à des créances hypothécaires démembrés (« TACHD ») sont des titres hypothécaires dérivés multi-catégories. Les TACHD ont généralement une structure à deux catégories, chacune recevant une part différente des distributions d'intérêts et de capital provenant d'un ensemble d'actifs hypothécaires. L'une des catégories des TACHD reçoit la totalité des intérêts (la catégorie intérêt seulement ou « IS »), tandis que l'autre catégorie reçoit la totalité du capital (la catégorie capital seulement ou « CS »). Les paiements reçus au titre des catégories IS sont présentés dans les intérêts à distribuer de l'état du résultat global. Comme aucun capital ne sera reçu à l'échéance d'une catégorie IS, les ajustements sont apportés au coût du titre, mensuellement, jusqu'à l'échéance. Ces ajustements sont inscrits dans les intérêts à distribuer de l'état du résultat global. Les paiements reçus au titre des catégories CS sont comptabilisés comme des diminutions du coût et de la valeur nominale des titres.

**Titres à rendement réinvesti** Certains Fonds peuvent investir dans des titres à rendement réinvesti. Les titres à rendement réinvesti confèrent à l'émetteur l'option, à chaque date de paiement, de verser les intérêts soit sous forme de trésorerie soit sous forme de titres de créance supplémentaires, ou les deux. Ces titres de créance supplémentaires comportent habituellement les mêmes caractéristiques que les titres d'origine, y compris les dates d'échéance et les taux d'intérêt, ainsi que les risques associés. Les cours de marché quotidiens des obligations d'origine peuvent comprendre les intérêts courus (intérêts compris dans le cours) et nécessitent un ajustement des intérêts à recevoir comptabilisé dans l'état de la situation financière, en fonction de la plus-value (moins-value) latente des placements.

**Obligations perpétuelles** Certains Fonds peuvent investir dans des obligations perpétuelles. Les obligations perpétuelles sont des titres à revenu fixe sans date d'échéance qui versent des intérêts de manière perpétuelle (sans date d'échéance précisée). Contrairement aux titres à revenu fixe classiques, les obligations perpétuelles ne comportent pas d'obligation de rembourser le capital. Les versements d'intérêts sont cependant obligatoires. Elles peuvent également être remboursables par anticipation au gré de l'émetteur. Le cas échéant, la perpétuité est levée et le capital est remboursé à la date précisée. De plus, une obligation perpétuelle peut comporter des caractéristiques supplémentaires, comme une augmentation du taux d'intérêt à certaines dates régulières, ou à un moment prédéterminé.

**Fiducies de placement immobilier (FPI)** Certains Fonds peuvent investir dans des FPI, qui sont des véhicules de placement collectif qui détiennent, et qui gèrent généralement, de l'immobilier générateur de revenus. Si une FPI respecte certaines exigences, y compris la distribution de la majorité de son revenu imposable (autre que les gains en capital nets) aux porteurs de parts, elle ne paie pas d'impôt sur le revenu distribué aux porteurs de parts. Les distributions reçues des FPI peuvent être considérées comme un revenu, un gain en capital ou un remboursement de capital. Un remboursement de capital est comptabilisé par un Fonds comme une réduction du coût du placement dans la FPI. Les FPI sont assujetties à des frais de gestion et à d'autres frais, donc les Fonds qui investissent dans des FPI paient un montant proportionnel des frais des activités des FPI.

### Titres d'État, organismes gouvernementaux et sociétés

**d'État** Certains Fonds peuvent investir dans des titres du gouvernement canadien. Les titres du gouvernement canadien sont des obligations émises ou garanties par le gouvernement, les organismes gouvernementaux ou les sociétés d'État du Canada. Les titres du gouvernement canadien sont assujettis aux risques de marché et de taux d'intérêt et peuvent être soumis à divers degrés de risque de crédit. Les titres du gouvernement canadien comprennent les titres zéro coupon, qui ont tendance à être soumis à de plus grands risques de marché que les titres portant intérêt d'échéances similaires.

Certains Fonds peuvent investir dans des titres d'organismes gouvernementaux américains ou de sociétés soutenues par l'État américain. Les titres du gouvernement américain sont des obligations émises ou garanties par le gouvernement des États-Unis, ses agences ou ses organismes publics. Certains titres du gouvernement américain, comme les bons du Trésor, les billets et les obligations, et les titres garantis par la Government National Mortgage Association (« GNMA » ou « Ginnie Mae »), bénéficient de l'engagement de courtoisie internationale du gouvernement des États-Unis; d'autres titres, comme ceux de la Federal Home Loan Banks, bénéficient du droit de l'émetteur d'emprunter au département du Trésor des É.-U. (le « Trésor américain »); et d'autres, comme ceux de la Federal National Mortgage Association (« FNMA » ou « Fannie Mae »), bénéficient du pouvoir discrétionnaire du gouvernement américain pour l'achat d'obligations émises par les organismes d'État. Les titres du gouvernement américain comprennent des titres zéro coupon. Les titres zéro coupon ne produisent pas d'intérêts régulièrement et ont tendance à être soumis à de plus grands risques que les titres portant intérêt.

Les garants liés au gouvernement (c.-à-d. ne bénéficiant pas de l'engagement de courtoisie internationale du gouvernement des États-Unis) comprennent la FNMA et la Federal Home Loan Mortgage Corporation (« FHLMC » ou « Freddie Mac »). La FNMA est une société d'État. Elle achète des hypothèques résidentielles conventionnelles (c.-à-d. non assurées et non garanties par un quelconque organisme gouvernemental) auprès d'une liste de vendeurs/prestataires approuvés incluant des organismes agréés d'épargne et de crédit étatiques ou fédéraux, des banques mutuelles d'épargne, des banques commerciales, des caisses populaires et des banques de crédit hypothécaire. Le paiement régulier du capital et des intérêts sur les titres à flux identique émis par la FNMA est garanti par celle-ci, mais ces titres ne bénéficient pas de la réputation de solvabilité du gouvernement américain. La FHLMC émet des certificats de participation, qui sont des titres à flux identique, chacun représentant une participation indivise dans un portefeuille de prêts hypothécaires résidentiels. La FHLMC garantit le paiement régulier des intérêts et le recouvrement final du capital, mais les certificats de participation ne bénéficient pas de la réputation de solvabilité du gouvernement des États-Unis.

En juin 2019, la FNMA et la FHLMC ont commencé à émettre des titres adossés à des créances hypothécaires uniformes plutôt que leur offre actuelle de titres à déterminer (« To-be-announced » ou « TBA ») admissibles (l'initiative de titre unique). L'initiative de titre unique vise à favoriser la liquidité générale du marché des titres à déterminer et harmonise les caractéristiques des certificats de la FNMA et de la FHLMC. Les effets à long terme que pourrait avoir l'initiative de titre unique sur le marché des titres à déterminer et des autres titres adossés à des créances hypothécaires sont incertains.

Certaines stratégies de synchronisation peuvent être utilisées afin qu'un Fonds puisse proroger l'expiration ou l'échéance d'une position, comme un titre à déterminer sur un actif sous-jacent, en fermant la position avant son expiration et en ouvrant une nouvelle position relative au même actif sous-jacent ou à un actif sous-jacent semblable avec une date d'expiration ultérieure. Les titres à déterminer achetés ou vendus sont respectivement comptabilisés à titre d'actif ou de passif dans l'état de la situation financière.

**Titres scindés** Les titres scindés sont des titres à revenu fixe du Trésor des États-Unis dont le capital est séparé, ou détaché, des coupons, chacun devenant un titre zéro coupon. Les titres scindés se négocient au-dessous de leur valeur nominale et les investisseurs ne reçoivent pas de paiements d'intérêt, mais un seul paiement à la date d'échéance. Les titres zéro coupon ne

produisent pas d'intérêts régulièrement et ont tendance à être soumis à de plus grands risques que les titres portant intérêt.

**Bons de souscription** Certains Fonds peuvent recevoir des bons de souscription. Les bons de souscription sont des titres généralement émis de pair avec un titre de créance ou une action privilégiée et ils donnent le droit au porteur d'acheter un montant proportionnel d'actions ordinaires à un prix donné. Les bons de souscription ont une durée de vie qui se chiffre en années et donnent le droit au porteur d'acheter des actions ordinaires d'une société à un prix qui est généralement supérieur au cours du marché au moment de l'émission du bon de souscription. Les bons de souscription peuvent comporter des risques plus importants que certains autres types de placement. En règle générale, les bons de souscription n'incluent pas de droit de percevoir des dividendes ni de droit de vote attachés aux titres sous-jacents, et ils ne comportent aucun droit relatif aux actifs de l'émetteur. De plus, leur valeur ne varie pas nécessairement en fonction de la valeur des titres sous-jacents et ils perdent leur valeur s'ils ne sont pas exercés le jour de leur expiration, ou avant. Si le cours de marché de l'action sous-jacente ne dépasse pas le prix d'exercice au cours de la durée de vie du bon de souscription, le bon de souscription n'aura aucune valeur à son expiration. Les bons de souscription peuvent augmenter le gain ou la perte possible réalisé à partir de placements, comparativement au placement du même montant dans les titres sous-jacents. De même, le pourcentage d'augmentation ou de diminution de la valeur d'un bon de souscription rattaché à un titre de participation peut être supérieur au pourcentage d'augmentation ou de diminution de la valeur de l'action ordinaire sous-jacente. Les bons de souscription peuvent permettre l'achat d'actions ou des titres de créance. Les titres de créance auxquels sont rattachés des bons de souscription d'actions possèdent plusieurs des caractéristiques des titres convertibles et leur cours peut, dans une certaine mesure, suivre le rendement de l'action sous-jacente. Les titres de créance peuvent également être émis avec des bons de souscription permettant d'acheter davantage de titres de créance au même taux d'intérêt. Une baisse des taux d'intérêt permettrait à un Fonds de vendre de tels bons de souscription et en tirer un bénéfice. Une hausse des taux d'intérêt signifie généralement que ces bons de souscription n'auront aucune valeur au moment de leur expiration.

