



CONNOR, CLARK & LUNN

FONDS

ÉTATS FINANCIERS SEMESTRIELS (NON AUDITÉ)

30 juin 2023

- **Fonds mondial neutre au marché CC&L II**
- **Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L**
- **Fonds alternatif de revenu CC&L**
- **Fonds de rendement absolu PCJ II**

-
- Avis aux porteurs de parts : Connor, Clark & Lunn Funds Inc., le gestionnaire des Fonds, nomme un auditeur indépendant pour l'audit des états financiers annuels des Fonds. Conformément aux lois canadiennes sur les valeurs mobilières (Règlement 81-106), si les états financiers n'ont pas été examinés par un auditeur, ils doivent être accompagnés d'un avis en faisant état.
 - AVIS : L'auditeur indépendant des Fonds n'a pas effectué l'examen des présents états financiers semestriels conformément aux normes établies par les Comptables professionnels agréés du Canada.

TABLE DES MATIÈRES

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)	3
Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)	83
Fonds alternatif de revenu CC&L	161
Fonds de rendement absolu PCJ II.....	183
Notes annexes	199

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

États de la situation financière aux

	30 juin 2023 (non audité)	31 décembre 2022 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	7 932 822 \$	3 521 869 \$
Placements	21 682 174	26 093 492
Plus-value latente des contrats de change à terme	233 257	26 488
Plus-value latente des contrats de swap	310 539	335 931
Marge de variation quotidienne	1 696 009	1 669 874
Montant à recevoir du courtier	606 499	1 244 620
Dividendes à recevoir	42 906	34 215
Autres créances	17 128	264
Souscriptions à recevoir	97 000	–
	32 618 334	32 926 753
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	–	3 261 019
Placements vendus à découvert	14 420 207	7 238 990
Moins-value latente des contrats de change à terme	31 918	2 663
Moins-value latente des contrats de swap	578 351	380 013
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	41 076	9 685
Montant à payer au courtier	628 726	1 168 917
Frais d'emprunt de titres à payer	–	8 523
Charges à payer	18 340	63 129
Frais de gestion à payer	4 162	1 370
Rémunération au rendement à payer	–	6 944
Rachats à payer	–	2 400
	15 722 780	12 143 653
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	16 895 554 \$	20 783 100 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	212 182 \$	146 875 \$
Série F	5 702 229 \$	1 930 574 \$
Série I	10 981 143 \$	18 705 651 \$
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	19 672	14 220
Série F	527 951	187 498
Série I	1 019 639	1 833 972
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	10,79 \$	10,33 \$
Série F	10,80 \$	10,30 \$
Série I	10,77 \$	10,20 \$

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

« Tim Elliott »

Administrateur

Administrateur

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2023	2022
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	(208 472) \$	1 311 \$
Variation du gain (perte) de change latent	(224 677)	(33 937)
Charges d'intérêts négatives	—	(10 968)
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	1 205	887
Autres revenus (pertes)	7 475	504
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	320 135	393 102
Charges de dividendes sur les titres vendus à découvert	(159 168)	(90 170)
Intérêts aux fins des distributions	156 125	2 212
Gain (perte) net réalisé sur les placements	1 315 531	(746 970)
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	22 408	686 876
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	534 436	(46 739)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	(26 586)	45 815
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	(120 935)	(7 286)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	568 502	(5 632 007)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	(781 685)	1 187 106
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	177 514	3 100
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	(223 730)	(87 924)
Gain (perte) net total sur placements	1 782 547	(4 292 885)
Total des revenus (pertes) nets	1 358 078	(4 335 088)
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	8 132	13 191
Honoraires des dépositaires	27 457	36 511
Frais de dépôt	12 390	22 251
Honoraires du comité d'examen indépendant	2 232	2 480
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	—	321
Charges d'intérêts	109 442	10 442
Frais de gestion	15 525	10 951
Rémunération au rendement	6 840	6 549
Coût d'emprunt de titres	35 945	58 058
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	5 558	4 388
Coûts d'opérations (note 9)	27 694	36 316
Total des charges d'exploitation	251 215	201 458
Retenues d'impôts (note 7)	(47 351)	(51 935)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 059 512 \$	(4 588 481) \$

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2023	2022
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	6 304 \$	(30 058) \$
Série F	88 015 \$	(656 979) \$
Série I	965 193 \$	(3 901 444) \$
	<hr/>	<hr/>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	15 920	13 799
Série F	306 814	304 154
Série I	1 389 111	1 785 020
	<hr/>	<hr/>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	0,40 \$	(2,18) \$
Série F	0,29 \$	(2,16) \$
Série I	0,69 \$	(2,19) \$
	<hr/>	<hr/>

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série A 2023	Série A 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	146 875 \$	164 703 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	6 304	(30 058)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	59 200	15 000
Rachat de parts rachetables	(197)	(13 662)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	59 003	1 338
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	65 307	(28 720)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	212 182 \$	135 983 \$
	Série F 2023	Série F 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	1 930 574 \$	3 922 852 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	88 015	(656 979)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	4 616 423	242 732
Rachat de parts rachetables	(932 783)	(645 793)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	3 683 640	(403 061)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	3 771 655	(1 060 040)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	5 702 229 \$	2 862 812 \$

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série I 2023	Série I 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	18 705 651 \$	24 130 695 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	965 193	(3 901 444)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	–	591
Rachat de parts rachetables	(8 689 701)	(3 004 184)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(8 689 701)	(3 003 593)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(7 724 508)	(6 905 037)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	10 981 143 \$	17 225 658 \$
	Total 2023	Total 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	20 783 100 \$	28 218 250 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 059 512	(4 588 481)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	4 675 623	258 323
Rachat de parts rachetables	(9 622 681)	(3 663 639)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(4 947 058)	(3 405 316)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(3 887 546)	(7 993 797)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	16 895 554 \$	20 224 453 \$

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2023	2022
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 059 512 \$	(4 588 481) \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	224 677	33 937
(Gain) perte net réalisé sur les placements	(1 315 531)	746 970
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	(22 408)	(686 876)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	(568 502)	5 632 007
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	781 685	(1 187 106)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	(177 514)	(3 100)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	223 730	87 924
Achat de placements	(77 485 520)	(67 843 094)
Produit de la vente de placements	90 300 741	72 662 646
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	(26 135)	263 209
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(8 691)	(39 775)
(Augmentation) diminution des autres créances	(16 864)	-
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	(8 523)	4 643
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	31 391	20 261
Augmentation (diminution) des charges à payer	(44 789)	(7 549)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	2 792	(232)
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	(6 944)	(10 957)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	12 943 107	5 084 427
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables	4 578 623	258 323
Rachat de parts rachetables	(9 625 081)	(3 663 639)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(5 046 458)	(3 405 316)
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	7 896 649	1 679 111
Variation du gain (perte) de change latent	(224 677)	(33 937)
Trésorerie, à l'ouverture de la période	3 521 869	551 929
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	(3 261 019)	(2 385 832)
	7 932 822	(188 729)
Trésorerie, à la clôture de la période	7 932 822 \$	2 635 658 \$
Dette bancaire, à la clôture de la période	- \$	(2 824 387) \$
	7 932 822 \$	(188 729) \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	264 175 \$	301 483 \$
Dividendes payés*	127 777	69 909
Intérêts reçus*	156 125	2 212
Intérêts payés*	109 442	10 442

* Inclus dans les activités d'exploitation.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Actions canadiennes – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 1,95 %)				
Athabasca Oil Corp.	5 300	10 575	15 211	
Baytex Energy Corp., TSE	700	3 861	3 024	
Birchcliff Energy Ltd.	100	754	784	
Cardinal Energy Ltd.	3 400	15 759	22 372	
Crew Energy Inc.	800	3 396	4 352	
Ensign Energy Services Inc.	400	1 194	756	
Gear Energy Ltd.	800	952	768	
Parex Resources Inc.	2 300	36 746	61 088	
Secure Energy Services Inc.	2 702	13 462	17 131	
Corporation TC Énergie, TSE	300	15 939	16 062	
Tourmaline Oil Corp.	900	54 907	56 178	
Whitecap Resources Inc.	4 600	33 118	42 642	
Yangarra Resources Ltd.	600	1 667	990	
		192 330	241 358	1,43
Matières premières (31 décembre 2022 : 1,84 %)				
Aris Mining Corp.	1 000	5 723	3 190	
Cascades inc.	600	8 028	7 014	
Centerra Gold Inc.	3 600	33 655	28 584	
GoldMining Inc.	500	887	600	
Interfor Corp.	600	21 838	14 988	
Karora Resources Inc.	200	897	810	
Labrador Iron Ore Royalty Corp.	900	32 341	27 972	
Neo Performance Materials Inc.	100	1 032	820	
New Gold Inc.	2 600	4 473	3 744	
OceanaGold Corp.	6 985	15 809	18 231	
Orezone Gold Corp.	700	928	882	
Minière Osisko Inc.	800	3 074	2 576	
Silvercorp Metals Inc.	500	2 376	1 885	
Taseko Mines Ltd.	801	872	1 522	
Western Copper & Gold Corp.	200	401	408	
Wheaton Precious Metals Corp.	400	26 011	22 916	
		158 345	136 142	0,81
Industries (31 décembre 2022 : 1,71 %)				
ATS Corp.	1 200	54 804	73 140	
Canadien Pacifique Kansas City Limitée, TSE	1 400	145 323	149 800	
Civeo Corp.	31	697	799	
Dexterra Group Inc.	100	355	574	
Doman Building Materials Group Ltd.	400	2 706	2 620	
Magellan Aerospace Corp.	200	1 563	1 668	
NFI Group Inc. (NFI.CN)	200	3 306	2 284	
Thomson Reuters Corp.	96	16 180	17 171	
Waste Connections Inc.	100	18 665	18 933	
		243 599	266 989	1,58
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 0,26 %)				
Les Industries Dorel Inc., cat B	300	2 976	1 377	
Martinrea International Inc.	300	2 542	3 975	
Roots Corp.	200	586	618	
		6 104	5 970	0,04
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 0,30 %)				
Soins de santé (31 décembre 2022 : 0,11 %)				
Andlauer Healthcare Group Inc.	100	4 726	4 450	
Dentalcorp Holdings Ltd.	200	1 921	1 468	
Sienna Senior Living Inc.	1 237	18 299	14 250	
		24 946	20 168	0,12
Services financiers (31 décembre 2022 : 1,45 %)				
Brookfield Corp.	3 300	143 501	147 151	
Groupe Canaccord Genuity Inc.	100	803	835	
Banque canadienne de l'Ouest	200	4 905	4 944	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
CI Financial Corp.	2 700	63 157	40 608	
		212 366	193 538	1,15
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 0,71 %)				
Blackberry Ltd.	200	1 490	1 468	
Quarterhill Inc.	300	441	444	
Shopify Inc.	1 300	87 932	111 306	
		89 863	113 218	0,67
Services de communication (31 décembre 2022 : 0,67 %)				
Aimia Inc.	300	1 120	990	
Corus Entertainment Inc.	4 200	21 362	5 502	
Illumin Holdings Inc.	1 300	2 810	2 886	
MDF Commerce Inc.	100	398	349	
Québecor inc.	200	6 422	6 530	
TELUS Corp.	400	11 302	10 312	
		43 414	26 569	0,16
Services publics (31 décembre 2022 : 0,72 %)				
Boralex Inc.	100	3 867	3 607	
Brookfield Infrastructure Corp.	150	8 941	9 062	
Emera Inc.	300	16 737	16 368	
Fortis Inc.	1 100	61 775	62 799	
Northland Power Inc.	1 500	47 726	41 445	
Polaris Renewable Energy Inc.	100	1 831	1 425	
Superior Plus Corp.	400	4 664	3 796	
		145 541	138 502	0,82
Immobilier (31 décembre 2022 : 0,93 %)				
Allied Properties REIT	100	2 263	2 172	
Groupe Altus limitée	340	21 080	14 936	
FPI Granite	900	77 405	70 542	
InterRent REIT	700	9 111	8 974	
Killam Apartment REIT	900	18 678	15 894	
Minto Apartment REIT	100	1 475	1 502	
Morguard North American Residential Real Estate Investment	200	3 332	3 370	
		133 344	117 390	0,69
Total des actions canadiennes – position acheteur		1 249 852	1 259 844	7,47
Actions canadiennes – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2022 : -1,54 %)				
Canacol Energy Ltd.	(919)	(11 093)	(9 677)	
Computer Modelling Group Ltd.	(2 600)	(15 464)	(17 316)	
Denison Mines Corp.	(36 200)	(68 080)	(60 092)	
Energy Fuels Inc., NYSE	(9 631)	(76 686)	(79 523)	
Energy Fuels Inc., TSE	(1 900)	(18 584)	(15 637)	
Gibson Energy Inc.	(300)	(6 543)	(6 249)	
Headwater Exploration Inc.	(500)	(3 225)	(3 175)	
North American Construction Group Ltd.	(500)	(7 275)	(12 675)	
Corporation Parkland	(100)	(3 231)	(3 300)	
Pason Systems Inc.	(1 300)	(8 389)	(14 937)	
Pipestone Energy Corp.	(2 000)	(5 533)	(4 540)	
Shawcor Ltée	(2 000)	(10 485)	(38 320)	
Tamarack Valley Energy Ltd.	(5 100)	(18 231)	(16 371)	
Tidewater Midstream and Infrastructure Ltd.	(1 500)	(1 405)	(1 410)	
Total Energy Services Inc.	(300)	(2 246)	(2 637)	
Ur-Energy Inc.	(4 800)	(5 933)	(6 576)	
Vermilion Energy Inc., TSE	(7 500)	(138 597)	(123 900)	
		(401 000)	(416 335)	(2,46)
Matières premières (31 décembre 2022 : -1,75 %)				
Americas Gold & Silver Corp.	(7 200)	(21 892)	(3 348)	
Canfor Pulp Products Inc.	(500)	(4 627)	(1 020)	
Equinox Gold Corp.	(5 000)	(31 554)	(30 350)	
ERO Copper Corp.	(100)	(1 513)	(2 680)	
Fortuna Silver Mines Inc.	(6 000)	(30 365)	(25 860)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Galiano Gold Inc.	(2 300)	(2 030)	(1 840)	
K92 Mining Inc.	(500)	(2 985)	(2 875)	
Largo Inc.	(1 700)	(13 057)	(9 554)	
MAG Silver Corp.	(1 700)	(30 431)	(25 075)	
Major Drilling Group International Inc.	(2 100)	(19 646)	(19 194)	
Nevada Copper Corp.	(500)	(377)	(110)	
Northern Dynasty Minerals Ltd.	(23 800)	(24 164)	(7 140)	
Novagold Resources Inc.	(1 900)	(12 369)	(9 975)	
Orla Mining Ltd.	(2 500)	(11 102)	(13 900)	
Platinum Group Metals Ltd.	(600)	(1 492)	(1 128)	
Seabridge Gold Inc.	(200)	(3 173)	(3 194)	
SilverCrest Metals Inc.	(4 224)	(38 677)	(32 778)	
Skeena Resources Ltd.	(1 900)	(14 474)	(12 141)	
SSR Mining Inc.	(500)	(9 130)	(9 395)	
Stelco Holdings Inc.	(100)	(5 351)	(4 322)	
Triple Flag Precious Metals Corp.	(300)	(5 381)	(5 469)	
Wesdome Gold Mines Ltd.	(300)	(2 641)	(2 070)	
		(286 431)	(223 418)	(1,32)
Industries (31 décembre 2022 : -0,67 %)				
Ballard Power Systems Inc.	(2 500)	(15 921)	(14 500)	
CAE inc., TSE	(5 600)	(165 085)	(166 040)	
Chorus Aviation Inc.	(6 300)	(19 938)	(19 089)	
K-Bro Linen Inc.	(200)	(7 495)	(6 264)	
La Compagnie Électrique Lion	(4 500)	(12 166)	(11 025)	
Corporation Internationale Masonite	(105)	(12 648)	(14 233)	
PyroGenèse Canada Inc.	(2 398)	(8 963)	(2 206)	
Corporation Savaria	(400)	(5 808)	(6 760)	
Westport Fuel Systems Inc.	(60)	(1 176)	(611)	
Xebec Adsorption Inc.	(1 500)	(4 106)	(780)	
		(253 306)	(241 508)	(1,43)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -0,77 %)				
Bragg Gaming Group Inc.	(300)	(1 793)	(1 227)	
Canada Goose Holdings Inc.	(2 100)	(46 338)	(49 518)	
ElectraMeccanica Vehicles Corp.	(8 210)	(32 100)	(6 742)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.	(600)	(30 745)	(36 354)	
Pollard Banknote Ltd.	(100)	(1 804)	(2 580)	
		(112 780)	(96 421)	(0,57)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -0,41 %)				
Andrew Peller Ltée	(400)	(2 211)	(1 640)	
SunOpta Inc.	(700)	(6 421)	(6 202)	
		(8 632)	(7 842)	(0,05)
Soins de santé (31 décembre 2022 : -0,70 %)				
Aurora Cannabis Inc.	(39 000)	(37 349)	(27 300)	
Bausch Health Cos Inc.	(2 100)	(20 905)	(22 260)	
CannTrust Holdings Inc.	(1 600)	(4 665)	-	
Canopy Growth Corp.	(7 800)	(7 357)	(3 978)	
Chartwell résidences pour retraités	(100)	(1 298)	(947)	
Cronos Group Inc.	(9 100)	(53 121)	(23 751)	
Essa Pharma Inc.	(100)	(398)	(357)	
Extencare Inc.	(100)	(833)	(713)	
HLS Therapeutics Inc.	(100)	(1 007)	(576)	
Thérapeutique Knight Inc.	(3 000)	(15 158)	(14 820)	
Oncolytics Biotech Inc.	(1 000)	(1 983)	(3 490)	
Organigram Holdings Inc.	(6 900)	(6 327)	(3 450)	
SNDL Inc.	(25 710)	(88 727)	(46 608)	
Well Health Technologies Corp.	(5 100)	(26 429)	(24 225)	
		(265 557)	(172 475)	(1,02)
Services financiers (31 décembre 2022 : -0,10 %)				
ECN Capital Corp.	(305)	(914)	(814)	
La Banque Toronto-Dominion, TSE	(100)	(8 032)	(8 211)	
		(8 946)	(9 025)	(0,05)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -0,42 %)				
Converge Technology Solutions Corp.	(1 600)	(7 146)	(5 120)	
Dye & Durham Ltd.	(700)	(12 127)	(12 677)	
Hut 8 Mining Corp	(18 500)	(63 668)	(81 400)	
Lightspeed Commerce Inc.	(6 400)	(147 667)	(143 424)	
Sangoma Technologies Corp.	(100)	(599)	(498)	
Softchoice Corp.	(400)	(6 871)	(7 236)	
		(238 078)	(250 355)	(1,48)
Services de communication (31 décembre 2022 : -0,39 %)				
Enthusiast Gaming Holdings Inc.	(12 600)	(15 675)	(8 190)	
IMAX Corp.	(959)	(21 703)	(21 560)	
Groupe Stingray Inc.	(798)	(4 318)	(4 110)	
Telesat Corp.	(204)	(2 173)	(2 543)	
WildBrain Ltd.	(2 200)	(5 252)	(3 498)	
		(49 121)	(39 901)	(0,24)
Immobilier (31 décembre 2022 : -0,19 %)				
FPI Propriétés de Choix	(600)	(8 751)	(8 142)	
Fiducie d'impact Dream	(450)	(6 336)	(4 086)	
DREAM Unlimited Corp.	(500)	(11 350)	(10 315)	
European Residential REIT	(1 100)	(3 813)	(3 146)	
Morguard REIT	(100)	(553)	(542)	
Slate Office REIT	(200)	(410)	(396)	
Tricon Residential Inc	(3 000)	(31 406)	(35 040)	
True North Commercial REIT	(800)	(2 402)	(1 904)	
		(65 021)	(63 571)	(0,38)
Total des actions canadiennes – position vendeur				
		(1 688 872)	(1 520 851)	(9,00)
Actions américaines – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 5,56 %)				
Antero Midstream Corp.	2 092	28 999	32 111	
APA Corp.	645	30 580	29 164	
Arch Resources Inc.	44	8 919	6 565	
Baker Hughes Co.	3 934	153 522	164 550	
Berry Corp.	333	2 987	3 032	
Chevron Corp.	791	167 272	164 696	
Comstock Resources Inc.	100	1 540	1 535	
ConocoPhillips	454	61 221	62 244	
Denbury Inc.	7	803	799	
DT Midstream Inc.	15	987	984	
EnLink Midstream LLC	192	2 543	2 693	
EOG Resources Inc.	541	82 781	81 925	
Exxon Mobil Corp.	1 169	159 070	165 902	
Gran Tierra Energy Inc., NYSE	104	437	676	
Gran Tierra Energy Inc., TSE	330	6 761	2 138	
Helix Energy Solutions Group Inc.	696	6 398	6 797	
Hess Corp.	222	40 562	39 937	
Mammoth Energy Services Inc.	259	1 721	1 655	
Marathon Oil Corp.	114	3 312	3 473	
Murphy Oil Corp.	257	12 750	13 025	
Newpark Resources Inc.	289	1 677	2 000	
NOV Inc.	685	14 368	14 539	
Oil States International Inc.	351	2 865	3 470	
Ovintiv Inc.	100	5 075	5 042	
PHX Minerals Inc.	649	2 992	2 679	
Pioneer Natural Resources Co.	89	24 978	24 399	
SEACOR Marine Holdings Inc.	43	367	650	
SM Energy Co.	1 151	43 969	48 174	
Solaris Oilfield Infrastructure Inc.	140	1 959	1 543	
Uranium Energy Corp.	463	1 889	2 083	
US Silica Holdings Inc.	208	3 808	3 339	
		877 112	891 819	5,28