**Opérations sur titres avant leur émission** Certains Fonds peuvent acheter ou vendre des titres avant leur émission. Ces transactions sont conditionnelles, étant donné que le titre, même s'il est autorisé, n'a pas encore été émis sur le marché. Les opérations d'achat ou de vente de titres avant leur émission impliquent qu'un Fonds s'engage à acheter ou à vendre ces titres à un prix ou à un rendement prédéterminé, avec un paiement et une livraison ayant lieu au-delà de la période de règlement habituelle. Un Fonds peut vendre, avant qu'ils ne soient livrés, des titres avant leur émission, ce qui peut entraîner un gain ou une perte réalisé.

### b) Placement dans des fonds sous-jacents

Le Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence et le Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base investissent la plus grande partie de leur actif dans des parts de série I d'autres fonds gérés par PIMCO Canada (les « Fonds PIMCO sous-jacents »). Les Fonds PIMCO sous-jacents sont considérés comme étant des entités affiliées au Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence et au Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base. Le Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence et le Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base considèrent que l'ensemble de leurs placements dans des Fonds PIMCO sous-jacents sont des placements dans des entités structurées non consolidées. Une entité structurée est une entité qui a été conçue de façon à ce que les droits de vote, ou tout droit similaire, ne soient pas le facteur dominant lors de la détermination du contrôle de l'entité, à savoir lorsque tout droit de vote se rapporte uniquement aux tâches administratives et que les activités pertinentes sont régies à l'aide de dispositions contractuelles. Les Fonds PIMCO sous-jacents financent leurs opérations en émettant des parts rachetables, qui peuvent être vendues au gré du porteur et qui accordent au porteur le droit d'obtenir une part proportionnelle de l'actif net du fonds concerné. La variation de la juste valeur de chacun des Fonds PIMCO sous-jacents est comprise dans la variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements dans les fonds

sous-jacents à l'état du résultat global. Un exemplaire du rapport destiné aux actionnaires de chacun des Fonds PIMCO sous-jacents peut être obtenu sur notre site au [www.pimco.ca](http://www.pimco.ca) ou sur SEDAR+ au [www.sedarplus.ca](http://www.sedarplus.ca).

## 6. EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

Les paragraphes qui suivent contiennent des renseignements sur la capacité des Fonds à prêter ou à emprunter de la trésorerie ou des titres dans la mesure permise, ce qui peut être considéré comme des opérations d'emprunt ou de financement. Le classement de ces instruments dans les états financiers des Fonds est décrit ci-dessous. Veuillez consulter la note 8 « Risques liés aux instruments financiers », pour obtenir une description détaillée du risque de crédit et du risque de contrepartie pouvant être associés aux emprunts et aux autres opérations de financement.

**a) Accords cadres sur transactions à livrer** Certains Fonds peuvent conclure des opérations de financement nommées « accords cadres sur transactions à livrer ». Des accords cadres sur transactions à livrer sont des opérations dans le cadre desquelles les Fonds vendent un titre à une institution financière, la contrepartie, et consentent distinctement à racheter le même ou sensiblement le même titre à un prix et à une date convenus d'avance. Pendant la période visée par l'accord, les Fonds ne sont pas habilités à recevoir les paiements de capital et d'intérêts, selon le cas, versés sur le titre vendu à la contrepartie. Le montant convenu devant être versé au rachat des titres par les Fonds est présenté comme un passif dans l'état de la situation financière. L'écart entre le prix reçu pour le titre transféré et le prix de rachat convenu est comptabilisé à titre de revenu net par les Fonds. Ceci est communément appelé la « baisse des prix ». Une baisse des prix consiste en i) les intérêts théoriques et les ajustements du revenu attribuables à l'inflation, selon le cas, que les Fonds auraient reçus si les titres n'avaient pas été vendus et ii) les conditions de financement négociées entre les Fonds et la contrepartie. Les intérêts théoriques et les ajustements du revenu attribuables à l'inflation, selon le cas, sont comptabilisés comme des éléments des intérêts à distribuer dans l'état du résultat global. Les paiements d'intérêts calculés selon les conditions de financement négociées que versent les Fonds aux contreparties sont comptabilisés comme des éléments des charges d'intérêts dans l'état du résultat global. En période de demande accrue pour le titre, les Fonds pourraient percevoir des frais pour l'utilisation du titre par la contrepartie, ce qui pourrait leur procurer des revenus d'intérêts. Les Fonds inscriront séparément les actifs jugés liquides par le gestionnaire ou couvriront leurs obligations relatives aux accords cadres sur transactions à livrer.

**b) Opérations de prise en pension** Certains Fonds peuvent effectuer des opérations de prise en pension. Dans le cadre d'une opération de prise en pension typique, un Fonds prend possession d'un titre de créance sous-jacent (garantie) qui comporte une obligation pour le vendeur de racheter, et pour le Fonds de vendre, ladite obligation à une date et à un prix convenus. Les titres sous-jacents des opérations de prise en pension sont tenus en garde par le dépositaire des Fonds ou un sous-dépositaire désigné en vertu d'une convention de prise en pension tripartite. La juste valeur de la garantie doit égaler ou excéder la valeur totale des obligations au titre de la prise en pension, incluant les intérêts. Les titres acquis dans le cadre d'opérations de prise en pension, selon le cas, y compris les intérêts courus, sont inclus dans l'état de la situation financière. Les intérêts gagnés sont comptabilisés dans les intérêts à distribuer à l'état du résultat global. En période de demande accrue pour les titres en garantie, les Fonds pourraient payer des frais de réception de ladite garantie, qui pourraient se traduire par des charges d'intérêts pour les Fonds.

**c) Ventes à découvert** Certains Fonds peuvent conclure des opérations de vente à découvert. Les ventes à découvert sont des transactions par lesquelles un Fonds vend un titre qu'il ne possède pas. Un Fonds peut effectuer une vente à découvert de titres afin de i) compenser d'éventuelles chutes des positions longues de titres semblables, ii) augmenter la flexibilité du Fonds, iii) générer un rendement, iv) constituer une stratégie d'arbitrage du risque et v) appliquer ses stratégies de gestion globale du portefeuille comprenant des instruments dérivés. Lorsqu'un Fonds effectue une vente à découvert, il peut emprunter le titre vendu à découvert et le remettre à la contrepartie. Un Fonds doit

généralement payer des frais ou une prime pour emprunter un titre et doit rembourser tout dividende ou intérêt couru sur le titre pour la durée du prêt au prêteur du titre. Les titres vendus à découvert et les dividendes ou intérêts à payer à l'égard de ces titres, le cas échéant, sont présentés comme des montants à payer pour les ventes à découvert à l'état de la situation financière. Les ventes à découvert créent le risque qu'un Fonds doive couvrir sa position courte si le cours du titre ou de l'actif s'est apprécié, et ainsi réaliser une perte. Une vente à découvert est dite « couverte » si un Fonds détient le titre visé dans son portefeuille ou s'il a le droit de l'acquérir sans frais additionnels. Un Fonds est assujéti à des risques supplémentaires dans la mesure où il conclut des ventes à découvert sans cette protection. La perte d'un Fonds sur une vente à découvert pourrait théoriquement être illimitée dans des cas où le Fonds est incapable, pour une quelconque raison, de fermer sa position courte.

## 7. INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS

Les paragraphes qui suivent contiennent des renseignements qui expliquent pourquoi et comment les Fonds utilisent des instruments financiers dérivés. Ils expliquent aussi comment les instruments financiers dérivés influent sur la situation financière, les résultats et les flux de trésorerie des Fonds.

**a) Contrats de change à terme** Certains Fonds peuvent conclure des contrats de change à terme en vue du règlement d'achats et de ventes de titres planifiés, pour couvrir l'exposition au risque de change lié à certains ou à tous les titres en portefeuille ou dans le cadre d'une stratégie de placement. Un contrat de change à terme est une entente entre deux parties visant l'achat ou la vente d'une monnaie à une date ultérieure, à un prix fixé d'avance. La juste valeur d'un contrat de change à terme varie en fonction des fluctuations des taux de change. Les contrats de change à terme sont évalués quotidiennement à la valeur de marché et la variation de valeur est comptabilisée par les Fonds comme un gain (une perte) latent. Les gains (pertes) réalisés correspondent à la différence entre la valeur du contrat au moment où il a été conclu et sa valeur au moment où il a été dénoué. Ils sont comptabilisés à la livraison ou à la réception de la monnaie. Ces contrats peuvent comporter un risque de marché dépassant le gain (la perte) latent inscrit à l'état de la situation financière. En outre, les Fonds peuvent être exposés à un risque si les contreparties sont incapables de respecter les dispositions du contrat ou si la valeur de la devise varie en défaveur de la monnaie fonctionnelle des Fonds. Afin d'atténuer un tel risque, des titres ou de la trésorerie peuvent être échangés comme garantie, conformément aux dispositions des contrats sous-jacents.

**b) Contrats à terme** Certains Fonds peuvent conclure des contrats à terme. Les contrats à terme sont des ententes visant l'achat ou la vente d'un titre ou d'un autre actif à une date future et à un prix déterminés d'avance. Ils sont négociés en bourse. Les Fonds peuvent utiliser des contrats à terme pour gérer leur exposition aux marchés des valeurs mobilières ou aux variations de taux d'intérêt et des devises étrangères. La corrélation imparfaite entre le changement de la juste valeur des titres en portefeuille et la valeur des contrats à terme ainsi que la possibilité d'un marché non liquide sont les principaux risques liés à l'utilisation des contrats à terme. Les contrats à terme sont évalués selon le prix de règlement établi chaque jour de bourse. Lors de la conclusion d'un contrat à terme, les Fonds doivent déposer auprès de leur courtier de la trésorerie, des obligations des gouvernements canadien ou américain ou de leurs agences, ou des titres souverains sélectionnés, conformément aux exigences de dépôt de garantie du courtier ou de la bourse. Les contrats à terme sont évalués quotidiennement à la valeur du marché et, selon les variations du prix des contrats, un montant créditeur ou débiteur est enregistré pour tenir compte des variations de valeur (« Marge de variation des contrats à terme »). Les marges de variation des contrats à terme, s'il y a lieu, sont inscrites dans les instruments financiers dérivés faisant l'objet d'une compensation centralisée à l'état de la situation financière. Les gains (pertes) sont constatés, mais ne sont pas considérés comme réalisés tant que les contrats ne sont pas expirés ou dénoués. Les contrats à terme comportent, à divers degrés, des risques de perte dépassant la marge de variation incluse dans les instruments financiers dérivés négociés en bourse ou faisant l'objet d'une compensation centralisée présentée à l'état de la situation financière.

**c) Contrats d'options** Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options pour améliorer leur rendement ou pour couvrir une position existante ou un placement futur. Les Fonds peuvent vendre des options d'achat et de vente sur les titres et les instruments dérivés qu'ils détiennent ou dans lesquels ils peuvent investir. La vente d'options de vente a tendance à augmenter l'exposition des Fonds à l'instrument financier sous-jacent. La vente d'options d'achat a tendance à réduire l'exposition des Fonds à l'instrument financier sous-jacent. Lorsque les Fonds vendent une option d'achat ou de vente, un montant égal à la prime reçue est comptabilisé et ensuite évalué à la valeur de marché pour refléter la juste valeur actuelle de l'option souscrite. Ces montants sont inclus dans l'état de la situation financière. Les primes reçues sur les options vendues qui expirent sont traitées comme des gains réalisés. Lorsque les primes reçues sur les options vendues sont exercées ou fermées, elles sont ajoutées au produit ou déduites des montants versés sur les opérations portant sur les contrats à terme, swaps, titres ou devises sous-jacents pour déterminer le gain (la perte). Certaines options peuvent être vendues avec des primes à déterminer à une date ultérieure. Les primes liées à ces options sont calculées selon certains paramètres de volatilité implicite. Les Fonds, en tant que vendeurs d'une option, n'ont aucun contrôle sur l'exercice de l'option de vente ou d'achat de l'instrument financier sous-jacent. Par conséquent, ils courent le risque d'une variation défavorable du prix de l'instrument sous-jacent à l'option vendue. Il existe un risque que les Fonds ne puissent pas conclure une opération de liquidation en raison de l'étroitesse du marché.

Certains Fonds peuvent aussi acheter des options d'achat et de vente. L'achat d'options d'achat a tendance à augmenter l'exposition des Fonds à l'instrument financier sous-jacent. L'achat d'options de vente a tendance à réduire l'exposition des Fonds à l'instrument financier sous-jacent. Les Fonds versent une prime qui est comptabilisée à titre d'actif dans l'état de la situation financière des Fonds et par la suite évaluée à la valeur de marché pour refléter la juste valeur actuelle de l'option. Les primes versées pour l'achat des options qui ont expiré sont traitées comme des pertes réalisées. Certaines options peuvent être souscrites avec des primes à déterminer à une date ultérieure. Les primes liées à ces options sont calculées selon certains paramètres de volatilité implicite. Le risque associé à l'achat d'options de vente et d'achat se limite à la prime payée. Lorsqu'une option achetée est exercée ou dénouée, la prime versée est ajoutée aux montants payés ou déduite du produit de l'opération de placement sous-jacente pour déterminer le gain (la perte) réalisé par suite de l'opération.

**Options sur swap de défaillance** Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options sur swap de défaillance pour couvrir l'exposition au risque de crédit lié à un placement sans prendre aucun engagement à l'égard de l'instrument sous-jacent. Une option sur swap de défaillance permet de vendre ou d'acheter une protection de crédit à l'égard d'un élément en particulier en concluant un swap préétabli pour une date ultérieure prédéterminée.

**Options sur devises** Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options sur devises. Ces options peuvent être vendues ou achetées à des fins de couverture de positions vendeur ou acheteur contre les variations des taux de change ou pour s'exposer aux monnaies étrangères.

**Options sur swap de taux d'intérêt** Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options sur swap de taux d'intérêt, qui constituent des options permettant de conclure un swap prédéfini, ou de raccourcir, prolonger, annuler ou autrement modifier un swap existant, pour une date ultérieure prédéterminée. L'émetteur de l'option sur swap devient la contrepartie au swap si l'acheteur décide de l'exercer. L'option sur swap de taux d'intérêt précise si l'acheteur est un receveur ou un acheteur de taux fixe lorsque l'option est exercée.

**Options sur fonds négociables en bourse** Certains Fonds utilisent un fonds négocié en bourse particulier comme instrument sous-jacent du contrat d'option. Un Fonds peut vendre ou acheter des options pour améliorer son rendement ou pour couvrir une position existante ou un placement futur.

**Options sur contrats à terme négociés en bourse** Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options sur contrats à terme négociés en bourse (« options sur contrats à terme ») pour couvrir une position existante ou un

placement ultérieur à des fins spéculatives ou pour gérer leur exposition aux fluctuations du marché. Une option sur contrat à terme est un contrat d'option dans lequel le sous-jacent est un seul contrat à terme.

**Options sur indices** Certains Fonds utilisent un indice particulier comme sous-jacent du contrat d'option. L'exercice d'une option n'inclura pas la livraison matérielle de l'indice sous-jacent, mais le transfert d'un montant de trésorerie équivalent à la différence entre le prix de règlement de l'indice sous-jacent et le prix d'exercice.

**Options sur titres** Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options sur titres pour améliorer leur rendement ou pour couvrir une position existante ou un placement futur. Une option sur titre utilise un titre particulier comme sous-jacent du contrat d'option.

**d) Swaps** Certains Fonds peuvent investir dans des swaps. Les swaps sont des contrats conclus de gré à gré entre les Fonds et une contrepartie dans le cadre duquel les deux parties acceptent mutuellement d'échanger des flux de trésorerie d'investissement, des actifs, des devises ou des rendements liés au marché à des moments futurs prédéterminés. Les swaps peuvent se négocier sur le marché hors cote (« swaps hors cote ») ou peuvent être exécutés par l'intermédiaire d'un tiers, connu sous le nom de contrepartie centrale ou d'organisation de compensation de produits dérivés (« swaps faisant l'objet d'une compensation centralisée »). Les Fonds peuvent conclure des swaps d'actifs, des swaps sur défaillance, des swaps sur devises, des swaps de taux d'intérêt, des swaps de rendement total, des swaps de variance et d'autres formes de swaps pour gérer leur exposition aux risques de crédit, de change, de taux d'intérêt et d'inflation, ainsi qu'aux risques sur marchandises et sur actions. Dans le cadre de ces contrats, des titres ou des liquidités peuvent être considérés comme des garanties ou des dépôts, conformément aux dispositions des swaps respectifs, pour procurer des actifs de valeur et offrir un recours en cas de défaillance, de faillite ou d'insolvabilité.

Les swaps faisant l'objet d'une compensation centralisée sont évalués quotidiennement à la valeur de marché, conformément au contrat sous-jacent ou aux exigences de la contrepartie centrale ou de l'organisation de compensation de produits dérivés. Les variations de la juste valeur, selon le cas, sont comptabilisées comme des éléments de la variation nette de la plus-value (moins-value) latente figurant à l'état du résultat global. Les variations quotidiennes du prix des swaps faisant l'objet d'une compensation centralisée (« marge de variation du swap »), s'il y a lieu, sont inscrites dans les instruments financiers dérivés faisant l'objet d'une compensation centralisée à l'état de la situation financière. Les paiements relatifs aux swaps hors cote reçus ou versés à l'ouverture de la période d'évaluation sont inclus dans l'état de la situation financière. Ils correspondent aux primes payées ou reçues à la signature des swaps pour compenser les écarts entre les conditions prévues des swaps et les conditions réelles du marché (écarts de taux, taux de change, taux d'intérêt et autres facteurs pertinents). Les primes initiales reçues (payées) sont premièrement comptabilisées comme passif (actif), puis évaluées à la valeur de marché afin de tenir compte de la valeur actuelle du swap. Les primes initiales sont comptabilisées comme un gain (une perte) réalisé dans l'état du résultat global à la liquidation ou à l'échéance du swap. Un paiement de liquidation reçu ou effectué à la liquidation du swap est comptabilisé comme un gain (une perte) réalisé à l'état du résultat global. Les paiements périodiques nets reçus ou versés par les Fonds sont présentés comme un revenu (une perte) sur instruments dérivés dans l'état du résultat global.

Aux fins d'application des politiques de placement et des restrictions des Fonds, les swaps sont généralement évalués par les Fonds à la juste valeur. Dans le cas d'un swap sur défaillance, les Fonds l'évalueront à sa valeur notionnelle ou à son entière valeur d'exposition (c.-à-d. la somme du montant notionnel du swap plus la juste valeur), mais pourraient évaluer le swap sur défaillance à la juste valeur aux fins d'application de certaines des autres politiques et restrictions des Fonds. Par exemple, un Fonds pourrait évaluer les swaps sur défaillance à leur entière valeur d'exposition aux fins des lignes directrices de qualité du crédit du Fonds (le cas échéant), car une telle valeur tient compte de l'exposition économique réelle du Fonds sur la durée du swap sur défaillance.

Par conséquent, un Fonds peut, par moment, avoir une exposition nominale à une catégorie d'actif (avant compensation) qui est supérieure ou inférieure à la limite ou à la restriction indiquée dans le prospectus des Fonds. Dans ce contexte, le montant notionnel et la juste valeur pourraient être positifs ou négatifs selon qu'un Fonds achète ou vende la protection par le biais du swap sur défaillance. La manière dont certains titres ou autres instruments sont évalués par un Fonds aux fins d'application des politiques et des restrictions de placement pourrait dévier de la manière dont ces placements sont évalués par d'autres types d'investisseurs.

La conclusion de ce type de contrats comporte, à divers degrés, des éléments de risques de taux d'intérêt, de crédit et de marché, ainsi que des risques documentaires supérieurs aux montants constatés dans l'état de la situation financière. Ces risques sont notamment la possibilité qu'il n'existe pas de marché liquide au moment du règlement, que la contrepartie au contrat manque à ses obligations ou ait une interprétation différente des conditions du contrat, ou que l'évolution des taux d'intérêt ou de la valeur de l'actif sur lesquels est établi le swap soit défavorable.