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Matières premières (31 décembre 2022 : 1,27 %)				
Alcoa Corp.	1 278	58 736	57 379	
Alto Ingredients Inc.	226	1 294	864	
Ascent Industries Co.	79	1 698	950	
Ashland Inc.	46	5 013	5 290	
Cabot Corp.	102	8 776	9 028	
FutureFuel Corp.	177	1 918	2 073	
Gold Resource Corp.	110	373	92	
HB Fuller Co.	15	1 253	1 419	
Hecla Mining Co.	161	1 091	1 097	
Materion Corp.	7	982	1 058	
McEwen Mining Inc.	30	343	286	
Newmont Corp.	100	5 511	5 648	
Olin Corp.	150	9 581	10 200	
PPG Industries Inc.	53	10 147	10 401	
Rayonier Advanced Materials Inc.	84	757	476	
RPM International Inc.	67	7 392	7 955	
Ryerson Holding Corp.	41	1 469	2 353	
Steel Dynamics Inc.	32	4 611	4 613	
TimkenSteel Corp.	38	988	1 085	
Worthington Industries Inc.	24	2 040	2 206	
		123 973	124 473	0,74
Industries (31 décembre 2022 : 4,04 %)				
Acuity Brands Inc.	207	45 526	44 669	
Alta Equipment Group Inc.	21	378	482	
American Superconductor Corp.	55	347	456	
Apogee Enterprises Inc.	14	731	879	
Applied Industrial Technologies Inc.	51	8 931	9 774	
Arcosa Inc.	71	6 979	7 119	
Armstrong World Industries Inc.	436	43 773	42 382	
Astronics Corp.	315	5 482	8 278	
Axon Enterprise Inc.	291	80 360	75 134	
Babcock & Wilcox Enterprises Inc.	212	1 748	1 655	
Beacon Roofing Supply Inc.	65	5 206	7 137	
BGSF Inc.	18	358	227	
Blue Bird Corp.	108	3 171	3 213	
BlueLinx Holdings Inc.	25	2 200	3 102	
Brady Corp.	23	1 450	1 448	
BrightView Holdings Inc.	50	367	475	
Cadre Holdings Inc.	74	2 265	2 135	
CH Robinson Worldwide Inc.	458	60 267	57 180	
Comfort Systems USA Inc.	68	13 197	14 775	
Commercial Vehicle Group Inc.	100	999	1 469	
Core & Main Inc.	548	17 235	22 726	
CoreCivic Inc.	217	3 348	2 702	
CSG Systems International Inc.	50	3 414	3 489	
Daseke Inc.	55	529	519	
Ducommun Inc.	34	2 080	1 960	
DXP Enterprises Inc.	15	714	723	
Eastern Co.	40	1 155	958	
EMCOR Group Inc.	195	42 179	47 679	
Emerson Electric Co.	3	332	359	
Encore Wire Corp.	80	18 094	19 682	
Ennis Inc.	93	2 655	2 508	
EnPro Industries Inc.	3	472	530	
Enviri Corp.	882	6 480	11 519	
Exponent Inc.	1	124	123	
Fluor Corp.	437	17 305	17 116	
Franklin Covey Co.	15	883	867	
Franklin Electric Co Inc.	36	4 511	4 902	
Frontier Group Holdings Inc.	1 566	20 332	20 038	
Generac Holdings Inc.	216	30 060	42 624	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
GEO Group Inc.	212	2 113	2 009	
GMS Inc.	54	5 012	4 945	
Gorman-Rupp Co.	71	2 360	2 709	
GXO Logistics Inc.	1	64	83	
H&E Equipment Services Inc.	34	1 778	2 058	
Hawaiian Holdings Inc.	67	866	955	
Heartland Express Inc.	52	1 135	1 129	
HEICO Corp.	92	21 102	21 540	
Heritage-Crystal Clean Inc.	8	353	400	
Hexcel Corp.	145	14 051	14 586	
HireRight Holdings Corp.	47	673	703	
HNI Corp.	69	2 585	2 573	
Jacobs Solutions Inc.	419	66 347	65 917	
Joby Aviation Inc.	163	1 396	2 213	
Kaman Corp.	200	6 311	6 439	
Kennametal Inc.	614	22 497	23 066	
L B Foster Co.	33	460	624	
Landstar System Inc.	9	2 186	2 293	
LSI Industries Inc.	286	4 982	4 753	
Lyft Inc.	4 363	66 963	55 366	
Manitowoc Co Inc.	16	353	399	
Masterbrand Inc.	1 234	14 477	18 990	
McGrath RentCorp	39	4 714	4 773	
Mercury Systems Inc.	17	704	778	
MillerKnoll Inc.	676	15 108	13 221	
Mistras Group Inc.	100	655	1 022	
Moog Inc.	207	25 814	29 700	
MRC Global Inc.	55	921	733	
Mueller Industries Inc.	296	29 198	34 186	
NL Industries Inc.	130	1 114	951	
Park Aerospace Corp.	63	1 123	1 150	
PGT Innovations Inc.	47	1 749	1 813	
Powell Industries Inc.	36	2 403	2 886	
Proto Labs Inc.	133	12 136	6 153	
Quad/Graphics Inc.	673	2 927	3 348	
Radiant Logistics Inc.	314	2 614	2 792	
Southwest Airlines Co.	9	358	431	
Spirit AeroSystems Holdings Inc.	728	25 012	28 119	
SPX Technologies Inc.	55	5 980	6 184	
Steelcase Inc.	156	1 523	1 592	
Sterling Infrastructure Inc.	209	8 290	15 432	
SunPower Corp.	2 093	35 994	27 142	
Terex Corp.	550	35 313	43 543	
Titan International Inc.	70	971	1 063	
TPI Composites Inc.	24	372	329	
Triumph Group Inc.	863	13 838	14 126	
Tutor Perini Corp.	41	363	388	
UniFirst Corp.	11	2 380	2 256	
Upwork Inc.	515	9 513	6 365	
V2X Inc.	25	1 449	1 640	
Wabash National Corp.	238	8 072	8 075	
Watsco Inc.	75	32 269	37 858	
Willis Lease Finance Corp.	29	777	1 502	
Woodward Inc.	132	18 496	20 770	
Zurn Elkay Water Solutions Corp.	1 024	29 412	36 436	
		1 025 263	1 073 520	6,35
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 6,99 %)				
2U Inc.	537	4 656	2 864	
Abercrombie & Fitch Co.	242	10 112	12 066	
ADT Inc.	1 384	13 752	11 043	
Allbirds Inc.	100	391	167	
Amazon.com Inc.	56	9 615	9 660	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
American Axle & Manufacturing Holdings Inc.	121	1 358	1 324	
Asbury Automotive Group Inc.	22	6 635	6 999	
AutoNation Inc.	122	22 820	26 574	
Barnes & Noble Education Inc.	302	990	504	
Beazer Homes USA Inc.	360	5 606	13 476	
BJ's Restaurants Inc.	11	461	463	
Bluegreen Vacations Holding Corp.	84	1 289	3 963	
Bowlero Corp.	175	2 659	2 695	
Boyd Gaming Corp.	20	1 753	1 836	
Brinker International Inc.	37	1 760	1 792	
Brunswick Corp.	205	21 677	23 502	
Build-A-Bear Workshop Inc.	104	3 340	2 948	
CarMax Inc.	984	97 588	108 983	
CarParts.com Inc.	752	4 445	4 229	
Carrols Restaurant Group Inc.	272	741	1 814	
Carter's Inc.	182	16 897	17 484	
Cheesecake Factory Inc.	35	1 541	1 602	
Chegg Inc.	832	15 378	9 776	
Chewy Inc.	1 445	66 618	75 470	
China Automotive Systems Inc.	2 116	14 466	13 776	
Coursera Inc.	255	4 340	4 393	
Dana Inc.	870	17 354	19 571	
Dave & Buster's Entertainment Inc.	533	25 843	31 428	
Dine Brands Global Inc.	81	7 125	6 220	
DraftKings Inc.	223	7 265	7 840	
Dream Finders Homes Inc.	67	1 407	2 180	
El Pollo Loco Holdings Inc.	125	1 972	1 451	
Etsy Inc.	877	123 093	98 188	
Expedia Group Inc.	21	2 939	3 040	
First Watch Restaurant Group Inc.	106	2 197	2 370	
Foot Locker Inc.	873	42 605	31 317	
Gap Inc.	4 291	51 540	50 705	
Graham Holdings Co.	3	2 341	2 269	
Green Brick Partners Inc.	39	1 627	2 931	
Group 1 Automotive Inc.	24	7 483	8 197	
H&R Block Inc.	79	3 258	3 332	
Hanesbrands Inc.	2 462	19 395	14 791	
Harley-Davidson Inc.	607	28 382	28 281	
Hibbett Inc.	4	362	192	
Installed Building Products Inc.	29	4 562	5 379	
Kandi Technologies Group Inc.	4 353	17 495	22 810	
Landsea Homes Corp.	312	2 891	3 856	
Leslie's Inc.	731	10 809	9 083	
LGI Homes Inc.	14	2 261	2 499	
Lithia Motors Inc.	74	22 645	29 778	
Macy's Inc.	1 882	38 288	39 970	
Malibu Boats Inc.	17	1 299	1 320	
MasterCraft Boat Holdings Inc.	19	754	771	
Mister Car Wash Inc.	65	833	830	
Modine Manufacturing Co.	34	1 469	1 486	
Motorcar Parts of America Inc.	45	392	461	
National Vision Holdings Inc.	262	7 576	8 421	
Newell Brands Inc.	992	11 848	11 420	
Noodles & Co.	174	1 431	778	
ODP Corp.	62	3 501	3 841	
Papa John's International Inc.	23	2 263	2 247	
Peloton Interactive Inc.	3 913	39 697	39 818	
Penn Entertainment Inc.	374	12 890	11 892	
Perdoceo Education Corp.	161	3 024	2 614	
PetMed Express Inc.	38	772	693	
Planet Fitness Inc.	144	12 685	12 850	
PlayAGS Inc.	452	3 211	3 379	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Polaris Inc.	440	66 026	70 409	
Potbelly Corp.	389	5 498	4 519	
Qurate Retail Inc.	1 562	7 449	2 046	
Revolve Group Inc.	382	13 577	8 290	
Sabre Corp.	232	1 848	979	
Service Corp. International/US	25	2 142	2 137	
Smith & Wesson Brands Inc.	110	1 921	1 898	
Sonos Inc.	1 419	29 520	30 663	
Standard Motor Products Inc.	61	2 944	3 029	
Steven Madden Ltd.	330	14 152	14 275	
Sturm Ruger & Co Inc.	35	2 544	2 453	
TopBuild Corp.	38	10 495	13 376	
Universal Technical Institute Inc.	141	1 212	1 289	
Vacasa Inc.	192	417	172	
Vail Resorts Inc.	11	3 616	3 665	
VF Corp.	1 892	56 159	47 793	
Wayfair Inc.	1 160	98 070	99 788	
Wendy's Co.	119	3 424	3 425	
Williams-Sonoma Inc.	386	61 305	63 918	
Wingstop Inc.	56	14 945	14 832	
Winnebago Industries Inc.	60	5 018	5 295	
Xperi Inc.	77	1 107	1 340	
		1 283 061	1 285 493	7,61
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 5,22 %)				
BellRing Brands Inc.	24	1 169	1 162	
Boston Beer Co Inc.	21	9 249	8 571	
Celsius Holdings Inc.	604	104 463	119 238	
Duckhorn Portfolio Inc.	281	5 228	4 823	
Elf Beauty Inc.	591	59 037	89 332	
Estee Lauder Cos Inc.	624	180 965	162 151	
Grocery Outlet Holding Corp.	396	15 505	16 040	
Hostess Brands Inc.	415	13 869	13 904	
Ingles Markets Inc.	72	8 671	7 874	
Inter Parfums Inc.	4	838	716	
Medifast Inc.	19	2 139	2 317	
MGP Ingredients Inc.	4	551	563	
National Beverage Corp.	28	1 959	1 791	
Nature's Sunshine Products Inc.	28	357	506	
Nu Skin Enterprises Inc.	28	1 486	1 230	
Oil-Dri Corp. of America	65	2 192	5 074	
PriceSmart Inc.	16	1 551	1 568	
Sprouts Farmers Market Inc.	940	43 313	45 687	
Target Corp.	775	138 485	135 265	
United Natural Foods Inc.	189	5 005	4 889	
Village Super Market Inc.	140	4 215	4 227	
Vita Coco Co Inc.	41	1 269	1 458	
		601 516	628 386	3,72
Soins de santé (31 décembre 2022 : 12,34 %)				
23andMe Holding Co.	276	972	639	
4D Molecular Therapeutics Inc.	37	942	885	
89bio Inc.	849	17 953	21 289	
ABIOMED Inc., droits	13	-	-	
Acadia Healthcare Co Inc.	475	47 095	50 057	
ACADIA Pharmaceuticals Inc.	1 040	26 580	32 959	
Aclaris Therapeutics Inc.	168	1 847	2 305	
ADMA Biologics Inc.	1 080	4 585	5 273	
Adverum Biotechnologies Inc.	573	1 465	1 206	
Agios Pharmaceuticals Inc.	249	13 315	9 331	
Akero Therapeutics Inc.	106	6 238	6 549	
Alignment Healthcare Inc.	315	2 986	2 397	
Alphatec Holdings Inc.	739	16 510	17 582	
Alpine Immune Sciences Inc.	120	1 315	1 632	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Altimune Inc.	158	1 145	738	
Amicus Therapeutics Inc.	1 117	17 185	18 564	
AMN Healthcare Services Inc.	405	52 829	58 479	
Amneal Pharmaceuticals Inc.	1 575	4 928	6 461	
AngioDynamics Inc.	316	4 566	4 361	
Annexon Inc.	204	1 133	950	
Apellis Pharmaceuticals Inc.	522	46 970	62 926	
Arcturus Therapeutics Holdings Inc.	152	5 558	5 768	
Arvinas Inc.	47	2 488	1 544	
Assertio Holdings Inc.	843	5 597	6 046	
Astria Therapeutics Inc.	229	3 839	2 524	
Atea Pharmaceuticals Inc.	109	718	539	
AtriCure Inc.	183	10 563	11 953	
Axonics Inc.	340	26 467	22 707	
Azenta Inc.	20	1 129	1 235	
BioCryst Pharmaceuticals Inc.	690	8 553	6 428	
Brookdale Senior Living Inc.	719	3 461	4 015	
C4 Therapeutics Inc.	893	4 942	3 250	
CareDx Inc.	222	6 704	2 497	
Caribou Biosciences Inc.	119	698	669	
Castle Biosciences Inc.	280	9 505	5 083	
Chemed Corp.	1	652	717	
Chimerix Inc.	980	3 330	1 569	
Cidara Therapeutics Inc.	247	389	369	
Citius Pharmaceuticals Inc.	1	2	2	
Clover Health Investments Corp.	8 333	11 421	9 892	
Cogent Biosciences Inc.	283	3 573	4 434	
Collegium Pharmaceutical Inc.	153	5 624	4 351	
Compass Therapeutics Inc.	234	1 246	985	
CONMED Corp.	37	6 426	6 653	
Corcept Therapeutics Inc.	1 373	40 860	40 424	
Corvus Pharmaceuticals Inc.	138	415	418	
Cross Country Healthcare Inc.	19	643	706	
Cymabay Therapeutics Inc.	611	4 739	8 853	
Cytokinetics Inc.	218	11 097	9 410	
CytomX Therapeutics Inc.	1 070	2 639	2 435	
Deciphera Pharmaceuticals Inc.	135	3 245	2 515	
Definitive Healthcare Corp.	430	6 324	6 259	
Dyne Therapeutics Inc.	25	377	372	
Elanco Animal Health Inc.	2 541	32 725	33 825	
Embecta Corp.	129	5 497	3 687	
Enovis Corp.	389	27 988	33 005	
Envista Holdings Corp.	543	26 547	24 315	
EQRx Inc.	538	1 555	1 324	
Erasca Inc.	740	2 816	2 703	
Esperion Therapeutics Inc.	861	5 580	1 584	
Eton Pharmaceuticals Inc.	65	358	300	
Exact Sciences Corp.	404	38 066	50 198	