Le risque maximal de perte des Fonds en raison du risque de crédit de la contrepartie correspond à la valeur nette actualisée des flux de trésorerie devant être reçus de la contrepartie pendant la période restant à courir jusqu'à la fin du contrat, dans la mesure où le montant est positif. Le risque peut être atténué au moyen d'un accord de compensation cadre entre les Fonds et la contrepartie, et du dépôt d'une garantie pour couvrir l'exposition des Fonds à la contrepartie.

**Swaps sur défaillance** Certains Fonds peuvent utiliser les swaps sur défaillance pour les émissions de sociétés, les émissions d'emprunt, les émissions souveraines, les émissions municipales américaines ou du Trésor américain pour obtenir une certaine protection contre la défaillance des émetteurs (c.-à-d. pour réduire les risques lorsqu'un Fonds détient l'obligation ou y est exposé) ou pour prendre une position acheteur ou vendeur active dans le cadre d'une probabilité de défaillance de la part d'un émetteur particulier. Aux termes des swaps sur défaillance, une partie (appelée « acheteur de protection ») verse une série de paiements à une autre partie (le « vendeur de protection ») en échange du droit de recevoir un rendement prédéterminé si l'entité, l'obligation ou l'indice de référence, conformément au swap, subit un incident de crédit particulier. En tant que vendeurs de protection dans le cadre de swaps sur défaillance, les Fonds reçoivent généralement de la part de l'acheteur de protection un taux de revenu fixe pendant toute la durée du swap, sous réserve qu'aucun problème de solvabilité ne survienne. En tant que vendeurs, les Fonds augmenteraient efficacement l'effet de levier de leur portefeuille parce qu'en plus de l'apport à leur actif net, les Fonds assujettiraient leurs placements à une exposition sur la valeur notionnelle du swap.

Si les Fonds sont vendeurs de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, les Fonds soit i) verseront à l'acheteur de protection un montant équivalent à la valeur notionnelle du swap et prendront livraison de l'obligation, d'autres obligations livrables ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence, soit ii) paieront un montant net de règlement, sous forme de trésorerie ou de titres, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation ou des titres sous-jacents constituant l'indice de référence. Si les Fonds sont acheteurs de protection et que survient un incident de crédit, tel qu'il est défini par les dispositions du swap pertinent, les Fonds soit i) recevront de la part du vendeur de protection un montant égal à la valeur notionnelle du swap et livreront l'obligation de référence, les autres obligations livrables ou les titres sous-jacents comprenant l'indice de référence, soit ii) recevront un montant net de règlement, sous forme de trésorerie ou de titres, égal à la valeur notionnelle du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents comprenant l'indice de référence. Les valeurs de recouvrement sont des valeurs estimées par les teneurs de marchés qui prennent en compte soit les taux de recouvrement normaux du secteur d'activité, soit les facteurs particuliers à l'entité, jusqu'à ce qu'un incident de crédit survienne. Selon le cas, la valeur de recouvrement est déterminée par une vente aux enchères aux termes de laquelle un nombre minimal d'offres de

courtiers admissibles et une méthode d'évaluation spécifiée sont utilisés pour calculer la valeur de règlement. La capacité à livrer les autres obligations peut se solder par une option de livraison moins onéreuse (le droit de l'acheteur de protection de choisir l'obligation livrable ayant la plus faible valeur après un incident de crédit).

Aux termes des swaps sur défaillance d'indices de crédit, une partie effectue une série de paiements à l'autre partie pour avoir le droit de recevoir un rendement spécifique en cas de dépréciation, de problèmes de capital et de taux d'intérêt, ou de défaillance de tout ou partie des entités participantes, y compris l'indice de crédit. Un indice de crédit est un ensemble d'instruments de crédit ou d'expositions censés représenter globalement une partie du marché du crédit. Ces indices sont composés des instruments de crédit de référence jugés par un groupe de courtiers experts comme étant les plus liquides sur le marché des swaps sur défaillance de crédit, en fonction du secteur de l'indice. Les composantes de l'indice peuvent inclure, sans s'y limiter, des titres de qualité investissement, des titres à rendement élevé, des titres adossés à des actifs, des titres des marchés émergents et/ou des titres ayant des notations diverses dans chaque secteur. Les indices de crédit se négocient par l'intermédiaire des swaps sur défaillance de crédit selon des modalités normalisées, notamment les écarts fixes et les dates d'échéance réglementaires. Un swap sur défaillance d'indice de crédit s'applique à tous les titres de l'indice, et en cas de défaillance, le problème de solvabilité est réglé en fonction de la pondération du titre dans l'indice. La composition des indices change périodiquement, habituellement tous les six mois, et dans la plupart des indices, les titres ont la même pondération. Les Fonds peuvent utiliser des swaps sur défaillance d'indices de crédit pour couvrir un portefeuille de swaps sur défaillance ou d'obligations, ce qui est moins dispendieux que de se procurer de nombreux swaps sur défaillance pour arriver au même résultat. Les swaps sur défaillance visant des indices sont des instruments visant la protection des investisseurs qui détiennent des obligations contre une défaillance; les opérateurs de marché les utilisent pour spéculer sur les variations de la qualité du crédit.

Les écarts de taux implicites (en termes absolus) utilisés pour déterminer la juste valeur d'un swap sur défaillance sur des émissions de société, des émissions d'emprunt, des émissions souveraines, des émissions municipales américaines ou des émissions du Trésor américain servent à indiquer le statut courant du risque de paiement/rendement, et ils déterminent la probabilité de défaillance de l'entité émettrice. L'écart de taux implicite d'une entité reflète le coût de l'achat ou de la vente d'une protection pour l'entité en question et peut inclure les paiements initiaux requis pour conclure l'accord. L'élargissement des écarts de taux indique un affaiblissement du niveau de solvabilité de l'entité en question et une plus grande probabilité de défaillance ou de survenance d'autres incidents de crédit tels qu'ils sont définis dans les dispositions de l'accord. Pour les swaps sur défaillance de titres adossés à des actifs et d'indices de crédit, les cours des marchés et les valeurs résultantes permettent de suivre l'évolution du risque de paiement/rendement. L'augmentation des justes valeurs en termes absolus, lorsque comparées aux valeurs notionnelles du swap, indique un affaiblissement du niveau de solvabilité de l'entité référencée et une plus grande probabilité de défaillance ou de risque de défaillance, ou de survenance d'autres incidents de crédit définis dans les dispositions de l'accord.

Le montant maximal potentiel des paiements futurs (non actualisés) que les Fonds, en tant que vendeurs de protection, peuvent être amenés à effectuer aux termes d'un swap sur défaillance correspond à la valeur notionnelle du swap. La valeur notionnelle de chaque swap sur défaillance en cours à la clôture de la période pour lequel les Fonds sont des vendeurs de protection est présentée dans l'inventaire du portefeuille. Ces montants potentiels sont partiellement compensés par toute valeur de recouvrement des obligations de référence respectives, les paiements reçus au moment de la conclusion du contrat ou les montants nets reçus au moment du dénouement des swaps sur défaillance conclus par les Fonds pour la ou les mêmes entités.

**Swaps de devises** Certains Fonds peuvent conclure des contrats de swaps sur devises pour augmenter ou atténuer leur exposition au risque de change.

Les contrats de swaps de devises impliquent l'échange entre deux parties de deux devises différentes assorti d'un accord pour inverser l'échange à une date ultérieure à des taux de change spécifiques. L'échange de devises à la date de prise d'effet du contrat a lieu au cours du change au comptant. L'échange à l'échéance peut avoir lieu au même taux de change, à un taux spécifique, ou au cours du change au comptant. Les versements d'intérêts, le cas échéant, sont effectués entre les parties en fonction des taux d'intérêt disponibles dans les deux devises à la date de prise d'effet du contrat. Les conditions des contrats de swaps de devises peuvent porter sur plusieurs années. Les swaps de devises sont généralement négociés avec les banques commerciales et d'investissement. Certains swaps de devises peuvent ne pas prévoir d'échange de flux de trésorerie de capital, mais uniquement des échanges de flux de trésorerie d'intérêt.

**Swaps de taux d'intérêt** Certains Fonds sont exposés au risque de taux d'intérêt dans le cours normal de leurs activités de placement. La valeur des obligations à taux fixe détenues par certains Fonds peut diminuer si les taux d'intérêt augmentent. Pour contribuer à atténuer ce risque et maintenir leur capacité de générer des revenus au taux prévalant sur les marchés, les Fonds peuvent conclure des swaps de taux d'intérêt. Dans un swap de taux d'intérêt, les Fonds échangent avec une autre partie leur engagement respectif à payer ou à recevoir des intérêts sur la valeur notionnelle du capital. Certaines formes de swaps de taux d'intérêt peuvent inclure : i) un plafonnement des taux d'intérêt, en vertu duquel, moyennant une prime, une partie accepte d'effectuer des paiements à l'autre partie dans la mesure où les taux d'intérêt dépassent un taux précisé, appelé « plafond », ii) un taux plancher, en vertu duquel, moyennant une prime, une partie accepte d'effectuer des paiements à l'autre partie dans la mesure où les taux d'intérêt passent en dessous d'un taux précisé, appelé « plancher », iii) une fourchette de taux, en vertu de laquelle une partie vend un plafonnement et achète un plancher ou vice-versa dans le but de se protéger contre les variations de taux au-delà et en dessous de certains niveaux convenus, iv) des swaps de taux d'intérêt remboursables, en vertu desquels l'acheteur verse une commission initiale pour le droit de mettre fin à la totalité de l'opération de swap de manière précoce sans frais à une date et à une heure prédéterminées, avant la date d'échéance, v) des swaps à différentiel fixe, qui permettent aux utilisateurs de swaps de taux d'intérêt de bloquer la marge différentielle future (ou écart) entre le taux du swap de taux d'intérêt et un point de référence convenu, ou vi) des swaps variable-variable, en vertu duquel les deux parties peuvent échanger des taux d'intérêt variables de différents segments des marchés monétaires.

**Swaps sur le rendement total** Certains Fonds peuvent contracter des swaps sur le rendement total pour acquérir ou limiter une exposition à l'actif de référence sous-jacent. Les swaps sur le rendement total constituent des engagements qui prévoient qu'un ou plusieurs flux de trésorerie sont échangés en fonction du prix d'un actif sous-jacent de référence et d'un taux d'intérêt variable ou fixe. Les swaps sur le rendement total peuvent aussi constituer des engagements à payer des intérêts en échange d'un rendement indexé au marché. Une contrepartie verse le rendement total d'un actif de référence spécifique, qui peut être une action, un indice ou une obligation et, en échange, reçoit un taux fixe ou variable. À l'échéance, un flux net de trésorerie est échangé de façon que le rendement total corresponde au rendement de l'actif de référence sous-jacent diminué d'un taux de financement, selon le cas. Comme receveurs, les Fonds reçoivent des paiements fondés sur tout rendement total positif net, mais devraient verser des paiements en cas de rendement total négatif. Comme payeurs, les Fonds versent des paiements si le rendement total net est positif et reçoivent des paiements si le rendement total net est négatif.

## 8. RISQUES LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

Les principaux risques auxquels les Fonds sont exposés en raison des instruments financiers sont les risques de marché (notamment le risque de taux d'intérêt, le risque de change, l'autre risque de prix et le risque de perturbation du marché), le risque de liquidité, les risques de crédit et de contrepartie et le risque lié à l'abandon du LIBOR.

Les risques importants liés aux instruments financiers, auxquels les Fonds sont exposés, ainsi que les pratiques de gestion des risques spécifiques dans le cadre de ces risques, sont présentés ci-dessous. Les renseignements propres à chaque Fonds sont présentés dans la section « Risques liés aux instruments financiers » dans les notes annexes propres au Fonds.

**Risque de taux d'intérêt** Le risque de taux d'intérêt est le risque que la valeur des titres à revenu fixe fluctue en raison d'une variation de taux d'intérêt. Si les taux d'intérêt nominaux augmentent, la valeur de certains titres à revenu fixe détenus par le Fonds diminuera probablement. Un taux d'intérêt nominal peut être décrit comme étant la somme d'un taux d'intérêt réel et d'un taux d'inflation attendu. Les variations de taux d'intérêt peuvent être soudaines et imprévisibles et un Fonds peut subir des pertes si ces variations ne sont pas anticipées par la direction des Fonds. Les titres à revenu fixe à durée plus longue ont tendance à être plus sensibles aux variations de taux d'intérêt, ce qui les rend habituellement plus volatils que les titres à durée plus courte. La durée est principalement utile pour mesurer la sensibilité du cours d'un titre à revenu fixe par rapport aux variations des taux d'intérêt (c.-à-d. le rendement).

**Risque de change** Si un Fonds investit directement dans des devises, dans des titres se négociant en devises ou donnant droit à des revenus en devises, ou dans des instruments financiers dérivés offrant une exposition à des devises, il sera assujéti au risque que ces devises se déprécient par rapport à sa monnaie fonctionnelle ou, dans le cas de certaines positions de couverture, que sa monnaie fonctionnelle perde de la valeur par rapport à la monnaie faisant l'objet d'une couverture. Les taux de change dans les pays étrangers peuvent varier considérablement en peu de temps pour plusieurs raisons, notamment les mouvements des taux d'intérêt, l'intervention (ou le défaut d'intervenir) du gouvernement canadien ou de gouvernements étrangers, des banques centrales ou d'entités supranationales, telles que le Fonds monétaire international, ou l'imposition de contrôles sur les monnaies ou d'autres événements politiques au Canada et à l'étranger. Par conséquent, les placements d'un Fonds dans des titres libellés en devises peuvent réduire son rendement.

**L'autre risque de prix** L'autre risque de prix découle principalement des incertitudes quant aux cours futurs des instruments financiers détenus. Il représente la perte potentielle que les Fonds pourraient subir du fait de leurs positions sur le marché si les prix venaient à varier défavorablement (autre que ceux découlant du risque de taux d'intérêt et du risque de change). Le gestionnaire prend en considération la répartition de l'actif des portefeuilles de manière à réduire les risques afférents à des pays ou à des secteurs d'activité en particulier, tout en continuant d'adhérer aux objectifs de placement des Fonds.

**Risque de perturbation du marché** Les Fonds sont exposés aux risques d'investissement et d'exploitation associés aux faits nouveaux d'ordre financier et économique et aux perturbations sur les marchés mondiaux, y compris ceux découlant de la guerre, du terrorisme, de la manipulation des marchés, des interventions gouvernementales, des défaillances et des ralentissements, des changements politiques ou des incidents diplomatiques, des urgences en matière de santé publique (comme la propagation de maladies infectieuses, les pandémies et les épidémies) et de catastrophes naturelles/environnementales, qui peuvent tous avoir des répercussions négatives sur les marchés des valeurs mobilières et faire perdre de la valeur aux Fonds. De plus, des événements liés à un manque de liquidité, à des situations de défaillance ou de non-exécution ainsi que d'autres événements défavorables touchant les institutions financières ou le secteur des services financiers en général, ou encore des inquiétudes, des rumeurs ou toute circonstance du genre ou comportant des risques similaires pourraient, comme ils l'ont déjà fait dans le passé, entraîner d'importants problèmes de liquidité sur l'ensemble des marchés. De tels événements peuvent également affecter les technologies et les autres systèmes d'exploitation auxquels se fient les fournisseurs de services des Fonds, y compris PIMCO à titre de conseiller en valeurs des Fonds, et peuvent perturber autrement la capacité des fournisseurs de services des Fonds à respecter leurs obligations envers les Fonds.

**Risque de liquidité** L'exposition des Fonds au risque de liquidité découle principalement du rachat quotidien de parts. Les porteurs de parts rachetables peuvent demander le rachat, à leur gré et sans préavis, d'une partie ou de la totalité de leurs parts en circulation. C'est pourquoi l'actif des Fonds est constitué essentiellement de titres facilement négociables, qui peuvent être vendus rapidement.

De plus, les Fonds peuvent être touchés défavorablement lorsqu'un important porteur de parts achète ou demande le rachat de grandes quantités de parts, ce qui peut survenir à tout moment et avoir la même incidence négative sur les Fonds qu'un grand volume de demandes de rachat. Les opérations de porteurs de parts importants peuvent avoir un effet sur la liquidité et la valeur liquidative d'un Fonds. De telles opérations peuvent également augmenter les coûts de transaction d'un Fonds ou faire en sorte qu'un Fonds se comporte d'une manière autre que prévu.

Le passif à court terme lié aux instruments financiers dérivés à la clôture de la période peut se composer de la juste valeur des swaps de taux d'intérêt, des swaps sur défaillance, des swaps de devises, des options vendues et des contrats de change à terme. Les instruments financiers dérivés sont principalement acquis pour être vendus à court terme. Étant donné qu'il n'est pas prévu que ces instruments soient détenus jusqu'à leur échéance ou à leur liquidation, la juste valeur actuelle représente les flux de trésorerie qui pourraient être requis pour vendre les positions. Les flux de trésorerie futurs des Fonds et les passifs réalisés pourraient différer du passif à court terme en raison de l'évolution des conditions du marché.

Le gestionnaire gère le risque de liquidité en surveillant les portefeuilles de placements des Fonds. Il prend en considération les placements réputés non liquides, c.-à-d. difficiles à vendre, pour s'assurer qu'il y a suffisamment d'actifs liquides pour couvrir l'encours des engagements des Fonds.

**Risques de crédit et de contrepartie** Les Fonds sont exposés au risque de crédit des parties avec lesquelles ils font affaire, et font aussi face au risque de défaillance. Les Fonds réduisent les concentrations de risque de crédit en exécutant des transactions avec un grand nombre de clients et de contreparties sur des bourses reconnues, le cas échéant. Les opérations sur instruments dérivés hors cote sont assujetties au risque qu'une contrepartie à l'opération ne respecte pas ses obligations contractuelles envers l'autre partie, car plusieurs des protections applicables aux opérations sur instruments dérivés faisant l'objet d'une compensation centralisée pourraient ne pas être offertes sur les opérations sur instruments dérivés hors cote. Pour les dérivés négociés sur une bourse ou par l'intermédiaire d'une contrepartie centrale, le risque de crédit repose sur la solvabilité du courtier compensateur du Fonds, ou sur la chambre de compensation même, plutôt que sur la contrepartie, comme c'est le cas lors d'opérations sur dérivés hors cote. Des modifications portées aux règlements concernant l'utilisation de produits dérivés et d'instruments connexes par un fonds de placement pourraient possiblement limiter ou affecter la capacité du Fonds à investir dans les dérivés, limiter la capacité du Fonds à se servir de certaines stratégies qui utilisent des dérivés et/ou avoir un effet défavorable sur la valeur ou le rendement des instruments dérivés et du Fonds. Les Fonds peuvent perdre de l'argent si l'émetteur ou le garant d'un titre à revenu fixe, ou la contrepartie à un instrument financier dérivé, à une opération de prise en pension ou à un prêt de titres du portefeuille, n'est pas en mesure ou ne veut pas effectuer les paiements de capital ou d'intérêts en temps opportun, ou refuse d'une manière quelconque de respecter ses obligations. Les titres sont assujettis à divers degrés de risque, qui sont souvent pris en compte dans les notations financières.