Exelixis Inc.	2 073	51 532	52 420	
Flexion Therapeutics Inc., droits	54	-	-	
Galectin Therapeutics Inc.	131	360	250	
Glaukos Corp.	284	21 733	26 761	
Globus Medical Inc.	45	3 355	3 545	
GoodRx Holdings Inc.	3 000	25 367	21 913	
Gossamer Bio Inc.	370	1 807	588	
Haemonetics Corp.	47	5 341	5 295	
Halozyme Therapeutics Inc.	507	28 394	24 199	
Harrow Health Inc.	45	1 388	1 134	
HealthStream Inc.	12	366	390	
Hims & Hers Health Inc.	1 566	21 837	19 479	
Homology Medicines Inc.	100	773	117	
Humana Inc.	61	36 030	36 091	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ideaya Biosciences Inc.	132	3 424	4 105	
Illumina Inc.	100	28 475	24 809	
ImmunoGen Inc.	2 011	26 334	50 214	
Immunovant Inc.	301	7 283	7 556	
Inari Medical Inc.	152	12 710	11 694	
Incyte Corp.	718	66 271	59 143	
Innoviva Inc.	838	12 697	14 116	
Insmid Inc.	513	13 989	14 323	
Integer Holdings Corp.	28	3 206	3 283	
Integra LifeSciences Holdings Corp.	53	2 852	2 885	
Intercept Pharmaceuticals Inc.	319	8 396	4 669	
Intra-Cellular Therapies Inc.	292	24 994	24 466	
Ionis Pharmaceuticals Inc.	939	47 161	50 981	
IQVIA Holdings Inc.	187	49 188	55 618	
iRadimed Corp.	100	5 331	6 317	
iRhythm Technologies Inc.	114	15 641	15 737	
Ironwood Pharmaceuticals Inc.	479	7 009	6 744	
Karuna Therapeutics Inc.	127	33 937	36 442	
Karyopharm Therapeutics Inc.	162	539	384	
Kodiak Sciences Inc.	222	1 307	2 027	
KORU Medical Systems Inc.	100	533	457	
Kronos Bio Inc.	397	1 220	904	
Krystal Biotech Inc.	12	1 522	1 864	
Lantheus Holdings Inc.	285	37 129	31 648	
Larimar Therapeutics Inc.	189	1 202	783	
Lexicon Pharmaceuticals Inc.	236	722	715	
Madrigal Pharmaceuticals Inc.	100	33 038	30 567	
MannKind Corp.	633	3 425	3 409	
Marinus Pharmaceuticals Inc.	31	355	445	
Medpace Holdings Inc.	99	26 481	31 462	
Merit Medical Systems Inc.	17	1 865	1 881	
MiMedx Group Inc.	1 128	9 012	9 866	
Mirati Therapeutics Inc.	619	32 618	29 594	
Miram Pharmaceuticals Inc.	167	5 857	5 717	
Molina Healthcare Inc.	59	23 552	23 518	
Myriad Genetics Inc.	355	10 440	10 889	
Nektar Therapeutics	365	372	278	
Neurocrine Biosciences Inc.	153	21 530	19 092	
Nevro Corp.	162	8 105	5 449	
NextGen Healthcare Inc.	446	9 757	9 572	
NGM Biopharmaceuticals Inc.	237	1 616	812	
Nurix Therapeutics Inc.	217	3 321	2 869	
Nuvalent Inc.	7	376	391	
OPKO Health Inc.	1 853	5 118	5 321	
OraSure Technologies Inc.	266	2 444	1 763	
Organogenesis Holdings Inc.	74	265	325	
Orthofix Medical Inc.	131	3 206	3 131	
Owens & Minor Inc.	59	1 495	1 486	
Pacira BioSciences Inc.	44	2 549	2 333	
Patterson Cos Inc.	666	24 044	29 311	
PDL BioPharma Inc.	467	567	179	
Pediatrix Medical Group Inc.	505	9 736	9 496	
Penumbra Inc.	18	8 066	8 195	
Pfizer Inc.	388	18 694	18 832	
Pliant Therapeutics Inc.	12	357	288	
PMV Pharmaceuticals Inc.	100	1 091	828	
Point Biopharma Global Inc.	576	7 142	6 905	
Prestige Consumer Healthcare Inc.	174	14 209	13 683	
Protagonist Therapeutics Inc.	388	13 482	14 181	
Protalix BioTherapeutics Inc.	113	408	295	
Regeneron Pharmaceuticals Inc.	7	6 548	6 656	
Replimune Group Inc.	151	3 816	4 640	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Revance Therapeutics Inc.	195	8 596	6 531	
Rhythm Pharmaceuticals Inc.	181	4 370	3 949	
Sage Therapeutics Inc.	161	8 743	10 017	
Sarepta Therapeutics Inc.	41	7 142	6 213	
Savara Inc.	717	1 709	3 031	
Seer Inc.	56	394	316	
Select Medical Holdings Corp.	61	2 334	2 572	
Shockwave Medical Inc.	66	22 360	24 926	
Silk Road Medical Inc.	7	397	301	
Supernus Pharmaceuticals Inc.	73	3 317	2 904	
Tabula Rasa HealthCare Inc.	364	2 874	3 974	
Tactile Systems Technology Inc.	282	2 821	9 303	
Tandem Diabetes Care Inc.	296	17 858	9 612	
Teladoc Health Inc.	1 242	52 664	41 613	
TG Therapeutics Inc.	1 229	45 868	40 396	
TransMedics Group Inc.	133	13 132	14 780	
Traverse Therapeutics Inc.	874	25 394	17 764	
Treace Medical Concepts Inc.	45	1 439	1 523	
Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	408	24 741	24 905	
UnitedHealth Group Inc.	29	18 052	18 444	
Vanda Pharmaceuticals Inc.	199	2 008	1 735	
Varex Imaging Corp.	79	2 365	2 464	
Ventyx Biosciences Inc.	136	5 925	5 903	
Veracyte Inc.	295	8 901	9 942	
Vericel Corp.	177	7 607	8 799	
Viking Therapeutics Inc.	767	17 818	16 452	
Viridian Therapeutics Inc.	203	7 233	6 390	
Voyager Therapeutics Inc.	212	1 791	3 212	
Waters Corp.	52	20 141	18 340	
Y-mAbs Therapeutics Inc.	264	2 322	2 372	
Zimvie Inc.	78	861	1 159	
Zymeworks Inc.	114	1 387	1 303	
Zynex Inc.	100	1 912	1 269	
		1 875 703	1 890 285	11,19
Services financiers (31 décembre 2022 : 8,08 %)				
Allstate Corp.	540	84 159	77 915	
American Equity Investment Life Holding Co.	266	16 621	18 342	
American Financial Group Inc.	43	6 906	6 757	
Ameris Bancorp	6	376	272	
Bank of Hawaii Corp.	23	1 270	1 255	
Bank OZK	728	33 715	38 687	
Block Inc.	895	96 019	78 839	
BRP Group Inc.	164	6 366	5 378	
Charles Schwab Corp.	573	41 644	42 976	
Cincinnati Financial Corp.	438	65 110	56 405	
Citizens Financial Group Inc.	352	12 109	12 148	
Civista Bancshares Inc.	100	2 921	2 302	
CNA Financial Corp.	91	5 445	4 650	
CNB Financial Corp.	12	357	280	
Coinbase Global Inc.	1 048	82 457	99 222	
Commerce Bancshares Inc.	16	1 062	1 031	
Community Bank System Inc.	16	980	993	
Crawford & Co., cat. A	74	773	1 086	
CVB Financial Corp.	688	13 116	12 090	
Donnelley Financial Solutions Inc.	7	400	422	
Eagle Bancorp Inc.	25	940	700	
eHealth Inc.	78	1 303	830	
Employers Holdings Inc.	21	1 228	1 040	
Enova International Inc.	20	1 308	1 406	
ESSA Bancorp Inc.	14	369	277	
Evans Bancorp Inc.	100	3 236	3 299	
EZCORP Inc.	76	887	843	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Fidelity National Financial Inc.	116	5 526	5 526	
First American Financial Corp.	67	5 047	5 055	
First Horizon Corp.	2 369	33 040	35 329	
FNB Corp.	108	1 729	1 635	
Globe Life Inc.	231	34 436	33 507	
Green Dot Corp.	51	1 144	1 265	
Hanover Insurance Group Inc.	41	6 839	6 132	
Huntington Bancshares Inc.	3 479	56 226	49 626	
Kinsale Capital Group Inc.	4	1 694	1 981	
Lemonade Inc.	320	6 961	7 135	
Lincoln National Corp.	524	17 014	17 861	
Loews Corp.	468	36 098	36 773	
M&T Bank Corp.	420	69 178	68 781	
Macatawa Bank Corp.	444	6 439	5 452	
Marqeta Inc.	178	1 137	1 147	
Medallion Financial Corp.	97	827	1 015	
Mercury General Corp.	61	2 452	2 443	
MetLife Inc.	81	5 786	6 059	
NerdWallet Inc.	107	2 087	1 332	
NMI Holdings Inc.	214	6 313	7 312	
Northwest Bancshares Inc.	70	1 166	982	
OFG Bancorp	12	402	414	
Old Republic International Corp.	115	3 820	3 830	
OP Bancorp	100	1 545	1 115	
Payoneer Global Inc.	562	4 826	3 577	
PayPal Holdings Inc.	1 301	126 563	114 878	
Popular Inc.	714	54 686	57 179	
Principal Financial Group Inc.	325	32 312	32 615	
PROG Holdings Inc.	1	36	43	
Provident Financial Services Inc.	82	1 913	1 773	
Prudential Financial Inc.	789	95 280	92 105	
Remitly Global Inc.	474	10 610	11 804	
RLI Corp.	63	11 809	11 377	
Ryan Specialty Holdings Inc.	272	14 859	16 157	
Sculptor Capital Management Inc.	679	20 791	7 934	
Shore Bancshares Inc.	14	367	214	
Stewart Information Services Corp.	55	2 985	2 994	
Toast Inc.	4 418	114 529	131 946	
Truist Financial Corp.	419	17 429	16 827	
Trupanion Inc.	175	7 306	4 557	
Trustmark Corp.	28	808	783	
United Bankshares Inc.	594	23 782	23 321	
Universal Insurance Holdings Inc.	43	949	878	
Upstart Holdings Inc.	144	6 015	6 823	
US Bancorp	2 724	120 479	119 093	
Visa Inc.	180	54 145	56 564	
W R Berkley Corp.	523	41 473	41 219	
Western New England Bancorp Inc.	113	1 159	873	
Western Union Co.	1 775	26 586	27 551	
		1 579 680	1 554 237	9,20
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 16,02 %)				
8x8 Inc.	2 444	10 709	13 680	
ACM Research Inc.	22	358	381	
Adeia Inc.	77	1 072	1 122	
Advanced Micro Devices Inc.	1 118	177 808	168 517	
Alarm.com Holdings Inc.	195	12 749	13 335	
Allegro MicroSystems Inc.	319	16 460	19 054	
Altair Engineering Inc.	232	22 078	23 282	
American Software Inc.	41	671	570	
Amtech Systems Inc.	34	401	430	
Appfolio Inc.	3	579	683	
Apple Inc.	359	87 694	92 144	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
AppLovin Corp.	777	23 491	26 455	
Arlo Technologies Inc.	834	10 495	12 040	
Atlassian Corp.	675	131 903	149 886	
Autodesk Inc.	88	24 119	23 826	
Axcelis Technologies Inc.	85	17 342	20 620	
Bel Fuse Inc.	71	3 388	5 394	
Benchmark Electronics Inc.	113	3 540	3 862	
Box Inc.	184	7 092	7 153	
Braze Inc.	57	2 910	3 303	
Brightcove Inc., droits	137	1 164	727	
Calix Inc.	302	19 134	19 945	
Cerence Inc.	46	1 636	1 779	
CEVA Inc.	16	900	541	
Cirrus Logic Inc.	258	29 906	27 657	
Clear Secure Inc.	381	13 246	11 681	
Clearwater Analytics Holdings Inc.	30	630	630	
Cognex Corp.	386	25 646	28 613	
Cohu Inc.	240	12 121	13 199	
Computer Task Group Inc.	200	1 861	2 014	
Corsair Gaming Inc.	84	2 137	1 972	
Couchbase Inc.	201	4 214	4 208	
CPI Card Group Inc.	15	764	461	
CS Disco Inc.	150	1 338	1 632	
Daktronics Inc.	72	456	610	
DigitalOcean Holdings Inc.	363	18 274	19 281	
Diodes Inc.	33	3 871	4 039	
DocuSign Inc.	1 388	97 894	93 835	
Domo Inc.	56	998	1 086	
Dropbox Inc.	39	1 254	1 376	
Duolingo Inc.	238	43 800	45 016	
Evolv Technologies Holdings Inc.	126	977	1 000	
Extreme Networks Inc.	825	22 781	28 438	
F5 Inc.	64	11 577	12 386	
FormFactor Inc.	158	6 587	7 154	
Gitlab Inc.	454	28 809	30 704	
Guidewire Software Inc.	352	32 601	35 437	
Infinera Corp.	1 183	12 097	7 561	
Informatica Inc.	613	13 317	15 006	
Insight Enterprises Inc.	18	3 395	3 486	
Intapp Inc.	18	1 082	998	
Intel Corp.	3 663	143 971	162 085	
Intevac Inc.	364	2 473	1 806	
Itron Inc.	87	7 958	8 300	
Jamf Holding Corp.	168	4 383	4 339	
Keysight Technologies Inc.	38	8 247	8 420	
Lattice Semiconductor Corp.	386	44 832	49 070	
LiveRamp Holdings Inc.	163	6 087	6 160	
Lumentum Holdings Inc.	72	5 449	5 405	
Magnachip Semiconductor Corp.	15	366	222	
Methode Electronics Inc.	91	4 027	4 036	
Microsoft Corp.	198	87 242	89 222	
nCino Inc.	719	23 365	28 656	
NETGEAR Inc.	33	630	618	
nLight Inc.	54	1 056	1 102	
Nutanix Inc.	910	35 156	33 776	
NVIDIA Corp.	214	115 165	119 788	
Olo Inc.	196	1 765	1 675	
ON24 Inc.	329	3 929	3 535	
OneSpan Inc.	167	3 707	3 279	
Onto Innovation Inc.	40	5 629	6 165	
PagerDuty Inc.	736	28 399	21 893	
PCTEL Inc.	100	577	634	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
PDF Solutions Inc.	26	1 491	1 552	
Pegasystems Inc.	273	17 098	17 809	
Photronics Inc.	551	13 631	18 804	
Porch Group Inc.	19	601	35	
Procore Technologies Inc.	287	22 548	24 712	
Progress Software Corp.	5	373	384	
PTC Inc.	52	9 787	9 791	
Pure Storage Inc.	2 819	98 477	137 347	
Q2 Holdings Inc.	264	9 240	10 794	
Quantum Corp.	536	900	766	
Rapid7 Inc.	482	40 123	28 880	
Rimini Street Inc.	438	2 609	2 776	
RingCentral Inc.	891	40 010	38 589	
Riot Platforms Inc.	411	6 371	6 428	
Samsara Inc.	658	19 254	24 127	
Sanmina Corp.	66	4 828	5 264	
ScanSource Inc.	33	1 260	1 291	
SecureWorks Corp.	19	345	182	
SEMrush Holdings Inc.	100	1 286	1 266	
Semtech Corp.	145	4 803	4 885	
SmartRent Inc.	159	720	806	
Smartsheet Inc.	546	29 524	27 642	
Solo Brands Inc.	107	753	801	
Splunk Inc.	151	20 449	21 198	
Sprinklr Inc.	1 106	16 486	20 240	
Sprout Social Inc.	543	33 998	33 167	
Squarespace Inc.	271	9 501	11 310	
Super Micro Computer Inc.	196	41 804	64 644	
Teledyne Technologies Inc.	12	6 475	6 528	
Tenable Holdings Inc.	511	31 643	29 447	
Turtle Beach Corp.	64	954	987	
Upland Software Inc.	12	560	57	
Varonis Systems Inc.	835	29 941	29 446	
Veeco Instruments Inc.	93	2 545	3 160	
Vishay Intertechnology Inc.	361	12 448	14 044	
Vishay Precision Group Inc.	16	764	787	
Weave Communications Inc.	173	2 017	2 543	
Western Digital Corp.	1 305	66 044	65 499	
Wolfspeed Inc.	1 494	88 129	109 897	
Yext Inc.	830	14 683	12 422	
Zoom Video Communications Inc.	304	27 437	27 306	
Zscaler Inc.	40	7 916	7 744	
Zuora Inc.	959	10 804	13 921	
		2 254 369	2 407 673	14,25
Services de communication (31 décembre 2022 : 5,51 %)				
AdTheorent Holding Co Inc.	152	358	282	
Alphabet Inc., cat. A	1 016	168 270	160 926	
Angi Inc.	1 585	17 895	6 921	
Bandwidth Inc.	40	1 576	724	
DHI Group Inc.	647	4 830	3 279	
DISH Network Corp.	2 742	29 383	23 911	
Eventbrite Inc.	742	8 110	9 377	
Frontier Communications Parent Inc.	614	13 487	15 144	
Iridium Communications Inc.	345	28 567	28 359	
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	154	5 840	6 686	
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM, série C	1 899	89 359	82 245	
Liberty TripAdvisor Holdings Inc.	1 040	1 505	895	
Live Nation Entertainment Inc.	238	27 407	28 693	
Lumen Technologies Inc.	5 438	37 273	16 262	
NII Holdings Inc.	500	1 424	172	
Ooma Inc.	51	898	1 010	
Paramount Global	5 550	126 286	116 843	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Roku Inc.	1 690	134 708	143 032	
Shutterstock Inc.	105	6 859	6 762	
Snap Inc.	3 639	46 295	57 013	
Spok Holdings Inc.	435	5 171	7 650	
Telephone and Data Systems Inc.	128	2 045	1 394	
Walt Disney Co.	1 359	175 488	160 551	
Yelp Inc.	52	1 943	2 505	
		934 977	880 636	5,21
Services publics (31 décembre 2022 : 0,88 %)				
AES Corp.	2 055	63 362	56 370	
Consolidated Edison Inc.	69	8 204	8 254	
Constellation Energy Corp.	18	2 169	2 181	
Energy Vault Holdings Inc.	248	712	896	
Global Water Resources Inc.	100	1 541	1 678	
National Fuel Gas Co.	5	349	340	
NRG Energy Inc.	2 588	122 017	128 044	
ONE Gas Inc.	166	17 895	16 872	
Otter Tail Corp.	79	7 668	8 254	
PPL Corp.	137	4 751	4 797	
Sempra Energy	125	24 291	24 081	
Spire Inc.	14	1 162	1 175	
Sunnova Energy International Inc.	316	7 883	7 656	
UGI Corp.	1 287	51 871	45 930	
		313 875	306 528	1,81
Immobilier (31 décembre 2022 : 1,79 %)				
Anywhere Real Estate Inc.	1 065	7 907	9 414	
Extra Space Storage Inc.	290	59 474	57 120	
Medical Properties Trust Inc.	2 889	36 135	35 400	
Outfront Media Inc.	263	5 541	5 471	
RE/MAX Holdings Inc.	102	2 601	2 600	
Redfin Corp.	59	1 069	970	
Uniti Group Inc.	411	1 869	2 513	
Zillow Group Inc.	2 287	138 365	152 099	
		252 961	265 587	1,57
Total des actions américaines – position acheteur		11 122 490	11 308 637	66,93
Actions américaines – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2022 : -1,45 %)				
Amplify Energy Corp.	(80)	(725)	(717)	
Cactus Inc.	(262)	(13 599)	(14 672)	
Centrus Energy Corp.	(16)	(695)	(688)	
Clean Energy Fuels Corp.	(733)	(4 358)	(4 811)	
CONSOL Energy Inc.	(49)	(4 461)	(4 397)	
Core Laboratories Inc.	(219)	(6 760)	(6 738)	
Delek US Holdings Inc.	(2)	(70)	(63)	
Diamond Offshore Drilling Inc.	(667)	(9 737)	(12 568)	
Dril-Quip Inc.	(36)	(1 367)	(1 109)	
Earthstone Energy Inc.	(945)	(16 486)	(17 869)	
Enviva Inc.	(1 816)	(27 087)	(26 073)	
Gevo Inc.	(2 202)	(6 639)	(4 429)	
Gulfport Energy Corp.	(48)	(5 654)	(6 674)	
Liberty Energy Inc.	(2 800)	(48 483)	(49 537)	
New Fortress Energy Inc.	(260)	(9 365)	(9 213)	
NextDecade Corp.	(575)	(4 580)	(6 247)	
Nine Energy Service Inc.	(242)	(1 819)	(1 226)	
Oceaneering International Inc.	(67)	(1 532)	(1 658)	
Patterson-UTI Energy Inc.	(669)	(11 404)	(10 596)	
PBF Energy Inc.	(1 136)	(55 132)	(61 541)	
Permian Resources Corp.	(2 560)	(33 945)	(37 127)	
REX American Resources Corp.	(100)	(4 260)	(4 606)	
Ring Energy Inc.	(434)	(1 083)	(982)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Select Water Solutions Inc.	(193)	(1 733)	(2 069)	
Southwestern Energy Co.	(14 943)	(99 933)	(118 837)	
Talos Energy Inc.	(1 468)	(26 301)	(26 943)	
Tellurian Inc.	(4 925)	(9 667)	(9 189)	
TETRA Technologies Inc.	(103)	(539)	(461)	
Tidewater Inc.	(148)	(9 075)	(10 857)	
Vertex Energy Inc.	(743)	(5 866)	(6 145)	
Vital Energy Inc.	(22)	(1 234)	(1 314)	
W&T Offshore Inc.	(1 181)	(6 610)	(6 048)	
		(430 199)	(465 404)	(2,75)
Matières premières (31 décembre 2022 : -0,29 %)				
Albemarle Corp.	(63)	(17 051)	(18 598)	
Alpha Metallurgical Resources Inc.	(107)	(22 825)	(23 271)	
American Vanguard Corp.	(201)	(5 912)	(4 753)	
Amyris Inc.	(2 074)	(7 163)	(2 827)	
Aspen Aerogels Inc.	(264)	(2 227)	(2 756)	
Avery Dennison Corp.	(196)	(45 313)	(44 557)	
Balchem Corp.	(85)	(15 370)	(15 163)	
Carpenter Technology Corp.	(36)	(2 401)	(2 674)	
Century Aluminum Co.	(429)	(5 810)	(4 950)	
CF Industries Holdings Inc.	(803)	(76 288)	(73 763)	
Flotek Industries Inc.	(1 424)	(2 186)	(1 383)	
Kaiser Aluminum Corp.	(169)	(17 341)	(16 021)	
Livent Corp.	(928)	(26 972)	(33 683)	
Loop Industries Inc.	(754)	(2 556)	(3 213)	
LSB Industries Inc.	(25)	(351)	(326)	
Mosaic Co.	(550)	(29 497)	(25 472)	
NewMarket Corp.	(1)	(498)	(532)	
Nucor Corp.	(8)	(1 639)	(1 736)	
Piedmont Lithium Inc.	(64)	(4 897)	(4 887)	
PureCycle Technologies Inc.	(1 989)	(18 116)	(28 135)	
Ramaco Resources Inc., cat. A	(82)	(826)	(916)	
Ramaco Resources Inc., cat. B	(16)	(186)	(225)	
Ranpak Holdings Corp.	(264)	(1 474)	(1 579)	
Scotts Miracle-Gro Co.	(313)	(29 477)	(25 965)	
Sensient Technologies Corp.	(25)	(2 547)	(2 353)	
Sylvamo Corp.	(108)	(6 921)	(5 781)	
		(345 844)	(345 519)	(2,05)
Industries (31 décembre 2022 : -0,93 %)				
AAR Corp.	(19)	(1 411)	(1 452)	
ACCO Brands Corp.	(50)	(420)	(345)	
Advanced Drainage Systems Inc.	(174)	(23 285)	(26 197)	
Ameresco Inc.	(74)	(4 632)	(4 762)	
American Airlines Group Inc.	(3 151)	(59 397)	(74 801)	
Avis Budget Group Inc.	(38)	(9 648)	(11 498)	
Blink Charging Co.	(826)	(10 592)	(6 547)	
Brink's Co.	(8)	(760)	(718)	
CACI International Inc.	(12)	(4 929)	(5 412)	
CBIZ Inc.	(28)	(1 877)	(1 974)	
ChargePoint Holdings Inc.	(1 305)	(14 168)	(15 179)	
Clean Harbors Inc.	(46)	(9 129)	(10 009)	
Crane Co.	(2)	(202)	(236)	
Crane NXT Co.	(219)	(14 648)	(16 356)	
Driven Brands Holdings Inc.	(324)	(11 280)	(11 601)	
Enovix Corp.	(607)	(12 224)	(14 490)	
FedEx Corp.	(333)	(102 962)	(109 235)	
FuelCell Energy Inc.	(3 407)	(14 795)	(9 738)	
Gibraltar Industries Inc.	(60)	(3 997)	(4 996)	
Griffon Corp.	(76)	(3 224)	(4 053)	
Hayward Holdings Inc.	(1 226)	(19 662)	(20 846)	
Huntington Ingalls Industries Inc.	(7)	(2 102)	(2 108)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Hyllion Holdings Corp.	(316)	(1 405)	(698)	
ICF International Inc.	(55)	(8 127)	(9 053)	
INNOVATE Corp.	(247)	(421)	(572)	
Innovative Solutions and Support Inc.	(100)	(1 201)	(949)	
JELD-WEN Holding Inc.	(152)	(2 560)	(3 528)	
JetBlue Airways Corp.	(2 379)	(22 651)	(27 891)	
Kadant Inc.	(47)	(12 971)	(13 813)	
Kelly Services Inc.	(100)	(2 166)	(2 330)	
Kforce Inc.	(88)	(7 467)	(7 296)	
Kirby Corp.	(44)	(4 202)	(4 480)	
Leidos Holdings Inc.	(337)	(38 779)	(39 456)	
Leonardo DRS Inc.	(733)	(13 449)	(16 819)	
Lindsay Corp.	(5)	(926)	(790)	
MasTec Inc.	(215)	(28 103)	(33 562)	
Mastech Digital Inc.	(100)	(1 822)	(1 307)	
Maximus Inc.	(166)	(17 831)	(18 563)	
Montrose Environmental Group Inc.	(20)	(799)	(1 115)	
National Presto Industries Inc.	(102)	(9 976)	(9 880)	
Northrop Grumman Corp.	(163)	(99 290)	(98 311)	
Oshkosh Corp.	(314)	(34 814)	(35 978)	
Otis Worldwide Corp.	(461)	(52 341)	(54 297)	
Owens Corning	(68)	(11 375)	(11 742)	
Paylocity Holding Corp.	(36)	(9 010)	(8 790)	
Performant Financial Corp.	(111)	(360)	(397)	
Plug Power Inc.	(2 150)	(29 623)	(29 559)	
Proterra Inc.	(503)	(1 158)	(799)	
Science Applications International Corp.	(104)	(14 627)	(15 479)	
Shoals Technologies Group Inc.	(1 017)	(29 365)	(34 397)	
Shyft Group Inc.	(24)	(918)	(701)	
Standex International Corp.	(18)	(2 991)	(3 370)	
Stem Inc.	(1 385)	(9 144)	(10 483)	
Tennant Co.	(8)	(667)	(859)	
Trex Co Inc.	(406)	(26 557)	(35 221)	
TriNet Group Inc.	(733)	(84 482)	(92 115)	
Trinity Industries Inc.	(100)	(3 280)	(3 402)	
TuSimple Holdings Inc.	(628)	(1 656)	(1 379)	
United Airlines Holdings Inc.	(457)	(29 726)	(33 181)	
Universal Logistics Holdings Inc.	(7)	(360)	(267)	
Vertiv Holdings Co.	(647)	(18 726)	(21 207)	
Viad Corp.	(100)	(2 888)	(3 557)	
Virgin Galactic Holdings Inc.	(4 070)	(21 514)	(20 896)	
Xometry Inc.	(66)	(1 219)	(1 850)	
		(986 291)	(1 062 892)	(6,29)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -1,74 %)				
1-800-Flowers.com Inc.	(100)	(1 479)	(1 032)	
America's Car-Mart Inc.	(93)	(11 375)	(12 279)	
AMMO Inc.	(1 300)	(10 501)	(3 664)	
Arhaus Inc.	(242)	(2 874)	(3 340)	
AutoZone Inc.	(14)	(47 063)	(46 190)	
BARK Inc.	(1 120)	(2 383)	(1 971)	
Bassett Furniture Industries Inc.	(151)	(3 571)	(3 005)	
Caleres Inc.	(57)	(1 861)	(1 805)	
Carvana Co.	(1 000)	(12 539)	(34 298)	
Cavco Industries Inc.	(2)	(803)	(781)	
Children's Place Inc.	(244)	(10 496)	(7 494)	
Citi Trends Inc.	(150)	(4 365)	(3 505)	
Clarus Corp.	(166)	(2 010)	(2 008)	
ContextLogic Inc.	(71)	(1 801)	(618)	
Designer Brands Inc.	(394)	(4 440)	(5 266)	
Dorman Products Inc.	(10)	(1 138)	(1 043)	
Escalade Inc.	(200)	(2 860)	(3 533)	
Ethan Allen Interiors Inc.	(211)	(7 473)	(7 896)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
EVgo Inc.	(593)	(2 943)	(3 139)	
Faraday Future Intelligent Electric Inc.	(8 205)	(2 544)	(2 171)	
Flexsteel Industries Inc.	(26)	(745)	(678)	
Full House Resorts Inc.	(430)	(4 454)	(3 812)	
Funko Inc.	(449)	(11 840)	(6 429)	
Gentherm Inc.	(13)	(1 116)	(972)	
Grand Canyon Education Inc.	(140)	(21 580)	(19 120)	
Groupon Inc.	(144)	(934)	(1 126)	
GrowGeneration Corp.	(638)	(11 307)	(2 870)	
Haverty Furniture Cos Inc.	(239)	(8 670)	(9 557)	
Kontoor Brands Inc.	(289)	(16 577)	(16 100)	
Kura Sushi USA Inc.	(33)	(2 675)	(4 059)	
Lakeland Industries Inc.	(21)	(366)	(400)	
Lazydays Holdings Inc.	(112)	(1 888)	(1 713)	
LCI Industries	(17)	(2 558)	(2 842)	
Lear Corp.	(17)	(3 122)	(3 229)	
Life Time Group Holdings Inc.	(122)	(3 169)	(3 175)	
Lifetime Brands Inc.	(19)	(437)	(142)	
LL Flooring Holdings Inc.	(131)	(752)	(664)	
Lucid Group Inc.	(10 763)	(103 364)	(98 128)	
Luminar Technologies Inc.	(2 652)	(21 580)	(24 144)	
Monro Inc.	(337)	(23 203)	(18 118)	
Mullen Automotive Inc.	(825)	(5 409)	(118)	
Overstock.com Inc.	(448)	(12 423)	(19 308)	
PLBY Group Inc.	(75)	(200)	(167)	
Portillo's Inc.	(51)	(1 369)	(1 520)	
Purple Innovation Inc.	(242)	(1 939)	(890)	
RealReal Inc.	(205)	(421)	(602)	
Solid Power Inc.	(438)	(1 717)	(1 472)	
Sonic Automotive Inc.	(81)	(5 771)	(5 109)	
Sportsman's Warehouse Holdings Inc.	(196)	(1 180)	(1 478)	
Spruce Power Holding Corp.	(1 925)	(15 926)	(2 068)	
Stitch Fix Inc.	(476)	(3 367)	(2 425)	
Strattec Security Corp.	(124)	(3 987)	(2 986)	
Superior Group of Cos Inc.	(25)	(359)	(309)	
Sweetgreen Inc.	(992)	(10 687)	(16 828)	
Target Hospitality Corp.	(479)	(8 109)	(8 506)	
Tempur Sealy International Inc.	(830)	(44 027)	(44 009)	
Tilly's Inc.	(111)	(1 245)	(1 030)	
Under Armour Inc., cat. A	(1 086)	(15 145)	(10 375)	
Unifi Inc.	(110)	(1 712)	(1 175)	
VOXX International Corp.	(91)	(1 449)	(1 503)	
Vroom Inc.	(2 039)	(3 372)	(3 885)	
Vuzix Corp.	(809)	(6 761)	(5 460)	
Weyco Group Inc.	(109)	(3 658)	(3 850)	
Wolverine World Wide Inc.	(390)	(8 460)	(7 581)	
Workhorse Group Inc.	(419)	(804)	(483)	
XPEL Inc.	(79)	(6 308)	(8 804)	
YETI Holdings Inc.	(354)	(19 568)	(18 194)	