De la même manière qu'ils sont exposés au risque de crédit, les Fonds peuvent être exposés au risque de contrepartie, ou au risque qu'une institution ou une autre entité qui est partie à une transaction non réglée ou ouverte avec les Fonds manque à ses engagements. Les actifs financiers, qui exposent potentiellement les Fonds au risque de contrepartie, se composent principalement de montants à recevoir de contreparties et de placements. PIMCO réduit le risque de contrepartie des Fonds en effectuant une recherche approfondie sur chaque contrepartie et en obtenant l'approbation du comité du

risque de contrepartie de PIMCO avant de s'engager dans des transactions avec des tiers. En outre, quand les montants non payés aux Fonds dépassent un seuil convenu avec la contrepartie, celle-ci doit remettre aux Fonds une garantie sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie d'un montant équivalant au montant dû aux Fonds. Les Fonds peuvent investir la garantie dans des titres ou d'autres instruments, et paient habituellement des intérêts à la contrepartie sur la garantie reçue. Si le montant dû aux Fonds diminue par la suite, les Fonds doivent rendre à la contrepartie la totalité ou une partie de la garantie déposée précédemment auprès des Fonds. Les mesures prises par PIMCO pour atténuer le risque de contrepartie peuvent cependant s'avérer infructueuses.

Toutes les opérations sur titres cotés sont réglées ou payées à la livraison par l'intermédiaire de contreparties approuvées. Le risque de défaillance est jugé minimal, car la livraison des titres vendus ne se fait qu'une fois que les Fonds ont reçu le paiement. Le paiement d'un achat s'effectue une fois que les titres ont été livrés par la contrepartie. La transaction échoue si l'une ou l'autre des parties manque à son obligation.

**Risque lié à l'abandon du LIBOR** Ce risque correspond au risque associé à l'abandon et au remplacement du taux interbancaire offert à Londres (« LIBOR »). Certains instruments détenus par les Fonds sont liés ou étaient liés d'une façon ou d'une autre au LIBOR. Bien que le processus d'abandon du LIBOR soit terminé pour la plupart des instruments, le LIBOR est encore utilisé dans certains cas et les effets potentiels de l'abandon du LIBOR ou de son utilisation pour les Fonds ou pour certains instruments dans lesquels les Fonds investissent pourraient être difficiles à déterminer et entraîner des pertes pour les Fonds.

**Risque lié aux modèles** Les modèles de placement utilisés pour la prise de décisions d'allocation de placement pourraient ne pas correctement tenir compte de certains facteurs et pourraient générer une baisse de la valeur d'un Fonds. Les modèles s'appuient sur des données financières et de marché exactes. Si des données erronées sont saisies dans un modèle, les conclusions du modèle seront erronées. De plus, les modèles peuvent être de nature prédictive, et de tels modèles peuvent générer des évaluations erronées d'événements futurs. Les modèles évaluent les titres ou les marchés de titres en fonction de certaines hypothèses concernant l'interaction entre les facteurs du marché. Les marchés ou les prix de titres individuels pourraient être touchés par des facteurs qui n'ont pas été prévus lors de la conception des modèles.

## 9. ACCORDS DE COMPENSATION CADRES

Les Fonds peuvent être partis à divers accords de compensation (les « accords cadres ») qui régissent les conditions des transactions avec des contreparties choisies. Ces accords cadres réduisent le risque de contrepartie inhérent aux transactions en question en précisant les mécanismes de protection et en offrant une normalisation qui en améliore la sécurité juridique. Étant donné que différents types de transactions sont assortis de mécanismes différents et sont parfois traités avec différentes entités juridiques d'une même organisation, chaque type de transaction peut être couvert par un accord cadre différent, ce qui se traduit par la nécessité d'accords multiples avec une contrepartie unique. Les accords cadres sont spécifiques à des transactions uniques sur différents types d'actifs, ils permettent donc aux Fonds de dénouer et de compenser leur exposition totale à une contrepartie en cas de défaillance relativement aux transactions régies par un accord cadre particulier conclu avec la contrepartie.

Les accords cadres peuvent aussi aider à limiter le risque de contrepartie en précisant les accords de dépôt de garantie à des niveaux d'exposition prédéterminés. En vertu des accords cadres, la garantie est habituellement transférée si l'exposition totale nette d'un compte donné à certaines transactions (nette de garantie existante et déjà en place) régies en vertu de l'accord cadre pertinent avec une contrepartie dépasse le seuil indiqué, qui se situe généralement dans une fourchette de zéro à 250 000 USD, selon la contrepartie et le type d'accord cadre. Les bons du Trésor des États-Unis et la trésorerie en dollars américains sont généralement la forme préférée de garantie, bien que d'autres formes d'instruments notés AAA puissent être utilisées. L'exposition globale des Fonds au risque de contrepartie peut changer considérablement en un court laps de temps, car elle est fonction de chaque opération assujettie à un accord cadre.

Les accords cadres de mise en pension et les accords cadres globaux de mise en pension (individuellement et collectivement, les « accords cadres de mise en pension ») régissent les transactions entre les Fonds et les contreparties choisies. Les accords de compensation cadres de mise en pension comportent, entre autres, des dispositions pour l'initiation, les versements de revenus, les cas de défaillance et le maintien de la garantie pour les opérations de mise en pension et de prise en pension de titres.

Les accords cadres de transactions sur titres à livrer (« accords cadres sur transactions à livrer ») régissent les éléments à prendre en considération et les facteurs concernant le règlement de certaines transactions à règlement différé, comme les titres à déterminer ou les livraisons différées conclues entre les Fonds et les contreparties choisies. Les accords cadres sur transactions à livrer comportent, entre autres, des dispositions pour l'initiation et la confirmation, le paiement et le transfert, les cas de défaillance, la liquidation et le maintien de la garantie. La juste valeur des transactions à règlement différé, les garanties données ou reçues et l'exposition nette de la contrepartie à la clôture de la période sont présentées dans les notes annexes propres à chaque Fonds.

Les contrats de compte client et les addendas associés régissent les opérations sur instruments dérivés faisant l'objet d'une compensation centrale, comme les contrats à terme, les options sur les contrats à terme et les instruments dérivés hors cote faisant l'objet d'une compensation centrale. Les opérations sur instruments dérivés faisant l'objet d'une compensation centrale nécessitent le versement de garantie initiale, telle que déterminée par chaque agence de compensation concernée, qui est placée seule dans un compte de courtage séparé enregistré auprès de la Commodity Futures Trading Commission (CFTC) ou de l'organisme de réglementation approprié. Le risque de contrepartie est significativement réduit, car les créanciers du courtier de contrats à terme n'ont aucun droit sur les actifs du Fonds dans le compte séparé. De plus, la portabilité de l'exposition en cas de défaillance réduit davantage le risque pour les Fonds. La marge de variation, ou la variation de la juste valeur, est échangée quotidiennement, mais ne peut pas être déduite des contrats à terme et des dérivés hors cote faisant l'objet d'une compensation centrale. La juste valeur ou la plus-value (moins-value) latente accumulée, la garantie initiale versée et tout montant à payer sur la marge de variation à la clôture de la période sont présentés dans les notes annexes propres au Fonds.

Des ententes avec des courtiers principaux peuvent être conclues afin de faciliter l'exécution ou la compensation des transactions relatives aux options sur actions cotées ou des ventes à découvert de titres de participation entre un Fonds et des contreparties choisies. Ces ententes définissent les lignes directrices encadrant les droits, les obligations et d'autres événements, y compris, sans s'y limiter, les marges, les exécutions et les règlements. Ces ententes prévoient des dispositions concernant, entre autres, les paiements, le maintien des garanties, les événements de défaillance et la liquidation. Les marges et les autres actifs donnés en garantie sont généralement détenus par le courtier principal et compenseraient toute obligation due au courtier principal. Les justes valeurs des options cotées et des titres vendus à découvert et les garanties connexes sont divulguées dans les notes annexes propres au Fonds.

Les accords cadres et les annexes sur le soutien des garanties de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (« accords cadres de l'ISDA ») régissent les opérations bilatérales sur dérivés hors cote conclues par un Fonds et des contreparties choisies. Les accords cadres de l'ISDA contiennent des dispositions sur les obligations générales, les déclarations, les accords, les dépôts de garantie et les événements de défaillance ou de liquidation. Les événements de

liquidation comprennent les conditions qui peuvent donner droit aux contreparties de choisir de mettre fin par anticipation à toutes les transactions en cours en vertu de l'accord cadre de l'ISDA pertinent et d'en provoquer le règlement. Le choix de liquider une opération par anticipation pourrait avoir un effet important sur les états financiers. L'accord cadre de l'ISDA peut comprendre des dispositions supplémentaires qui offrent une protection contre le risque de contrepartie au-delà de la couverture de l'exposition quotidienne actuelle si la qualité du crédit de la contrepartie tombe sous un seuil prédéfini ou si la réglementation l'exige. De même, un Fonds peut devoir déposer des garanties supplémentaires au-delà de la couverture de l'exposition quotidienne lorsque la réglementation l'exige. Ces montants, le cas échéant, peuvent être (ou, si la loi l'exige, seront) placés séparément auprès d'un dépositaire tiers. Si les Fonds sont tenus par la réglementation de déposer des garanties supplémentaires en plus de la couverture de l'exposition quotidienne, des coûts pourraient être engagés en raison du dépôt, dont les coûts d'obtention d'actifs admissibles aux fins de la garantie. La juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote, les garanties données ou reçues et l'exposition nette de la contrepartie à la clôture de la période sont présentées dans les notes de l'inventaire du portefeuille.

## 10. PARTS RACHETABLES

Les Fonds peuvent émettre des parts de plusieurs séries, qui confèrent aux porteurs de parts les droits à certaines prescriptions, restrictions et conditions auxquelles ils sont assujettis. Les Fonds peuvent émettre un nombre illimité de parts. Les parts des Fonds sont vendues et sont rachetables au gré du porteur de parts, conformément aux dispositions de la convention de fiducie, à la valeur liquidative par part applicable. L'obligation des Fonds au titre de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables est présentée au montant du rachat.

Les parts des séries FNB peuvent être rachetées tout jour de bourse, contre de la trésorerie, à un prix de rachat équivalent à 95 % du cours de clôture des parts des séries FNB à la date de prise d'effet du rachat, sous réserve d'un prix de rachat maximal équivalent à la valeur liquidative par part applicable.

Le capital des Fonds correspond à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables de chaque Fonds. Le capital des Fonds n'est soumis à aucune restriction externe, mis à part les exigences de souscription minimale.