		(560 229)	(532 451)	(3,15)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -0,23 %)				
22nd Century Group Inc.	(555)	(745)	(281)	
Alico Inc.	(141)	(5 446)	(4 750)	
AppHarvest Inc.	(1 167)	(818)	(571)	
BRC Inc.	(136)	(959)	(929)	
Calavo Growers Inc.	(59)	(3 052)	(2 266)	
Constellation Brands Inc.	(142)	(45 459)	(46 248)	
Hain Celestial Group Inc.	(55)	(1 299)	(910)	
John B Sanfilippo & Son Inc.	(3)	(338)	(466)	
Lifecore Biomedical Inc.	(677)	(5 416)	(8 663)	
Limoneira Co.	(50)	(1 117)	(1 029)	
Mission Produce Inc.	(516)	(8 122)	(8 275)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Pilgrim's Pride Corp.	(947)	(29 005)	(26 929)	
Rite Aid Corp.	(749)	(5 373)	(1 497)	
Vector Group Ltd.	(104)	(1 733)	(1 763)	
Veru Inc.	(436)	(645)	(687)	
Whole Earth Brands Inc.	(235)	(2 648)	(1 250)	
		(112 175)	(106 514)	(0,63)
Soins de santé (31 décembre 2022 : -2,67 %)				
2seventy bio Inc.	(227)	(3 687)	(3 040)	
AdaptHealth Corp.	(618)	(10 904)	(9 952)	
Agenus Inc.	(2 519)	(5 747)	(5 333)	
Alaunos Therapeutics Inc.	(2 701)	(9 004)	(1 823)	
Alector Inc.	(335)	(2 831)	(2 664)	
Allakos Inc.	(764)	(5 595)	(4 408)	
Allogene Therapeutics Inc.	(683)	(7 470)	(4 492)	
Allovir Inc.	(958)	(5 717)	(4 310)	
American Well Corp.	(164)	(721)	(456)	
AnaptysBio Inc.	(28)	(736)	(754)	
ANI Pharmaceuticals Inc.	(18)	(970)	(1 282)	
Apollo Medical Holdings Inc.	(45)	(1 797)	(1 882)	
Arcus Biosciences Inc.	(700)	(17 709)	(18 813)	
Arrowhead Pharmaceuticals Inc.	(183)	(8 750)	(8 635)	
Artivion Inc.	(62)	(1 205)	(1 410)	
Asensus Surgical Inc.	(1 965)	(2 663)	(1 313)	
Atara Biotherapeutics Inc.	(73)	(419)	(156)	
Avid Bioservices Inc.	(88)	(1 673)	(1 627)	
Avidity Biosciences Inc.	(374)	(7 277)	(5 488)	
Beam Therapeutics Inc.	(751)	(32 866)	(31 731)	
Becton Dickinson & Co.	(8)	(2 716)	(2 795)	
BioLife Solutions Inc.	(553)	(16 061)	(16 172)	
Bionano Genomics Inc.	(6 003)	(22 917)	(4 845)	
Bio-Techne Corp.	(443)	(46 802)	(47 851)	
Bioventus Inc.	(425)	(871)	(1 625)	
Bluebird Bio Inc.	(966)	(8 493)	(4 205)	
Bridgebio Pharma Inc.	(1 917)	(40 747)	(43 630)	
Butterfly Network Inc.	(1 809)	(6 735)	(5 506)	
Cano Health Inc.	(3 206)	(5 755)	(5 897)	
Cardiff Oncology Inc.	(575)	(3 119)	(1 118)	
Carisma Therapeutics Inc.	(13)	(315)	(151)	
Catalent Inc.	(1 754)	(112 690)	(100 637)	
Cerevel Therapeutics Holdings Inc.	(96)	(3 201)	(4 038)	
Certara Inc.	(2 221)	(67 706)	(53 518)	
Clearside Biomedical Inc.	(54)	(376)	(80)	
Codexis Inc.	(149)	(540)	(552)	
Coherus Biosciences Inc.	(978)	(7 211)	(5 526)	
Community Health Systems Inc.	(352)	(1 896)	(2 049)	
Cue Biopharma Inc.	(85)	(391)	(411)	
Cytek Biosciences Inc.	(346)	(3 694)	(3 910)	
CytoSorbents Corp.	(59)	(345)	(280)	
Denali Therapeutics Inc.	(116)	(4 295)	(4 530)	
DocGo Inc.	(707)	(7 902)	(8 766)	
Dynavax Technologies Corp.	(300)	(4 963)	(5 129)	
Editas Medicine Inc.	(817)	(9 615)	(8 897)	
Eli Lilly & Co.	(184)	(102 621)	(114 186)	
Enzo Biochem Inc.	(2 526)	(8 064)	(6 150)	
Epizyme Inc., droits	(249)	-	(329)	
Evolent Health Inc.	(20)	(759)	(802)	
FibroGen Inc.	(221)	(730)	(790)	
Figs Inc.	(235)	(2 324)	(2 572)	
Fulcrum Therapeutics Inc.	(238)	(2 515)	(1 039)	
Fulgent Genetics Inc.	(661)	(32 828)	(32 389)	
Geron Corp.	(1 834)	(6 453)	(7 790)	
Ginkgo Bioworks Holdings Inc.	(24 184)	(46 129)	(59 522)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Heron Therapeutics Inc.	(852)	(3 088)	(1 308)	
Humacyte Inc.	(100)	(528)	(378)	
IDEXX Laboratories Inc.	(74)	(48 170)	(49 178)	
IGM Biosciences Inc.	(303)	(3 599)	(3 701)	
ImmunityBio Inc.	(2 434)	(7 397)	(8 954)	
Immune Bio Inc.	(138)	(1 587)	(1 658)	
Inotiv Inc.	(325)	(2 976)	(2 051)	
Inovio Pharmaceuticals Inc.	(2 416)	(5 944)	(1 427)	
Intellia Therapeutics Inc.	(561)	(31 465)	(30 273)	
Invitae Corp.	(1 889)	(15 497)	(2 825)	
iTeos Therapeutics Inc.	(105)	(2 517)	(1 840)	
Maravai LifeSciences Holdings Inc.	(1 229)	(23 465)	(20 214)	
Merck & Co Inc.	(27)	(4 072)	(4 123)	
MiNK Therapeutics Inc.	(13)	(38)	(36)	
Moderna Inc.	(138)	(27 763)	(22 187)	
Multiplan Corp.	(939)	(1 574)	(2 622)	
Natera Inc.	(125)	(8 582)	(8 049)	
Neogen Corp.	(1 361)	(33 580)	(39 170)	
Ocugen Inc.	(1 965)	(1 212)	(1 412)	
Omeros Corp.	(176)	(622)	(1 267)	
Omniceil Inc.	(4)	(394)	(390)	
Outlook Therapeutics Inc.	(2 338)	(4 345)	(5 383)	
Pacific Biosciences of California Inc.	(2 079)	(31 455)	(36 589)	
Personalis Inc.	(163)	(504)	(405)	
PetIQ Inc.	(44)	(727)	(883)	
Phreesia Inc.	(100)	(4 715)	(4 103)	
Prelude Therapeutics Inc.	(300)	(2 272)	(1 786)	
ProPhase Labs Inc.	(100)	(1 083)	(961)	
PTC Therapeutics Inc.	(269)	(15 886)	(14 477)	
QuidelOrtho Corp.	(305)	(36 955)	(33 441)	
R1 RCM Inc.	(2 235)	(28 552)	(54 565)	
Reata Pharmaceuticals Inc.	(366)	(41 307)	(49 380)	
REGENXBIO Inc.	(73)	(1 903)	(1 931)	
Relay Therapeutics Inc.	(390)	(8 165)	(6 482)	
REVOLUTION Medicines Inc.	(682)	(21 477)	(24 141)	
Rigel Pharmaceuticals Inc.	(258)	(804)	(440)	
Rocket Pharmaceuticals Inc.	(683)	(18 488)	(17 958)	
Sangamo Therapeutics Inc.	(404)	(732)	(695)	
Schrodinger Inc.	(771)	(37 276)	(50 929)	
Scilex Holding Co.	(243)	(3 432)	(1 791)	
Seelos Therapeutics Inc.	(991)	(1 335)	(1 567)	
Seres Therapeutics Inc.	(1 570)	(11 300)	(9 951)	
Simulations Plus Inc.	(106)	(5 888)	(6 078)	
Societal CDMO Inc.	(160)	(328)	(233)	
Solid Biosciences Inc.	(1)	(343)	(7)	
Sotera Health Co.	(205)	(4 913)	(5 111)	
SpringWorks Therapeutics Inc.	(351)	(12 928)	(12 178)	
Stereotaxis Inc.	(471)	(1 278)	(954)	
Surmodics Inc.	(25)	(1 122)	(1 036)	
Tenet Healthcare Corp.	(107)	(8 730)	(11 522)	
Tilray Brands Inc., NASD	(4 884)	(24 203)	(10 082)	
Vaxart Inc.	(205)	(386)	(198)	
Vera Therapeutics Inc.	(163)	(3 775)	(3 462)	
Verrica Pharmaceuticals Inc.	(35)	(350)	(267)	
Verve Therapeutics Inc.	(249)	(6 665)	(6 178)	
Viatrix Inc.	(4 504)	(59 298)	(59 480)	
ViewRay Inc.	(594)	(980)	(277)	
Vir Biotechnology Inc.	(1 212)	(39 049)	(39 340)	
VolitionRX Ltd.	(319)	(1 054)	(587)	
X4 Pharmaceuticals Inc.	(2 148)	(5 014)	(5 514)	
Xencor Inc.	(478)	(18 174)	(15 794)	
Xeris Biopharma Holdings Inc.	(227)	(349)	(787)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
XOMA Corp.	(67)	(1 473)	(1 675)	
Zevra Therapeutics Inc.	(326)	(2 066)	(2 200)	
Zoetis Inc.	(114)	(26 718)	(25 978)	
		(1 431 387)	(1 397 115)	(8,27)
Services financiers (31 décembre 2022 : -1,31 %)				
Acacia Research Corp.	(711)	(3 888)	(3 914)	
ACNB Corp.	(50)	(2 204)	(2 195)	
Affirm Holdings Inc.	(2 166)	(34 162)	(43 938)	
AG Mortgage Investment Trust Inc.	(99)	(986)	(802)	
American National Bankshares Inc.	(100)	(4 351)	(3 835)	
Annaly Capital Management Inc.	(2 231)	(58 284)	(59 073)	
Atlantic Union Bankshares Corp.	(260)	(11 242)	(8 928)	
Atlantius Holdings Corp.	(100)	(3 778)	(5 559)	
Axos Financial Inc.	(105)	(5 477)	(5 480)	
Banc of California Inc.	(717)	(11 124)	(10 987)	
Bank First Corp.	(107)	(11 243)	(11 780)	
Bank of New York Mellon Corp.	(157)	(9 642)	(9 249)	
BankFinancial Corp.	(28)	(365)	(303)	
BankUnited Inc.	(744)	(23 546)	(21 216)	
Banner Corp.	(33)	(2 384)	(1 907)	
BayCom Corp.	(100)	(2 566)	(2 207)	
Berkshire Hills Bancorp Inc.	(49)	(1 779)	(1 344)	
BOK Financial Corp.	(33)	(4 112)	(3 527)	
Brighthouse Financial Inc.	(536)	(31 574)	(33 583)	
Business First Bancshares Inc.	(30)	(738)	(598)	
Byline Bancorp Inc.	(100)	(3 232)	(2 394)	
Capital City Bank Group Inc.	(229)	(9 358)	(9 285)	
Capstar Financial Holdings Inc.	(100)	(2 188)	(1 624)	
Cathay General Bancorp	(140)	(6 760)	(5 963)	
Central Pacific Financial Corp.	(64)	(1 677)	(1 330)	
Cherry Hill Mortgage Investment Corp.	(116)	(795)	(741)	
Citizens & Northern Corp.	(227)	(6 865)	(5 797)	
City Holding Co.	(191)	(23 643)	(22 744)	
Columbia Financial Inc.	(151)	(3 529)	(3 455)	
Dime Community Bancshares Inc.	(32)	(1 180)	(747)	
Dynex Capital Inc.	(437)	(6 820)	(7 280)	
Eagle Bancorp Montana Inc.	(49)	(1 258)	(858)	
East West Bancorp Inc.	(434)	(31 834)	(30 317)	
Equitable Holdings Inc.	(18)	(597)	(647)	
Equity Bancshares Inc.	(16)	(544)	(482)	
Esquire Financial Holdings Inc.	(100)	(5 515)	(6 053)	
Farmers & Merchants Bancorp Inc.	(100)	(3 115)	(2 979)	
FB Financial Corp.	(104)	(5 259)	(3 860)	
Federal Agricultural Mortgage Corp., cat. C	(15)	(2 701)	(2 853)	
Fidelity D&D Bancorp Inc.	(50)	(3 112)	(3 215)	
First Bancorp Inc.	(150)	(5 698)	(4 831)	
First Bancorp/Southern Pines NC	(192)	(8 650)	(7 558)	
First Bank	(25)	(413)	(343)	
First Citizens BancShares Inc.	(1)	(1 234)	(1 698)	
First Commonwealth Financial Corp.	(360)	(5 883)	(6 026)	
First Community Bankshares Inc.	(10)	(351)	(393)	
First Financial Bancorp	(29)	(881)	(784)	
First Financial Bankshares Inc.	(757)	(32 985)	(28 538)	
First Financial Northwest Inc.	(151)	(2 891)	(2 272)	
First Foundation Inc.	(444)	(4 750)	(2 332)	
First Guaranty Bancshares Inc.	(200)	(6 122)	(2 977)	
First Internet Bancorp	(100)	(4 961)	(1 965)	
First Merchants Corp.	(8)	(451)	(299)	
First Northwest Bancorp	(200)	(4 295)	(3 012)	
First Savings Financial Group Inc.	(250)	(6 342)	(4 367)	
First Western Financial Inc.	(300)	(10 379)	(7 384)	
Flushing Financial Corp.	(38)	(767)	(618)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Flywire Corp.	(560)	(20 863)	(23 001)	
Franklin BSP Realty Trust Inc.	(568)	(11 097)	(10 643)	
FS Bancorp Inc.	(10)	(374)	(398)	
FVCBankcorp Inc.	(73)	(1 155)	(1 040)	
GoHealth Inc.	(20)	(428)	(522)	
Great Southern Bancorp Inc.	(50)	(4 177)	(3 356)	
Greene County Bancorp Inc.	(100)	(3 180)	(3 943)	
Hamilton Lane Inc.	(87)	(8 877)	(9 207)	
Hancock Whitney Corp.	(230)	(10 978)	(11 681)	
Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc.	(827)	(30 144)	(27 358)	
HarborOne Bancorp Inc.	(100)	(1 552)	(1 149)	
HCI Group Inc.	(131)	(9 428)	(10 709)	
Heartland Financial USA Inc.	(152)	(8 695)	(5 606)	
Hilltop Holdings Inc.	(49)	(1 962)	(2 040)	
Hingham Institution For Savings The	(50)	(16 464)	(14 104)	
Hope Bancorp Inc.	(1 298)	(16 404)	(14 462)	
I3 Verticals Inc.	(33)	(1 089)	(998)	
International Bancshares Corp.	(18)	(1 089)	(1 053)	
Invesco Mortgage Capital Inc.	(121)	(1 923)	(1 836)	
Jackson Financial Inc.	(501)	(22 266)	(20 293)	
Lakeland Financial Corp.	(18)	(1 639)	(1 156)	
LendingClub Corp.	(1 208)	(11 899)	(15 585)	
Live Oak Bancshares Inc.	(90)	(2 960)	(3 133)	
Lument Finance Trust Inc.	(101)	(364)	(254)	
MBIA Inc.	(548)	(7 286)	(6 265)	
Metrocity Bankshares Inc.	(50)	(1 126)	(1 184)	
Metropolitan Bank Holding Corp.	(57)	(2 699)	(2 620)	
Middlefield Banc Corp.	(80)	(3 092)	(2 837)	
MVB Financial Corp.	(162)	(5 082)	(4 519)	
National Bank Holdings Corp.	(294)	(14 594)	(11 298)	
NBT Bancorp Inc.	(149)	(6 860)	(6 280)	
Nelnet Inc.	(8)	(1 037)	(1 021)	
New York Mortgage Trust Inc.	(223)	(3 218)	(2 927)	
Nicolet Bankshares Inc.	(11)	(916)	(988)	
Northeast Bank	(69)	(3 712)	(3 805)	
Northfield Bancorp Inc.	(68)	(1 454)	(988)	
Old Second Bancorp Inc.	(50)	(989)	(864)	
Open Lending Corp.	(133)	(1 267)	(1 850)	
Origin Bancorp Inc.	(190)	(8 363)	(7 366)	
Pacific Premier Bancorp Inc.	(1 504)	(46 034)	(41 156)	
Park National Corp.	(3)	(502)	(406)	
Penns Woods Bancorp Inc.	(100)	(3 635)	(3 312)	
PennyMac Financial Services Inc.	(427)	(34 402)	(39 727)	
PennyMac Mortgage Investment Trust	(337)	(6 085)	(6 011)	
Perella Weinberg Partners	(671)	(9 018)	(7 396)	
Piper Sandler Cos	(29)	(5 362)	(4 960)	
PJT Partners Inc.	(6)	(561)	(553)	
PRA Group Inc.	(160)	(7 327)	(4 838)	
Provident Financial Holdings Inc.	(18)	(349)	(308)	
RBB Bancorp	(50)	(1 332)	(790)	
Red River Bancshares Inc.	(100)	(6 768)	(6 502)	
Renasant Corp.	(33)	(1 641)	(1 141)	
Robinhood Markets Inc.	(804)	(10 244)	(10 618)	
Sandy Spring Bancorp Inc.	(47)	(1 501)	(1 411)	
Sierra Bancorp	(240)	(5 430)	(5 389)	
Simmons First National Corp.	(5)	(123)	(114)	
SLM Corp.	(836)	(14 647)	(18 054)	
SoFi Technologies Inc.	(880)	(6 480)	(9 712)	
Southern First Bancshares Inc.	(100)	(5 607)	(3 275)	
StepStone Group Inc.	(242)	(8 933)	(7 945)	
Sterling Bancorp Inc.	(429)	(3 443)	(3 105)	
Synovus Financial Corp.	(1 253)	(51 763)	(50 155)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Tompkins Financial Corp.	(100)	(9 081)	(7 370)	
Towne Bank	(9)	(360)	(277)	
TriCo Bancshares	(244)	(14 173)	(10 719)	
Triumph Financial Inc.	(52)	(4 046)	(4 178)	
Two Harbors Investment Corp.	(142)	(2 929)	(2 608)	
United Community Banks Inc.	(243)	(8 109)	(8 035)	
United Fire Group Inc.	(200)	(7 814)	(5 997)	
Valley National Bancorp	(1 459)	(16 805)	(14 962)	
Velocity Financial Inc.	(34)	(463)	(519)	
Veritex Holdings Inc.	(144)	(3 643)	(3 417)	
Walker & Dunlop Inc.	(115)	(11 594)	(12 035)	
Washington Federal Inc.	(466)	(19 151)	(16 353)	
Waterstone Financial Inc.	(17)	(354)	(326)	
West BanCorp Inc.	(197)	(5 948)	(4 799)	
Western Alliance Bancorp	(1 453)	(72 211)	(70 120)	
World Acceptance Corp.	(9)	(1 292)	(1 596)	
		(1 100 342)	(1 046 974)	(6,20)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -1,49 %)				
908 Devices Inc.	(101)	(1 088)	(917)	
ACI Worldwide Inc.	(50)	(1 634)	(1 533)	
ACV Auctions Inc.	(233)	(4 945)	(5 325)	
Akoustis Technologies Inc.	(1 466)	(8 447)	(6 169)	
Amkor Technology Inc.	(769)	(26 256)	(30 273)	
Applied Optoelectronics Inc.	(338)	(2 086)	(2 666)	
Arista Networks Inc.	(140)	(29 217)	(30 022)	
Aspen Technology Inc.	(58)	(14 024)	(12 864)	
Avid Technology Inc.	(30)	(999)	(1 012)	
Belden Inc.	(51)	(5 977)	(6 455)	
Bentley Systems Inc.	(6)	(350)	(431)	
C3.ai Inc.	(1 398)	(49 361)	(67 392)	
Casa Systems Inc.	(453)	(2 255)	(731)	
Cleanspark Inc.	(852)	(9 151)	(4 837)	
Clearfield Inc.	(46)	(2 945)	(2 882)	
Consensus Cloud Solutions Inc.	(8)	(403)	(328)	
Corning Inc.	(125)	(5 474)	(5 796)	
CTS Corp.	(28)	(1 342)	(1 579)	
Digimarc Corp.	(275)	(7 890)	(10 713)	
Digital Turbine Inc.	(932)	(43 890)	(11 445)	
DXC Technology Co.	(535)	(18 284)	(18 916)	
Dynatrace Inc.	(419)	(24 776)	(28 537)	
E2open Parent Holdings Inc.	(1 565)	(9 683)	(11 597)	
Eastman Kodak Co.	(726)	(3 547)	(4 438)	
Ebix Inc.	(8)	(382)	(267)	
Enphase Energy Inc.	(156)	(34 581)	(34 572)	
Entegris Inc.	(241)	(31 305)	(35 341)	
Envestnet Inc.	(512)	(39 922)	(40 210)	
Fair Isaac Corp.	(30)	(28 048)	(32 123)	
FARO Technologies Inc.	(5)	(357)	(107)	
Five9 Inc.	(212)	(19 107)	(23 129)	
Grid Dynamics Holdings Inc.	(368)	(4 778)	(4 504)	
IonQ Inc.	(2 663)	(19 449)	(47 677)	
IPG Photonics Corp.	(125)	(20 604)	(22 465)	
Jabil Inc.	(185)	(21 444)	(26 421)	
KLA Corp.	(6)	(3 137)	(3 851)	
LiveVox Holdings Inc.	(100)	(417)	(364)	
Luna Innovations Inc.	(49)	(464)	(591)	
MACOM Technology Solutions Holdings Inc.	(42)	(3 408)	(3 642)	
Marvell Technology Inc.	(1 107)	(66 091)	(87 567)	
Matterport Inc.	(1 009)	(4 606)	(4 206)	
MaxLinear Inc.	(429)	(16 105)	(17 916)	
Meta Materials Inc.	(2 993)	(819)	(852)	
Micron Technology Inc.	(20)	(1 637)	(1 670)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
MicroStrategy Inc.	(77)	(31 512)	(34 889)	
Mirion Technologies Inc.	(1 225)	(13 664)	(13 697)	
MKS Instruments Inc.	(209)	(26 237)	(29 896)	
MongoDB Inc.	(4)	(1 682)	(2 175)	
Napco Security Technologies Inc.	(225)	(5 536)	(10 316)	
Navitas Semiconductor Corp.	(893)	(9 107)	(12 455)	
NCR Corp.	(951)	(30 160)	(31 712)	
OSI Systems Inc.	(3)	(357)	(468)	
Palantir Technologies Inc.	(1 338)	(22 864)	(27 142)	
PAR Technology Corp.	(146)	(6 547)	(6 362)	
PFSweb Inc.	(406)	(2 986)	(2 428)	
Plexus Corp.	(6)	(718)	(780)	
Powerfleet Inc.	(510)	(1 951)	(2 025)	
PubMatic Inc.	(251)	(5 392)	(6 071)	
Qualys Inc.	(8)	(1 306)	(1 367)	
SiTime Corp.	(172)	(30 286)	(26 850)	
Skyworks Solutions Inc.	(5)	(697)	(732)	
Smith Micro Software Inc.	(1 255)	(4 848)	(1 843)	
SolarEdge Technologies Inc.	(118)	(44 691)	(42 010)	
SoundThinking Inc.	(40)	(2 198)	(1 157)	
SPS Commerce Inc.	(10)	(2 224)	(2 541)	
Tucows Inc., NASD	(10)	(358)	(367)	
Tyler Technologies Inc.	(29)	(14 722)	(15 982)	
Universal Display Corp.	(238)	(48 151)	(45 391)	
VeriSign Inc.	(17)	(5 118)	(5 083)	
Viasat Inc.	(697)	(33 823)	(38 054)	
Xerox Holdings Corp.	(340)	(6 920)	(6 699)	
Zebra Technologies Corp.	(87)	(35 265)	(34 057)	
		(980 005)	(1 056 882)	(6,26)
Services de communication (31 décembre 2022 : -0,45 %)				
AMC Networks Inc.	(16)	(361)	(253)	
Anterix Inc.	(72)	(3 389)	(3 019)	
ATN International Inc.	(139)	(7 792)	(6 732)	
Cable One Inc.	(24)	(22 080)	(20 867)	
Cardlytics Inc.	(326)	(10 171)	(2 726)	
Cars.com Inc.	(310)	(5 597)	(8 130)	
Cineverse Corp.	(149)	(5 930)	(376)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	(756)	(2 914)	(1 371)	
Consolidated Communications Holdings Inc.	(154)	(785)	(780)	
Emerald Holding Inc.	(172)	(829)	(933)	
Entravision Communications Corp.	(218)	(1 361)	(1 266)	
EverQuote Inc.	(558)	(8 807)	(4 799)	
EW Scripps Co.	(402)	(7 346)	(4 867)	
FuboTV Inc.	(2 636)	(7 807)	(7 255)	
Globalstar Inc.	(519)	(800)	(742)	
IAC Inc.	(711)	(52 392)	(59 084)	
iHeartMedia Inc.	(375)	(2 541)	(1 806)	
Liberty Broadband Corp.	(245)	(26 682)	(25 971)	
Madison Square Garden Entertainment Corp.	(38)	(1 693)	(1 691)	
Magnite Inc.	(530)	(7 679)	(9 573)	
Marcus Corp.	(83)	(1 766)	(1 629)	
Match Group Inc.	(927)	(45 618)	(51 335)	
MediaAlpha Inc.	(124)	(1 881)	(1 692)	
Quotient Technology Inc.	(511)	(2 131)	(2 597)	
Reading International Inc.	(168)	(882)	(589)	
Saga Communications Inc.	(67)	(2 224)	(1 894)	
Scholastic Corp.	(37)	(1 991)	(1 904)	
Sinclair Inc.	(686)	(15 956)	(12 545)	
Sphere Entertainment Co.	(335)	(13 194)	(12 142)	
TechTarget Inc.	(53)	(2 796)	(2 183)	
Trade Desk Inc.	(18)	(1 361)	(1 839)	
TripAdvisor Inc.	(1 303)	(29 995)	(28 432)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ziff Davis Inc.	(242)	(23 527)	(22 435)	
ZipRecruiter Inc.	(715)	(15 188)	(16 803)	
		(335 466)	(320 260)	(1,90)
Services publics (31 décembre 2022 : -0,10 %)				
Cadiz Inc.	(961)	(6 016)	(5 163)	
Chesapeake Utilities Corp.	(7)	(1 147)	(1 102)	
Clearway Energy Inc., cat. C	(217)	(9 010)	(8 201)	
MGE Energy Inc.	(50)	(4 925)	(5 234)	
Middlesex Water Co.	(12)	(1 311)	(1 281)	
Southern Co.	(4)	(386)	(372)	
Unitil Corp.	(105)	(7 212)	(7 046)	
		(30 007)	(28 399)	(0,17)
Immobilier (31 décembre 2022 : -0,53 %)				
Alexander & Baldwin Inc.	(209)	(5 292)	(5 138)	
Alexandria Real Estate Equities Inc.	(218)	(34 956)	(32 738)	
Americold Realty Trust Inc.	(603)	(23 715)	(25 773)	
Apartment Investment and Management Co.	(646)	(6 203)	(7 283)	
Armada Hoffer Properties Inc.	(96)	(1 637)	(1 484)	
Broadstone Net Lease Inc.	(146)	(3 259)	(2 983)	
CBRE Group Inc.	(329)	(32 808)	(35 137)	
Clipper Realty Inc.	(140)	(1 462)	(1 050)	
Community Healthcare Trust Inc.	(222)	(10 749)	(9 700)	
Compass Inc.	(1 586)	(6 714)	(7 345)	
Corporate Office Properties Trust	(334)	(12 028)	(10 497)	
Crown Castle Inc.	(263)	(44 222)	(39 653)	
Digital Realty Trust Inc.	(10)	(1 431)	(1 507)	
Douglas Elliman Inc.	(9)	(115)	(26)	
Easterly Government Properties Inc.	(1 226)	(23 183)	(23 523)	
EastGroup Properties Inc.	(53)	(11 865)	(12 175)	
Empire State Realty Trust Inc.	(1 661)	(14 755)	(16 462)	
Equity Commonwealth	(724)	(20 171)	(19 410)	
Essex Property Trust Inc.	(6)	(1 804)	(1 860)	
eXp World Holdings Inc.	(1 022)	(40 710)	(27 426)	
Farmland Partners Inc.	(506)	(8 611)	(8 175)	
Five Point Holdings LLC	(499)	(2 313)	(1 908)	
Forestar Group Inc.	(133)	(2 256)	(3 969)	
FRP Holdings Inc.	(100)	(7 345)	(7 618)	
Getty Realty Corp.	(199)	(9 526)	(8 906)	
Gladstone Commercial Corp.	(400)	(6 676)	(6 547)	
Gladstone Land Corp.	(117)	(2 859)	(2 519)	
Global Net Lease Inc.	(1 527)	(25 783)	(20 772)	
Highwoods Properties Inc.	(271)	(8 182)	(8 574)	
Howard Hughes Corp.	(417)	(42 398)	(43 547)	
Independence Realty Trust Inc.	(693)	(15 453)	(16 708)	
Iron Mountain Inc.	(224)	(16 633)	(16 842)	
Jones Lang LaSalle Inc.	(317)	(59 992)	(65 353)	
Kennedy-Wilson Holdings Inc.	(346)	(7 513)	(7 477)	
LXP Industrial Trust	(122)	(1 668)	(1 574)	
Macerich Co.	(875)	(11 654)	(13 049)	
Marcus & Millichap Inc.	(246)	(10 878)	(10 257)	
Maui Land & Pineapple Co Inc.	(33)	(480)	(622)	
Newmark Group Inc.	(439)	(4 178)	(3 613)	
Office Properties Income Trust	(23)	(359)	(234)	
Opendoor Technologies Inc.	(2 282)	(5 306)	(12 139)	
Plymouth Industrial REIT Inc.	(162)	(4 571)	(4 935)	
Postal Realty Trust Inc.	(267)	(5 603)	(5 197)	
RLJ Lodging Trust	(816)	(11 077)	(11 089)	
RPT Realty	(315)	(3 974)	(4 356)	
Safehold Inc.	(86)	(5 905)	(2 700)	
SBA Communications Corp.	(117)	(40 027)	(35 881)	
Seritage Growth Properties	(69)	(694)	(814)	
Service Properties Trust	(361)	(4 747)	(4 151)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
St Joe Co.	(82)	(4 501)	(5 245)	
STAG Industrial Inc.	(277)	(12 875)	(13 151)	
Stratus Properties Inc.	(17)	(918)	(591)	
Summit Hotel Properties Inc.	(223)	(2 032)	(1 921)	
Sunstone Hotel Investors Inc.	(417)	(5 564)	(5 584)	
Tejon Ranch Co.	(288)	(7 398)	(6 559)	
Urban Edge Properties	(580)	(11 460)	(11 842)	
Veris Residential Inc.	(122)	(2 390)	(2 591)	
VICI Properties Inc.	(308)	(13 189)	(12 810)	
Vornado Realty Trust	(80)	(1 795)	(1 920)	
		(685 862)	(672 910)	(3,98)
Total des actions américaines – position vendeur		(6 997 807)	(7 035 320)	(41,65)
Actions étrangères – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 2,32 %)				
Adaro Energy Indonesia Tbk PT	7 600	1 041	1 496	
Aker Solutions ASA	4 484	11 905	21 544	
Anton Oilfield Services Group/Hong Kong	22 000	1 553	1 597	
Borr Drilling Ltd.	981	4 845	9 536	
BP Castrol KK	200	2 013	1 609	
BW Energy Ltd.	501	1 792	1 596	
BW LPG Ltd.	1 083	12 386	14 339	
BW Offshore Ltd.	307	1 399	993	
Carnarvon Energy Ltd.	4 147	767	475	
Channel Infrastructure NZ Ltd.	290	361	346	
DHT Holdings Inc.	64	751	722	
DNO ASA	3 998	6 307	4 669	
Dorian LPG Ltd.	250	4 467	8 485	
Ecopetrol SA	4 077	55 400	55 297	
ENEOS Holdings Inc.	8 400	38 631	38 021	
Equinor ASA	1 029	39 267	39 666	
Établissements Maurel et Prom SA	52	283	293	
FLEX LNG Ltd.	211	5 695	8 527	
Frontline Ltd., NYSE	1 014	17 388	19 496	
Frontline PLC, OSL	855	16 232	16 313	
Hafnia Ltd.	538	3 852	3 485	
Idemitsu Kosan Co., Ltd.	200	5 640	5 284	
Inpex Corp.	1 500	22 683	21 945	
Ithaca Energy PLC	411	1 576	1 045	
Japan Petroleum Exploration Co., Ltd.	100	4 207	3 937	
MMA Offshore Ltd.	688	707	697	
Modec Inc.	100	1 349	1 273	
Nabors Industries Ltd., bons de souscription, éch. le 11 juin 2026	32	-	487	
New Hope Corp. Ltd.	391	1 837	1 670	
Nippon Coke & Engineering Co., Ltd.	1 900	1 667	2 018	
Nordic American Tankers Ltd.	3 002	10 321	14 579	
Oil Refineries Ltd.	11 964	5 094	4 514	
Saipem SpA	18 408	31 795	33 883	
San-Ai Obbli Co., Ltd.	100	1 379	1 390	
Saras SpA	7 754	9 376	12 711	
Semirara Mining & Power Corp.	4 300	3 750	2 886	
SFL Corp. Ltd.	1 103	10 780	13 617	
Subsea 7 SA	1 263	19 831	20 849	
Teekay Corp.	351	1 476	2 805	
Terracom Ltd.	7 148	3 702	2 644	
United Tractors Tbk PT	1 700	3 468	3 492	
Valaris Ltd.	290	24 479	24 149	
Whitehaven Coal Ltd.	2 001	12 144	11 826	
YPF SA	2 318	17 875	45 672	
		421 471	481 878	2,85