Les produits de la vente de parts rachetables et le coût des parts rachetables rachetées présentés à la section « Transactions sur parts rachetables » de l'état de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables comprennent les transferts hors trésorerie entre les séries. Ces transactions sont exclues du poste « Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement » du tableau des flux de trésorerie.

La Norme comptable internationale (IAS) 32 *Instruments financiers* : *Présentation* établit les exigences comptables régissant la présentation des instruments financiers, particulièrement leur classement en tant qu'actifs financiers, passifs financiers ou instruments de capitaux propres. L'obligation des Fonds à l'égard des rachats de parts rachetables en circulation comporte l'obligation de distribuer tout revenu net et toute plus-value nette réalisée au moins une fois par année, en trésorerie (à la demande du porteur de parts). L'obligation de rachat permanente n'est donc pas la seule obligation contractuelle attachée aux parts. Par conséquent, les parts rachetables en circulation des Fonds sont classées comme passifs financiers, conformément aux exigences d'IAS 32.

Vous trouverez ci-dessous un sommaire du cours de clôture et de la juste valeur de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables des séries FNB à la clôture de la période.

	Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada) (série FNB)		Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada) (série FNB)		Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada) (série FNB)	
	Au 31 décembre 2023	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2023	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2023	Au 31 décembre 2022
Cours de clôture	16,61 \$	16,22 \$	19,11 \$	19,03 \$	18,76 \$	18,83 \$
Juste valeur de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, au cours de clôture	14 118 500 \$	16 220 000 \$	37 264 500 \$	42 817 500 \$	12 194 000 \$	26 362 000 \$

	Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence (série FNB)		Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base (série FNB)	
	Au 31 décembre 2023	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2023	Au 31 décembre 2022
Cours de clôture	18,13 \$	17,89 \$	18,19 \$	17,40 \$
Juste valeur de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, au cours de clôture	3 626 000 \$	2 683 500 \$	109 140 000 \$	85 260 000 \$

## 11. GESTION DU FONDS ET FRAIS DE GESTION

Les frais de gestion sont calculés et constatés quotidiennement, et ils sont payés mensuellement au gestionnaire en ce qui a trait aux parts de série A, de série F, de série M, de série O, de série FNB, de série A (\$ US), de série F (\$ US), de série M (\$ US) et de série O (\$ US). Les frais de gestion pour les parts de série I d'un Fonds sont négociés et versés directement par l'investisseur, et non par le Fonds, et ne dépasseront pas les frais de gestion de la série A du Fonds. Au nom des Fonds, le gestionnaire fournit ou procure des conseils de placement et des services d'administration, notamment des services de garde, de comptabilité, de fiducie, de conseils juridiques de routine, d'agent des transferts et d'impression de documents. Le gestionnaire paiera tous les coûts des activités d'un Fonds, sauf ceux d'emprunt, d'intérêts et d'exécution de portefeuille. Il ne paiera pas non plus les impôts et taxes, les frais du Comité d'examen indépendant (CEI), les charges extraordinaires, y compris les frais juridiques du Fonds et les nouvelles charges ou frais payables par un Fonds. Le gestionnaire, et non les porteurs de parts rachetables, se charge de régler tous les frais de sous-conseiller payables à PIMCO.

Chaque Fonds est tenu de payer la taxe sur les biens et services et la taxe de vente harmonisée, et pourrait également devoir payer la taxe de vente du Québec sur les frais de gestion et sur certains autres frais du Fonds, en fonction de la province ou du territoire de résidence de l'investisseur de chaque série du Fonds.

Chaque Fonds paie un montant proportionnel des honoraires versés aux membres du CEI chaque année et rembourse aux membres les frais engagés dans le cadre des services rendus à titre de membres du CEI. La part des honoraires et du remboursement des frais des membres du CEI, selon le cas, revenant à chaque Fonds est présentée dans les états financiers du Fonds.

Les taux annuels des frais de gestion pour les parts de série A, de série F, de série M, de série O, de série FNB, de série A (\$ US), de série F (\$ US), de série M (\$ US) et de série O (\$ US) sont les suivants (calculés sous forme de pourcentage de l'actif net quotidien moyen de chaque Fonds attribuable à chaque série) :

### Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO

Série A	1,00 %
Série F	0,50 %
Série M	0,46 %
Série O	0,96 %

### Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)

Série A	1,15 %
Série F	0,65 %

### Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)

Série A	1,35 %
Série F	0,85 %
Série M	0,82 %
Série O	1,30 %
Série A (\$ US)	1,35 %
Série F (\$ US)	0,85 %
Série M (\$ US)	0,82 %

### Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada)

Série A (\$ US)	1,25 %
Série F (\$ US)	0,75 %
Série M (\$ US)	0,60 %
Série O (\$ US)	1,10 %
Série A	1,25 %
Série F	0,75 %
Série M	0,60 %
Série O	1,10 %
Série FNB	0,75 %

### Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)

Série A	0,60 %
Série F	0,35 %
Série FNB	0,35 %
Série A (\$ US)	0,60 %
Série F (\$ US)	0,35 %

### Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)

Série A (\$ US)	1,25 %
Série F (\$ US)	0,75 %
Série M (\$ US)	0,60 %
Série O (\$ US)	1,10 %
Série A	1,25 %
Série F	0,75 %
Série M	0,60 %
Série O	1,10 %
Série FNB	0,75 %

### Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence

Série A	1,09 %
Série F	0,59 %
Série FNB	0,59 %

Série A (\$ US)	1,09 %
Série F (\$ US)	0,59 %
<b>Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base</b>	
Série A	1,09 %
Série F	0,59 %
Série FNB	0,59 %
Série A (\$ US)	1,09 %
Série F (\$ US)	0,59 %
<b>Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)</b>	
Série A	1,25 %
Série F	0,75 %
<b>Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)</b>	
Série A	1,25 %
Série F	0,75 %
<b>Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)</b>	
Série A (\$ US)	1,95 %
Série F (\$ US)	0,95 %
Série A	1,95 %
Série F	0,95 %

## 12. TRANSACTIONS ENTRE PARTIES LIÉES

Le gestionnaire est une partie liée, suivant la définition d'IAS 24 *Information relative aux parties liées*. Les frais payables à cette partie sont présentés à la note 11, « Gestion du Fonds et frais de gestion ». Les Fonds peuvent acheter ou vendre des titres à certains fonds ou portefeuilles affiliés s'ils respectent les conditions stipulées dans les procédures adoptées par le CEI. Les procédures ont été conçues pour réduire au minimum les conflits d'intérêts pouvant survenir en cas de vente ou d'achat de titres entre un Fonds et tout autre fonds commun de placement géré par PIMCO Canada. Pendant les exercices clos les 31 décembre 2023 et 31 décembre 2022, les Fonds ont acheté et vendu des titres à des Fonds affiliés (montants en milliers<sup>†</sup>) :

	Exercice clos le 31 décembre 2023		Exercice clos le 31 décembre 2022	
	Achats	Ventes	Achats	Ventes
Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)	0 USD	0 USD	3 621 USD	0 USD

<sup>†</sup> Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

## 13. COMMISSIONS DE COURTAGE ET RABAIS DE COURTAGE

Pour les exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022, les Fonds ont engagé les commissions de courtage suivantes (montants en milliers<sup>†</sup>) :

	Exercice clos le 31 décembre 2023	Exercice clos le 31 décembre 2022
Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO	49 \$	30 \$
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)	20 \$	27 \$
Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)	5 \$	8 \$
Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada)	1 USD	1 USD
Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)	3 \$	0 \$
Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)	4 USD	2 USD
Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)	1 \$	1 \$
Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)	1 \$	0 \$
Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)	38 USD	61 USD

<sup>†</sup> Un solde nul peut indiquer des montants réels arrondis inférieurs à mille.

Les accords de paiement indirect sont des accords en vertu desquels le conseiller obtient des produits ou services, mis à part l'exécution des opérations sur titres, de la part ou par l'intermédiaire d'une maison de courtage de valeurs, en échange desquels cette maison de courtage recevra des ordres de transactions du conseiller. Toutes les commissions de courtage engagées par les Fonds servent uniquement à payer l'exécution des ordres, et il n'existe aucun rabais de courtage.

## 14. IMPÔTS

Les Fonds sont des fiducies de fonds commun de placement au sens de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). Aux fins fiscales, tous les revenus nets et les gains en capital nets réalisés imposables sont payés ou deviendront à payer aux porteurs de parts durant l'année civile. Les Fonds ne sont donc pas assujettis à l'impôt de la partie I. Étant donné que les Fonds ne comptabilisent pas d'impôt, l'actif ou le passif d'impôt différé lié aux pertes en capital et autres qu'en capital et aux autres différences temporaires, n'a pas été reflété dans l'état de la situation financière.