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Matières premières (31 décembre 2022 : 4,61 %)				
Aica Kogyo Co., Ltd.	200	5 785	5 781	
Aichi Steel Corp.	200	4 611	5 594	
Akansu Cimento AS	3 238	13 945	14 553	
Alkane Resources Ltd.	5 351	3 309	3 323	
Alleima AB	1 319	7 738	7 927	
AMG Critical Materials NV	123	8 707	8 433	
Asia Pile Holdings Corp.	200	1 089	1 126	
Aurelia Metals Ltd.	925	729	76	
BlueScope Steel Ltd.	147	2 618	2 661	
Boliden AB	101	3 906	3 855	
Borregaard ASA	534	10 433	10 474	
C Uyemura & Co., Ltd.	100	6 239	7 507	
Carlit Holdings Co., Ltd.	100	697	759	
Cementir Holding NV	428	5 012	4 585	
Centamin PLC	1 483	2 497	2 274	
China BlueChemical Ltd.	4 000	1 282	1 189	
China Nonferrous Mining Corp. Ltd.	1 000	706	625	
CI Takiron Corp.	200	1 036	1 053	
Constellium SE	312	6 060	7 101	
Covestro AG	291	20 231	19 988	
Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co., Ltd.	300	5 533	5 749	
DRDGOLD Ltd.	6 705	85 012	94 224	
Elkem ASA	1 011	3 918	3 102	
EMS-Chemie Holding AG	13	14 487	13 017	
Evonik Industries AG	515	14 298	12 959	
Firefinch Ltd.	2 091	2 355	219	
Fuchs Petrolub Se, actions priv.	6	290	314	
Fujikura Kasei Co., Ltd.	800	4 310	3 354	
Geostr Corp.	100	427	268	
Gerdau SA, CAAE	782	5 478	5 402	
Gold Road Resources Ltd.	806	1 300	1 054	
Gun-Ei Chemical Industry Co., Ltd.	100	2 651	2 654	
Harima Chemicals Group Inc.	200	1 798	1 609	
Harmony Gold Mining Co., Ltd.	5 210	32 620	28 955	
Hokko Chemical Industry Co., Ltd.	200	1 746	1 846	
Imdex Ltd.	359	574	598	
JFE Holdings Inc.	1 100	20 392	20 645	
JSP Corp.	200	3 212	3 422	
Jupiter Mines Ltd.	1 930	423	332	
K+S AG	597	13 469	13 751	
Kansai Paint Co., Ltd.	1 100	20 264	21 294	
Koatsu Gas Kogyo Co., Ltd.	300	2 104	2 054	
Konoshima Chemical Co., Ltd.	100	1 703	1 640	
Krakatau Steel Persero Tbk PT	142 700	4 035	2 544	
Kumiai Chemical Industry Co., Ltd.	900	7 834	9 228	
Kunimine Industries Co., Ltd.	200	2 056	1 859	
Kureha Corp.	100	8 483	7 516	
Kurimoto Ltd.	500	10 243	10 203	
Kuriyama Holdings Corp.	100	878	862	
LANXESS AG	61	2 317	2 431	
Liontown Resources Ltd.	1 916	4 559	4 776	
Loma Negra Cia Industrial Argentina SA	508	4 323	4 571	
Macmahon Holdings Ltd.	2 589	354	353	
Mitsubishi Paper Mills Ltd.	200	705	1 033	
Moriroku Holdings Co., Ltd.	100	1 906	1 901	
Mount Gibson Iron Ltd.	2 012	1 212	771	
Neometals Ltd.	2 237	1 815	975	
Neturen Co., Ltd.	700	4 937	6 229	
Nickel Asia Corp.	5 100	801	731	
Nihon Parkerizing Co., Ltd.	200	2 091	1 957	
Nippon Carbide Industries Co Inc.	100	1 310	1 285	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Nippon Kayaku Co., Ltd.	200	2 475	2 249	
Nippon Steel Corp.	400	10 703	11 001	
Nippon Yakin Kogyo Co., Ltd.	100	3 939	3 722	
Norsk Hydro ASA	6 104	58 409	48 100	
Northern Star Resources Ltd.	1 194	13 988	12 704	
Okamoto Industries Inc.	100	3 912	3 571	
Ora Banda Mining Ltd.	3 289	379	362	
Orica Ltd.	2 549	35 108	33 296	
Orora Ltd.	2 741	7 820	7 943	
Osaka Steel Co., Ltd.	100	1 310	1 278	
Outokumpu Oyj	3 015	19 871	21 336	
Pact Group Holdings Ltd.	4 580	4 920	2 663	
Pilbara Minerals Ltd.	10 177	40 286	43 834	
Polisan Holding AS	1 249	778	638	
POSCO Holdings Inc.	724	64 072	70 846	
Ramelius Resources Ltd.	1 586	1 483	1 760	
Red 5 Ltd.	2 035	409	341	
Resonac Holdings Corp.	100	2 124	2 129	
Riken Technos Corp.	200	1 205	1 198	
Sakata INX Corp.	100	1 138	1 110	
Salzgitter AG	197	10 055	9 425	
Sanyo Chemical Industries Ltd.	100	4 260	3 882	
Sasol Ltd., CAAE	261	4 290	4 276	
Seiko PMC Corp.	400	2 200	2 172	
Sekisui Kasei Co., Ltd.	600	2 437	2 411	
SGL Carbon SE	1 092	10 755	13 266	
Shikoku Kasei Holdings Corp.	100	1 394	1 378	
SIG Group AG	484	17 254	17 668	
Silver Lake Resources Ltd.	1 616	1 694	1 374	
SSAB AB, série B	2 225	19 786	20 362	
Stalprodukt SA	100	9 588	9 331	
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.	100	4 203	4 240	
Sumitomo Seika Chemicals Co., Ltd.	100	4 303	4 079	
Takasago International Corp.	200	5 689	4 944	
Tayca Corp.	100	1 204	1 258	
Ten Sixty Four Ltd.	825	457	411	
Thyssenkrupp AG	1 990	19 838	20 593	
Tokyo Tekko Co., Ltd.	100	1 878	3 012	
Tsaker New Energy Tech Co., Ltd.	3 000	690	648	
TYK Corp.	200	686	624	
Umicore SA	72	2 632	2 660	
Vertex Corp.	400	5 451	5 782	
Vetropack Holding AG	183	10 383	11 233	
Voestalpine AG	152	6 868	7 219	
Wacker Chemie AG	182	34 918	33 040	
Yushiro Chemical Industry Co., Ltd.	100	863	993	
Zignago Vetro SpA	25	617	564	
		863 575	863 497	5,11
Industries (31 décembre 2022 : 7,25 %)				
AddTech AB	700	6 490	20 135	
Advan Group Co., Ltd.	200	1 866	1 694	
Aida Engineering Ltd.	100	849	861	
Ajis Co., Ltd.	100	2 406	2 180	
Alinco Inc.	500	5 323	4 582	
Alstom SA	106	2 965	4 181	
Amadeus Fire AG	1	277	161	
ANDRITZ AG	80	6 452	5 896	
Anest Iwata Corp.	300	3 117	3 241	
AQ Group AB	100	4 441	5 262	
Aspo Oyj	300	3 954	3 023	
Austal Ltd.	7 294	12 346	15 226	
Babcock International Group PLC	3 971	21 436	18 879	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Bando Chemical Industries Ltd.	500	5 696	6 592	
Bangkok Airways PCL	1 300	630	747	
Befesa SA	191	14 161	9 651	
Beijer Alma AB	198	5 442	5 470	
Beijing Urban Construction Design & Development Group Co., Ltd.	7 000	2 721	2 529	
Benefit Systems SA	18	6 357	8 969	
Bilfinger SE	39	2 245	2 005	
Blue Bird Tbk PT	89 000	15 441	16 889	
Bodycote PLC	142	2 193	1 531	
Bossard Holding AG	9	3 723	2 646	
Brenntag SE	220	24 239	22 677	
Bucher Industries AG	13	7 898	7 595	
Budimex SA	66	6 350	7 717	
Bunka Shutter Co., Ltd.	200	2 246	2 027	
Burckhardt Compression Holding AG	7	5 296	5 436	
Burkhalter Holding AG	62	7 251	8 437	
Capita PLC	1 740	1 434	803	
Carel Industries SpA	11	405	438	
Cargotec Oyj	166	9 982	12 066	
Cebu Air Inc.	800	773	719	
Cewe Stiftung & Co KGAA	4	695	527	
Chilled & Frozen Logistics Holdings Co., Ltd.	100	1 300	1 154	
Chin Hin Group Bhd	3 400	4 391	4 203	
Chiyoda Corp.	700	2 788	2 269	
Chiyoda Integre Co., Ltd.	100	2 336	2 203	
CIMC Vehicles Group Co., Ltd.	500	531	574	
Cimpress PLC	104	6 305	8 185	
Controladora Vuela Cia de Aviacion SAB de CV, NYSE	131	2 455	2 418	
Corp America Airports SA	2 989	29 114	45 840	
Cosel Co., Ltd.	300	3 414	3 436	
Costamare Inc.	49	658	627	
CTS Co., Ltd.	100	783	676	
D/S Norden A/S	170	8 792	11 220	
Daihatsu Diesel Manufacturing Co., Ltd.	100	576	665	
Dai-Ichi Cutter Kogyo KK	600	7 188	7 806	
Danieli & C Officine Meccaniche SpA, RSP	247	6 758	5 998	
Denyo Co., Ltd.	100	1 736	1 887	
Derichebourg SA	1 214	14 865	8 921	
Deutsche Lufthansa AG	715	9 843	9 681	
Deutz AG	527	5 045	4 097	
Diploma PLC	1	51	50	
DiscoverIE Group PLC	17	351	240	
DMG Mori Co., Ltd.	100	2 283	2 278	
Duerr AG	34	1 495	1 455	
El Al Israel Airlines	2 099	3 480	3 684	
Elanders AB	83	2 028	1 212	
Embraer SA	1 985	26 727	40 608	
Emeco Holdings Ltd.	1 670	998	956	
Emeren Group Ltd.	564	2 898	2 829	
En Japan Inc.	100	3 871	2 269	
Enka Insaat ve Sanayi AS	-	-	-	
ERI Holdings Co., Ltd.	200	2 790	2 552	
Eurogroup Laminations SpA	4	32	38	
EVA Precision Industrial Holdings Ltd.	34 000	6 017	4 421	
F&M Co., Ltd.	300	6 175	7 012	
Fagerhult Group AB	50	380	419	
Finnair Oyj	615	468	502	
Firstgroup PLC	757	1 229	1 858	
Fiverr International Ltd.	364	14 552	12 528	
Fletcher Building Ltd.	1 051	4 321	4 618	
FLSmidth & Co A/S	264	12 014	16 902	
FNM SpA	1 955	1 367	1 242	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Forbo Holding AG	1	2 000	1 899	
Fudo Tetra Corp.	100	1 661	1 676	
Fukushima Galilei Co., Ltd.	100	5 194	4 898	
FULLCAST Holdings Co., Ltd.	100	2 407	1 999	
Furukawa Co., Ltd.	100	1 338	1 436	
Furukawa Electric Co., Ltd.	600	13 970	13 936	
Geberit AG	11	7 357	7 616	
Gecoss Corp.	200	1 698	1 600	
Gol Linhas Aereas Inteligentes SA, NYSE	993	4 031	7 174	
GT Capital Holdings Inc.	50	738	617	
Harbin Electric Co., Ltd.	2 000	1 275	1 064	
Heidelberger Druckmaschinen AG	2 695	7 085	5 567	
Helios Techno Holding Co., Ltd.	100	767	1 090	
Hexatronic Group AB	691	6 696	6 804	
Hirakawa Hewtech Corp.	300	4 602	4 359	
Hokuriku Electrical Construction Co., Ltd.	200	1 434	1 725	
Huber + Suhner AG	3	350	327	
Husqvarna AB	1 641	18 478	19 629	
Ichinen Holdings Co., Ltd.	100	1 302	1 241	
IJM Corp. Bhd	11 800	5 195	4 985	
IMI PLC	29	722	800	
Implenia AG	11	680	707	
Inaba Seisakusho Co., Ltd.	100	1 460	1 497	
Intrum AB	297	3 492	2 546	
Investment AB Latour	306	8 194	8 015	
Itoki Corp.	100	834	912	
Iwaki Co., Ltd.	100	1 282	1 274	
Japan Steel Works Ltd.	100	2 402	2 816	
Japan Transcity Corp.	100	748	568	
JDC Corp.	100	551	524	
JK Holdings Co., Ltd.	300	3 110	2 689	
Kamei Corp.	100	1 306	1 352	
Kato Works Co., Ltd.	400	4 328	4 424	
KAWADA TECHNOLOGIES Inc.	200	7 259	10 602	
Keihin Co., Ltd.	100	1 679	1 659	
Kimura Unity Co., Ltd.	100	1 025	1 167	
KION Group AG	347	16 717	18 465	
Kitano Construction Corp.	100	3 135	2 783	
Kondotec Inc.	100	1 011	1 099	
Kone Oyj	10	681	691	
Konecranes Oyj	416	20 782	22 131	
Kongsberg Gruppen ASA	567	30 903	34 189	
Koninklijke BAM Groep NV	3 324	13 109	8 465	
KPP Group Holdings Co., Ltd.	1 700	12 642	9 867	
KRS Corp.	100	973	870	
Kyodo Printing Co., Ltd.	100	2 839	2 898	
Lifco AB	74	2 166	2 124	
Lindab International AB	488	12 312	9 171	
Lixil Corp.	100	1 704	1 670	
Lonking Holdings Ltd.	12 000	5 458	2 614	
Maewawa Kyuso Industries Co., Ltd.	300	3 033	3 060	
MARUKA FURUSATO Corp.	100	2 784	2 085	
Matching Service Japan Co., Ltd.	300	3 028	3 104	
Matsui Construction Co., Ltd.	100	668	634	
Meier Tobler Group AG	147	5 916	11 480	
Meiji Electric Industries Co., Ltd.	100	1 080	1 314	
Metso Oyj	3 673	46 384	58 566	
Mirai Industry Co., Ltd.	200	3 831	5 054	
MISUMI Group Inc.	300	8 140	7 880	
Mitani Sangyo Co., Ltd.	900	2 969	2 637	
Mitie Group PLC	1 698	1 979	2 754	
Mitsubishi Kakoki Kaisha Ltd.	100	1 962	2 536	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Monadelphous Group Ltd.	483	5 234	4 986	
Montana Aerospace AG	170	3 944	3 631	
MPC Container Ships ASA	3 209	7 662	7 257	
MTR Corp. Ltd.	500	3 655	3 039	
Multiconsult ASA	51	956	970	
Munters Group AB	138	1 223	2 068	
Nachi-Fujikoshi Corp.	100	3 868	3 735	
Nakabayashi Co., Ltd.	200	972	937	
Nakano Corp.	500	1 901	1 781	
Namura Shipbuilding Co., Ltd.	1 000	3 279	5 749	
NEL ASA	9 507	15 878	14 783	
Nexans SA	6	700	687	
Nibe Industrier AB	6 469	96 476	81 152	
Nice Corp.	200	2 734	2 745	
Nichireki Co., Ltd.	100	1 520	1 681	
NIDEC Corp.	1 400	97 806	100 551	
Nihon M&A Center Holdings Inc.	2 000	20 129	20 114	
Nikkiso Co., Ltd.	300	2 837	2 494	
Nilfisk Holding A/S	277	7 347	6 746	
Nippon Concept Corp.	100	1 582	1 618	
Nippon Dry-Chemical Co., Ltd.	500	9 075	8 217	
Nippon Hume Corp.	400	2 315	2 831	
Nippon Sharyo Ltd.	86	1 783	1 583	
Nippon Thompson Co., Ltd.	800	4 784	4 336	
Nippon Yusen KK	1 200	36 534	35 046	
Nissin Corp.	100	1 840	2 297	
Nitta Corp.	49	1 779	1 368	
Nitto Kogyo Corp.	600	15 077	19 528	
Nitto Kohki Co., Ltd.	200	3 380	3 618	
Nitto Seiko Co., Ltd.	500	2 960	2 669	
Nittoc Construction Co., Ltd.	100	1 010	943	
NKT A/S	25	1 947	2 006	
Nordex SE	1 377	24 245	22 115	
Nordic Waterproofing Holding AB	173	3 097	2 921	
Noritake Co., Ltd.	100	4 671	4 999	
Noritsu Koki Co., Ltd.	200	4 505	4 248	
Norwegian Air Shuttle ASA	2 146	3 246	2 730	
NRW Holdings Ltd.	536	1 168	1 194	
NTN Corp.	4 300	11 922	11 944	
OC Oerlikon Corp. AG	144	933	949	
Ochi Holdings Co., Ltd.	200	2 446	2 364	
Okabe Co., Ltd.	100	775	672	
Pacific Basin Shipping Ltd.	8	6	3	
Paraca Inc.	100	2 049	1 781	
Pegasus Co., Ltd.	400	2 152	2 150	
Penta-Ocean Construction Co., Ltd.	200	1 416	1 414	
People Dreams & Technologies Group Co., Ltd.	300	4 576	4 609	
Per Aarsleff Holding A/S, cat. B	63	2 864	4 098	
Pfeiffer Vacuum Technology AG	1	246	215	
Phoenix Mecano AG	13	7 868	7 345	
PKP Cargo SA	1 331	6 727	7 439	
Pronexus Inc.	100	1 007	915	
Punch Industry Co., Ltd.	300	1 534	1 373	
Qantas Airways Ltd.	256	1 506	1 398	
Qinhuangdao Port Co., Ltd.	6 500	1 150	1 493	
Quick Co., Ltd.	300	5 646	6 388	
Raiznext Corp.	100	1 492	1 354	
Ras Al Khaimah Ceramics	20 353	11 581	19 651	
Reece Ltd.	133	2 139	2 175	
Rejlers AB	51	1 047	903	
RELX PLC, NYSE	16	713	708	
Renewi PLC	92	1 251	797	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Rix Corp.	100	2 817	2 971	
Ryanair Holdings PLC	1 118	141 246	163 620	
Safe Bulkers Inc.	2 633	9 052	11 358	
Sakai Moving Service Co., Ltd.	200	8 928	9 146	
Salcef Group SpA	86	1 957	2 856	
Sanko Gosei Ltd.	700	3 867	4 134	
Sankyo Tateyama Inc.	200	1 348	1 329	
Sansei Technologies Inc.	100	843	1 291	
Sansha Electric Manufacturing Co., Ltd.	700	6 794	9 216	
Sanyo Denki Co., Ltd.	100	6 926	7 095	
Sanyo Trading Co., Ltd.	200	2 357	2 571	
Sato Shoji Corp.	200	2 506	2 655	
Sdiptech AB	85	2 928	2 782	
Seikitokyu Kogyo Co., Ltd.	200	1 669	2 595	
Seiko Electric Co., Ltd.	400	4 087	3 926	
Senior PLC	264	710	779	
Sensata Technologies Holding PLC	762	45 067	45 364	
Senshu Electric Co., Ltd.	100	3 558	3 355	
SG Fleet Group Ltd.	194	357	393	
Shibusawa Warehouse Co., Ltd.	100	2 289	2 556	
Shibuya Corp.	200	5 036	4 819	
Shin Nippon Air Technologies Co., Ltd.	100	1 936	2 097	
Siemens Energy AG	4 508	129 895	105 299	
SIG PLC	441	358	257	
Sinfonia Technology Co., Ltd.	100	1 614	1 571	
Singapore Airlines Ltd.	1 900	12 964	13 283	
Sintokogio Ltd.	100	845	1 003	
Skanska AB	99	1 738	1 833	