Les pertes en capital réalisées des Fonds peuvent être indéfiniment reportées et utilisées pour réduire les gains en capital imposables futurs. Les pertes autres qu'en capital peuvent être reportées jusqu'à vingt ans en avant et utilisées pour réduire les revenus imposables ou les gains en capital imposables futurs. À la date de clôture de l'année d'imposition, le 15 décembre 2023, les Fonds avaient reporté les pertes en capital suivantes (montants en milliers) :

	15 décembre 2023
Fonds d'obligations à rendement total canadiennes PIMCO	73 691 \$
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO	2 380 \$
Fonds d'obligations sans contrainte PIMCO (Canada)	23 234 \$
Fonds de titres de qualité supérieure PIMCO (Canada)	88 895 USD
Fonds mondial courte échéance PIMCO (Canada)	37 236 \$
Fonds de revenu mensuel courte durée PIMCO (Canada)	49 718 USD
Portefeuille PIMCO géré d'obligations axées sur la prudence	3 597 \$
Portefeuille PIMCO géré d'obligations de base	15 323 \$
Fonds d'obligations climatiques PIMCO (Canada)	1 958 \$
Fonds de revenu ESG PIMCO (Canada)	2 128 \$
Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)	26 164 USD

À la date de clôture de l'année d'imposition, le 15 décembre 2023, les Fonds avaient reporté les pertes autres qu'en capital inutilisées suivantes (montants en milliers) :

	15 décembre 2023
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada)	2 225 \$

## Abréviations utilisées pour les contreparties :

<b>AZD</b>	Australia and New Zealand Banking Group	<b>GLM</b>	Goldman Sachs Bank USA	<b>NGF</b>	Nomura Global Financial Products, Inc.
<b>BOA</b>	Bank of America N.A.	<b>GST</b>	Goldman Sachs International	<b>PAR</b>	BNP Paribas (succursale de Londres)
<b>BOM</b>	Banque de Montréal	<b>HUS</b>	HSBC Bank USA N.A.	<b>RBC</b>	Banque Royale du Canada
<b>BPG</b>	BNP Paribas Securities Corp.	<b>IND</b>	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	<b>RYL</b>	NatWest Markets Plc
<b>BPS</b>	BNP Paribas S.A.	<b>JPM</b>	JP Morgan Chase Bank N.A.	<b>SCX</b>	Standard Chartered Bank, Londres
<b>BRC</b>	Barclays Bank PLC	<b>JPS</b>	J.P. Morgan Securities, LLC	<b>SSB</b>	State Street Bank and Trust Co.
<b>CBK</b>	Citibank N.A.	<b>MBC</b>	HSBC Bank Plc	<b>TDM</b>	TD Securities (USA) LLC
<b>CLY</b>	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	<b>MEI</b>	Merrill Lynch International	<b>TOR</b>	La Banque Toronto-Dominion
<b>DEU</b>	Deutsche Bank Securities, Inc.	<b>MYC</b>	Morgan Stanley Capital Services LLC	<b>UAG</b>	UBS AG, Stamford
<b>DUB</b>	Deutsche Bank AG	<b>MYI</b>	Morgan Stanley & Co. International PLC		

## Abréviations utilisées pour les monnaies :

<b>AUD</b>	Dollar australien	<b>GBP</b>	Livre sterling	<b>PLN</b>	Zloty polonais
<b>BRL</b>	Réal brésilien	<b>HUF</b>	Forint hongrois	<b>RUB</b>	Rouble russe
<b>CAD (ou \$)</b>	Dollar canadien	<b>IDR</b>	Roupie indonésienne	<b>SEK</b>	Couronne suédoise
<b>CHF</b>	Franc suisse	<b>ILS</b>	Shekel israélien	<b>SGD</b>	Dollar de Singapour
<b>CLP</b>	Peso chilien	<b>INR</b>	Roupie indienne	<b>THB</b>	Baht thaïlandais
<b>CNH</b>	Renminbi chinois (offshore)	<b>JPY</b>	Yen japonais	<b>TRY</b>	Nouvelle livre turque
<b>CNY</b>	Renminbi chinois (continental)	<b>KRW</b>	Won sud-coréen	<b>TWD</b>	Dollar de Taïwan
<b>COP</b>	Peso colombien	<b>MXN</b>	Peso mexicain	<b>USD</b>	Dollar américain
<b>DKK</b>	Couronne danoise	<b>MYR</b>	Ringgit malais	<b>ZAR</b>	Rand sud-africain
<b>EUR</b>	Euro	<b>NOK</b>	Couronne norvégienne		

## Abréviations utilisées pour les marchés boursiers :

<b>CBOE</b>	Chicago Board Options Exchange	<b>MSE</b>	Bourse de Montréal	<b>Hors cote</b>	Hors cote
<b>CBOT</b>	Chicago Board of Trade				

## Abréviations utilisées pour les indices/écarts :

<b>CAONREPO</b>	Taux des opérations de pension à un jour	<b>CNREPOFIX</b>	China Fixing Repo Rates 7-Day (taux des opérations de pension à 7 jours de la Chine)	<b>S&amp;P 500</b>	Indice Standard & Poor's 500
<b>CDX.EM</b>	Credit Derivatives Index – Emerging Markets (indice de dérivés de crédit – marchés émergents)	<b>CPURNSA</b>	Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index (indice désaisonnalisé des prix à la consommation pour l'ensemble des consommateurs urbains)	<b>SIBCSORA</b>	Singapore Overnight Rate Average (taux moyen au jour le jour de Singapour)
<b>CDX.HY</b>	Credit Derivatives Index – High Yield (indice de dérivés de crédit – rendement élevé)	<b>IXUTR</b>	Indice Utilities Select Sector Total Return (indice à rendement global services collectifs)	<b>SOFRRATE</b>	Taux de financement à un jour garanti
<b>CDX.IG</b>	Credit Derivatives Index – Investment Grade (indice de dérivés de crédit – catégorie investissement)	<b>MUTKCALM</b>	Taux moyen au jour le jour de Tokyo	<b>SONIO</b>	Taux interbancaire moyen au jour le jour en sterling

## Autres abréviations :

<b>TAA</b>	Titres adossés à des actifs	<b>EURIBOR</b>	Taux interbancaire offert en euros	<b>OIS</b>	Overnight Index Swap (swaps indexés sur le taux à un jour)
<b>ALT</b>	Alternate Loan Trust (fiducie de prêt alternatif)	<b>JIBAR</b>	Johannesburg Interbank Agreed Rate (taux interbancaire convenu à Johannesburg)	<b>TGC</b>	Rendement réinvesti
<b>BBR</b>	Bank Bill Rate (taux des acceptations bancaires)	<b>KLIBOR</b>	Taux interbancaire offert à Kuala Lumpur	<b>REMIC</b>	Real Estate Mortgage Investment Conduit (canalisateurs de placements en hypothèques immobilières)
<b>BBSW</b>	Bank Bill Swap Reference Rate (taux de référence des swaps d'acceptations bancaires)	<b>KORIBOR</b>	Taux interbancaire offert en Corée	<b>RMBS</b>	Residential Mortgage-Backed Security (titre adossé à des créances hypothécaires résidentielles)
<b>CDI</b>	Brazil Interbank Deposit Rate (taux des dépôts interbancaires du Brésil)	<b>LIBOR</b>	Taux interbancaire offert à Londres	<b>TBA</b>	To-Be-Announced (à déterminer)
<b>BTP</b>	Buoni del Tesoro Poliennali « Obligation du Trésor à longue échéance »	<b>MIBOR</b>	Taux interbancaire offert à Mumbai	<b>TBD</b>	To-Be-Determined (à déterminer)
<b>CHILIBOR</b>	Taux interbancaire offert au Chili	<b>NIBOR</b>	Taux interbancaire offert en Norvège	<b>% à déterminer</b>	Taux d'intérêt seront déterminés lorsque le prêt est réglé ou au moment du financement.
<b>TGP</b>	Titres garantis par des prêts	<b>OAT</b>	Obligations assimilables du Trésor	<b>TIIE</b>	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio (taux d'équilibre d'intérêt interbancaire)
<b>DAC</b>	Designated Activity Company (société à activité désignée)				

## Informations générales

---

### Gestionnaire (tous les Fonds) et fiduciaire [Fonds multiactifs diversifié PIMCO (Canada)]

PIMCO Canada Corp.  
199, rue Bay, bureau 2050  
Succursale Commerce Court  
C. P. 363  
Toronto (Ontario)  
M5L 1G2

### Sous-conseiller en valeurs

Pacific Investment Management Company LLC  
650 Newport Center Drive  
Newport Beach, California 92660  
USA

### Dépositaire et fiduciaire

State Street Trust Company Canada  
30, rue Adelaide Est  
Bureau 1100  
Toronto (Ontario)  
M5C 3G6

### Agent de transferts pour les parts de série FNB

State Street Trust Company Canada  
30, rue Adelaide Est  
Bureau 1100  
Toronto (Ontario)  
M5C 3G6

### Agent des transferts et agent comptable des registres

International Financial Data Services (Canada) Limited  
30, rue Adelaide Est  
Bureau 1  
Toronto (Ontario)  
M5C 3G9

### Auditeur

PricewaterhouseCoopers s.r.l./s.e.n.c.r.l.  
Tour PwC  
18, rue York  
Bureau 2500  
Toronto (Ontario)  
M5J 0B2

**Mise en garde concernant les énoncés prospectifs.** Le présent document peut contenir des énoncés prospectifs sur les Fonds (notamment en ce qui concerne le rendement, les stratégies, les risques, les perspectives, les conditions et les actions) et sur d'autres événements, résultats, circonstances et attentes futurs prévus. Les hypothèses ou les opinions soutenues quant à des événements futurs, comme les conditions du marché ou la conjoncture économique, le rendement d'un titre ou d'autres projections, constituent des « énoncés prospectifs ». Les énoncés prospectifs peuvent renfermer des déclarations qui sont de nature prédictive, qui font référence à des événements ou à des conditions futurs, ou qui dépendent de ceux-ci, ou qui incluent des termes comme « peut », « aura », « devrait », « prévoit », « anticipe », « a l'intention », « projette », « compte », « croit », « estime », « prédit », « suspecte », « potentiel » ou « continue », « prévision », « objectif », « préliminaire », « typique », et d'autres expressions similaires. Les énoncés prospectifs sont, par nature, assujettis à des risques, incertitudes et hypothèses, notamment, mais sans s'y limiter, à des facteurs économiques, politiques ou boursiers en Amérique du Nord et dans le monde entier, à des fluctuations de taux d'intérêt et de change, à la volatilité des marchés boursiers et financiers, à la concurrence commerciale, aux changements technologiques, à l'évolution des règlements gouvernementaux et des lois fiscales, aux démarches judiciaires ou réglementaires imprévues et aux catastrophes. Ce qui précède est par conséquent une liste non exhaustive des risques importants qui pourraient affecter les résultats futurs. Nous vous prions de ne pas vous fier aveuglément aux énoncés prospectifs. Les énoncés prospectifs ne garantissent pas les rendements futurs, et les événements réels pourraient différer grandement de ceux exprimés explicitement ou implicitement dans les énoncés prospectifs. Toutes les opinions contenues dans les énoncés prospectifs sont susceptibles de changer sans préavis. Elles sont fournies de bonne foi, mais n'engagent en aucun cas notre responsabilité juridique. Nous n'avons pas l'intention de mettre à jour les énoncés prospectifs, que ce soit en raison de nouvelles informations, d'événements futurs ou d'autres facteurs.