SmartGroup Corp. Ltd.	205	2 097	1 430	
Sodick Co., Ltd.	200	1 503	1 304	
Solar A/S	115	10 484	11 260	
Space Co., Ltd.	300	2 971	2 843	
Speedy Hire PLC	317	380	193	
Stabilus SE	5	402	397	
Steico SE	7	478	307	
SThree PLC	45	374	259	
STO SE & Co KGaA	24	6 457	5 322	
Stolt-Nielsen Ltd.	53	724	1 787	
Sugimoto & Co., Ltd.	200	3 737	3 995	
Sulzer AG	7	804	796	
Surya Semesta Internusa Tbk PT	175 800	7 471	7 355	
SWCC Corp.	100	1 866	1 749	
Takashima & Co., Ltd.	200	5 812	6 381	
Teikoku Electric Manufacturing Co., Ltd.	100	2 553	2 487	
Tekken Corp.	200	3 807	3 770	
Textainer Group Holdings Ltd.	33	1 623	1 720	
Thoresen Thai Agencies PCL	5	1	1	
Tianjin Port Development Holdings Ltd.	25	3	2	
Tobishima Corp.	100	1 046	1 160	
Toenec Corp.	100	3 599	3 291	
Tokyo Energy & Systems Inc.	300	2 745	2 675	
Tokyo Keiki Inc.	100	1 274	1 199	
Tokyo Sangyo Co., Ltd.	300	2 329	2 444	
Toli Corp.	600	1 726	1 862	
Tonami Holdings Co., Ltd.	100	4 144	4 221	
Torishima Pump Manufacturing Co., Ltd.	400	6 352	6 947	
Toyo Engineering Corp.	700	5 074	3 768	
Toyo Machinery & Metal Co., Ltd.	100	655	618	
Traton SE	56	1 701	1 585	
Tsugami Corp.	400	5 352	5 050	
Tsukishima Holdings Co., Ltd.	100	812	1 105	
Turk Hava Yollari AO	1 637	15 905	16 094	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Union Tool Co.	100	3 316	2 953	
Valmet Oyj	1 264	52 507	46 495	
Veidekke ASA	139	1 828	1 974	
Volex PLC	63	416	300	
Volution Group PLC	50	356	318	
Wallenius Wilhelmsen ASA	2 058	15 803	18 899	
Wartsila OYJ Abp	1 133	16 670	16 872	
WDB Holdings Co., Ltd.	100	2 083	1 943	
Webuild SpA, bons de souscription, éch. le 2 août 2030	19	-	47	
Wienerberger AG	1 313	49 434	53 150	
Wilh Wilhelmsen Holding ASA	271	9 736	9 422	
Will Group Inc.	300	3 400	3 024	
Yahagi Construction Co., Ltd.	100	836	1 133	
YAMADA Consulting Group Co., Ltd.	300	4 250	4 436	
Yamaura Corp.	400	4 511	4 263	
Yasuda Logistics Corp.	100	964	898	
Yurtec Corp.	300	2 489	2 365	
Yushin Precision Equipment Co., Ltd.	400	2 772	2 622	
Zehnder Group AG	53	5 722	5 675	
Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co., Ltd., HKG	1 000	1 338	1 153	
Zumtobel Group AG	71	649	757	
		1 897 559	1 955 401	11,57
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 6,58 %)				
888 Holdings PLC	80	368	132	
ABHotel Co., Ltd.	100	2 381	2 710	
Abu Dhabi National Oil Co for Distribution PJSC	1 319	1 868	1 853	
Ahresty Corp.	500	2 878	3 131	
Aisan Industry Co., Ltd.	300	2 855	3 213	
Alpha Corp.	200	2 197	2 351	
Arcos Dorados Holdings Inc.	2 236	18 241	30 327	
Aristocrat Leisure Ltd.	484	15 543	16 481	
Astra Otoparts Tbk PT	3 800	832	832	
Avantia Co., Ltd.	500	4 135	3 978	
Baroque Japan Ltd.	300	2 397	2 381	
Bellway PLC	16	932	535	
Beneteau SA	52	1 083	1 162	
Bermaz Auto Bhd	35 300	22 619	22 317	
Bertrandt AG	221	15 689	15 633	
Betsson AB	584	4 557	8 213	
Betsson AB, actions visées par un rachat	860	135	259	
Bijou Brigitte AG	100	4 622	7 117	
Bloomerry Resorts Corp.	73 200	11 988	19 478	
Bookoff Group Holdings Ltd.	100	1 279	1 127	
Bronco Billy Co., Ltd.	100	2 429	2 555	
Calida Holding AG	100	3 945	5 044	
Capri Holdings Ltd.	1 569	93 128	74 514	
Card Factory PLC	4 775	4 986	7 230	
Carnival Corp.	7 080	101 027	176 410	
CECONOMY AG	1 231	5 076	4 087	
Central Automotive Products Ltd.	300	8 796	8 720	
Cettire Ltd.	149	403	408	
China Dongxiang Group Co., Ltd.	39	3	2	
China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd.	499	527	332	
China ZhengTong Auto Services Holdings Ltd.	8 500	828	761	
CIR SpA-Compagnie Industriali	735	459	402	
Clas Ohlson AB	1 064	9 854	10 545	
Collins Foods Ltd.	102	870	883	
Continental AG	565	49 082	56 362	
Corona Corp.	100	921	829	
Corporate Travel Management Ltd.	877	15 361	13 820	
Crystal International Group Ltd.	1 000	279	407	
Currys PLC	374	842	329	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Dainichi Co., Ltd.	100	711	664	
Daisyo Corp.	100	1 040	1 054	
DD GROUP Co., Ltd.	600	4 702	7 608	
Despegar.com Corp.	345	2 651	3 218	
D'ieteren Group	75	8 628	17 529	
Dor Alon Energy in Israel 1988 Ltd.	31	1 470	762	
Dynam Japan Holdings Co., Ltd.	4 000	5 369	3 114	
Eagers Automotive Ltd.	1 144	13 245	13 593	
Electrolux AB	1 167	20 922	21 045	
Erawan Group PCL	4 400	681	792	
Ferrari NV	16	6 366	6 918	
First Juken Co., Ltd.	100	1 110	1 008	
First-corp Inc.	100	926	716	
Fleetwood Ltd.	278	461	551	
F-Tech Inc.	300	2 374	2 549	
FuKoKu Co., Ltd.	200	2 143	2 558	
Furyu Corp.	400	5 023	4 819	
Futaba Industrial Co., Ltd.	400	1 708	1 930	
G8 Education Ltd.	677	716	620	
Gajah Tunggal Tbk PT	11 500	814	822	
Gakkyusha Co., Ltd.	100	2 051	1 923	
Garmin Ltd.	23	3 175	3 174	
Geo Holdings Corp.	400	6 693	6 691	
Gestamp Automocion SA	90	556	560	
Gift Holdings Inc.	100	4 248	4 509	
Giordano International Ltd.	6 000	1 671	2 482	
Global Digital Niaga Tbk PT	156 546	6 197	6 300	
GLOBERIDE Inc.	200	4 961	4 134	
Goodyear Lastikleri TAS	4 741	5 913	5 390	
Greggs PLC	9	339	387	
H & M Hennes & Mauritz AB	4 478	75 974	101 588	
Hagihara Industries Inc.	200	2 605	2 606	
Hard Off Corp. Co., Ltd.	100	1 303	1 315	
Hi-Lex Corp.	300	3 542	3 299	
Hisense Home Appliances Group Co., Ltd., HKG	4 000	4 935	13 576	
H-One Co., Ltd.	100	631	683	
Hongkong & Shanghai Hotels Ltd.	500	728	583	
Hornbach Baumarkt AG	27	1 424	1 832	
Hoteles City Express SAB de CV	6 153	3 848	3 404	
IBJ Inc.	100	707	609	
Ichikoh Industries Ltd.	700	3 229	3 486	
IJTT Co., Ltd.	200	1 154	1 069	
Imasen Electric Industrial	500	3 778	2 820	
Iveco Group NV	2 039	25 838	24 291	
Japan Wool Textile Co., Ltd.	100	970	952	
JB Hi-Fi Ltd.	56	2 062	2 158	
Jollibee Foods Corp.	130	775	745	
Jumbo Interactive Ltd.	45	522	565	
JVCKenwood Corp.	400	2 078	1 809	
KeyHolder Inc.	600	5 952	5 570	
Kindred Group PLC	84	1 216	1 182	
Komatsu Matere Co., Ltd.	400	2 809	2 472	
Konaka Co., Ltd.	500	1 776	1 767	
Lastminute.com NV	249	9 693	10 423	
Lottery Corp. Ltd.	3 893	17 972	17 591	
Matsuoka Corp.	100	1 467	1 075	
MC Group PCL	1 000	381	467	
Melia Hotels International SA	46	377	422	
Mercedes-Benz Group AG	19	2 049	2 021	
Mikuni Corp.	700	2 370	2 890	
Mitra Adiperkasa Tbk PT	28 400	4 196	4 236	
Mitra Pinasthika Mustika Tbk PT	118 700	11 838	11 157	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Mitsuba Corp.	400	2 533	2 963	
Morito Co., Ltd.	200	2 067	1 939	
MrMax Holdings Ltd.	300	2 048	1 733	
Myer Holdings Ltd.	1 503	955	781	
New Wave Group AB	1 049	12 142	12 188	
Nichirin Co., Ltd.	100	2 420	2 552	
Nihon Tokushu Toryo Co., Ltd.	200	1 916	1 957	
Nippon Seiki Co., Ltd.	100	832	897	
Nissan Motor Co., Ltd.	7 300	37 308	39 311	
Nissan Tokyo Sales Holdings Co., Ltd.	400	1 437	1 399	
Nobia AB	1 071	1 665	1 795	
Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	5 798	121 022	167 023	
Pandora A/S	45	5 171	5 315	
Paris Miki Holdings Inc.	100	323	301	
Piolax Inc.	300	5 359	5 955	
Pirelli & C SpA	284	1 996	1 855	
Playtech PLC	1 661	17 936	16 486	
PRADA SpA	400	3 834	3 546	
Propel Funeral Partners Ltd.	266	1 081	982	
Rakuten Group Inc.	8 600	40 424	39 288	
Reject Shop Ltd.	14	55	56	
Ride On Express Holdings Co., Ltd.	100	1 092	966	
Roland Corp.	100	3 956	3 781	
Royal Caribbean Cruises Ltd.	63	7 974	8 648	
Sac's Bar Holdings Inc.	200	1 523	1 871	
SAF-Holland SE	38	597	702	
San Holdings Inc.	100	2 306	2 018	
Sankyo Seiko Co., Ltd.	300	1 581	1 544	
Sanlorenzo SpA	8	397	455	
Sanyo Electric Railway Co., Ltd.	200	4 263	4 010	
Sekisui House Ltd.	300	7 709	7 980	
Selamat Sempurna Tbk PT	27 300	4 299	4 217	
Sharp Corp.	1 400	10 445	10 304	
Shikibo Ltd.	100	1 058	923	
Shimojima Co., Ltd.	100	1 068	1 019	
Signet Jewelers Ltd.	142	13 827	12 262	
Silver Life Co., Ltd.	100	1 263	1 297	
SISB PCL	10 400	8 545	14 653	
Skyworth Group Ltd.	12 000	5 016	7 011	
SMCP SA	3	32	35	
SNT Corp.	500	1 235	1 154	
Sogefi SpA	976	1 405	1 719	
SPK Corp.	200	3 493	3 285	
SRS Holdings Co., Ltd.	900	8 283	7 819	
SSP Group PLC	163	812	688	
Stella International Holdings Ltd.	12 500	27 003	15 619	
Step Co., Ltd.	200	3 864	3 303	
Suncall Corp.	600	3 678	2 889	
Super Retail Group Ltd.	553	5 689	5 567	
Tachikawa Corp.	200	2 301	2 333	
Take And Give Needs Co., Ltd.	300	4 057	3 200	
Texwinca Holdings Ltd.	8 011	1 855	1 610	
T-Gaia Corp.	100	1 640	1 586	
Thule Group AB	10	381	388	
Toa Corp. (Hyogo)	100	855	844	
Topre Corp.	100	1 288	1 452	
TPR Co., Ltd.	300	4 122	4 650	
TSI Holdings Co., Ltd.	800	4 970	5 764	
Tsukada Global Holdings Inc.	500	2 083	2 161	
Tsutsumi Jewelry Co., Ltd.	200	4 263	4 303	
UMW Holdings Bhd	500	481	532	
Union Auction PCL	4 500	1 919	1 587	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Valeo	747	24 734	21 169	
Van de Velde NV	21	1 029	1 000	
Vitesco Technologies Group AG	20	1 952	2 178	
Volkswagen AG, actions priv.	875	157 432	155 297	
Watches of Switzerland Group PLC	480	10 711	4 930	
Webjet Ltd.	7 018	44 741	42 715	
Weiqiao Textile Co.	1 504	369	409	
Xebio Holdings Co., Ltd.	200	2 004	1 990	
Xingda International Holdings Ltd.	2 000	550	476	
Yachiyo Industry Co., Ltd.	400	3 374	4 277	
Yakiniku Sakai Holdings Inc.	500	367	325	
Yatas Yatak ve Yorgan Sanayi ve Ticaret AS	3 128	6 389	5 030	
Yossix Holdings Co., Ltd.	100	2 281	2 268	
Zalando SE	299	13 179	11 378	
		1 424 742	1 580 866	9,36
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 2,39 %)				
111 Inc.	1 059	3 988	3 447	
A2 Milk Co., Ltd.	555	3 064	2 407	
Adecoagro SA	723	8 268	8 955	
Agthia Group PJSC	3 945	8 172	7 049	
Albis Co., Ltd.	100	2 608	2 205	
Anheuser-Busch InBev SA, CAAE	619	46 032	46 459	
Artnature Inc.	800	6 316	5 574	
Aryzta AG	10 214	15 787	22 419	
Bangkok Ranch PCL	9 600	1 196	996	
Bell Food Group AG	2	755	753	
BRF SA, CAAE	3 898	7 316	9 800	
Create SD Holdings Co., Ltd.	100	3 514	3 246	
DingDong Cayman Ltd.	152	885	622	
Eco's Co., Ltd.	200	3 844	3 488	
Eurocash SA	1 487	6 681	8 306	
GrainCorp Ltd.	412	2 944	2 841	
Grupo Comercial Chedraui SA de CV	600	4 754	4 523	
Gudang Garam Tbk PT	300	750	731	
Haad Thip PCL	300	380	409	
Halows Co., Ltd.	200	6 405	7 123	
Herbalife Ltd.	1 224	23 196	21 444	
Itochu-Shokuhin Co., Ltd.	100	5 125	4 742	
Kao Corp.	200	9 690	9 547	
Karmarts PCL	4 900	1 219	2 304	
Kenko Mayonnaise Co., Ltd.	100	1 343	1 210	
Lucas Bols NV	100	1 395	1 509	
Maxvalu Tokai Co., Ltd.	100	2 717	2 520	
Medical System Network Co., Ltd.	200	816	699	
Metcash Ltd.	921	3 271	3 050	
Mitsui DM Sugar Holdings Co., Ltd.	300	6 264	7 567	
Ontex Group NV	2 484	26 188	24 672	
Orior AG	100	11 961	11 315	
Orkla ASA	4 468	41 003	42 547	
QL Resources Bhd	300	513	456	
Redcare Pharmacy NV	4	545	548	
San Miguel Food and Beverage Inc.	410	744	442	
San-A Co., Ltd.	100	4 317	4 166	
Sappe PCL	1 500	2 252	4 549	
Scandinavian Tobacco Group A/S	972	22 892	21 390	
Shinnihonseiyaku Co., Ltd.	200	2 995	2 593	
ST Corp.	100	1 626	1 381	
TIPCO Foods PCL, CAE sans droit de vote	1 700	638	654	
Torigoe Co., Ltd.	100	616	561	
Transaction Co., Ltd.	300	4 381	5 246	
Weilong Delicious Global Holdings Ltd.	88	164	117	
Yamaya Corp.	200	5 386	4 979	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Yomeishu Seizo Co., Ltd.	100	1 953	1 704	
		316 869	323 265	1,91
Soins de santé (31 décembre 2022 : 5,89 %)				
AddLife AB	254	3 758	3 787	
Alkermes PLC	1 084	38 064	44 897	
Ambea AB	1 069	5 680	4 594	
Ambu A/S	1 171	22 433	25 349	
Arjo AB	778	4 405	3 725	
ASKA Pharmaceutical Holdings Co., Ltd.	200	2 442	2 639	
Attendo AB	200	560	774	
Austar Lifesciences Ltd.	1 003	341	330	
Biotage AB	503	9 243	8 270	
Carna Biosciences Inc.	200	1 520	1 311	
China Evergrande New Energy Vehicle Group Ltd.	3 000	1 558	1 621	
China Shineway Pharmaceutical Group Ltd.	7 000	8 864	10 437	
Consun Pharmaceutical Group Ltd.	6 000	4 243	5 370	
CVS Group PLC	70	2 625	2 331	
Daiken Medical Co., Ltd.	800	3 966	3 838	
Daito Pharmaceutical Co., Ltd.	100	2 543	2 095	
Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	146	10 349	7 668	
Eisai Co., Ltd.	800	60 849	71 220	
El.En. SpA	277	4 636	4 395	
Elan Corp.	300	3 107	2 398	
Elekta AB	3 552	34 769	36 265	
Establishment Labs Holdings Inc.	4	368	363	
Estia Health Ltd.	1 255	2 669	3 272	
Fragron	21	446	467	
FALCO Holdings Co., Ltd.	200	4 075	3 466	
FINDEX Inc.	100	623	591	
France Bed Holdings Co., Ltd.	500	4 969	5 287	
Fresenius SE & Co KGaA	361	13 163	13 222	
GNI Group Ltd.	100	1 376	1 282	
Grifols SA, CAAE	656	6 183	7 951	
H Lundbeck A/S, cat. B	5 416	32 791	34 065	
Inmode Ltd.	365	17 574	18 039	
Ion Beam Applications	122	3 202	2 691	
Japan Medical Dynamic Marketing Inc.	100	1 037	931	
Jazz Pharmaceuticals PLC	350	64 331	57 415	
JMS Co., Ltd.	200	1 043	1 084	
Kiniksa Pharmaceuticals Ltd.	384	7 077	7 154	
Koa Shoji Holdings Co., Ltd.	200	1 470	1 263	
Koninklijke Philips NV	4 420	110 860	126 393	
Koninklijke Philips NV, NYSE	1 328	31 579	38 115	
Linical Co., Ltd.	300	2 192	2 244	
LivaNova PLC	573	34 330	38 995	
M3 Inc.	100	2 861	2 846	
Menicon Co., Ltd.	400	11 516	9 186	
Merck KGaA	21	4 539	4 594	
Metall Zug AG	7	18 014	16 980	
Modern Dental Group Ltd.	4 000	1 008	2 040	
MoonLake Immunotherapeutics	23	1 547	1 552	
Nanosonics Ltd.	196	877	818	
Neuren Pharmaceuticals Ltd.	239	2 841	2 579	
Nipro Corp.	500	5 126	4 667	
Novartis AG	202	27 078	26 973	
Novo Nordisk A/S	630	137 934	134 289	
Novo Nordisk A/S, CAAE	144	31 376	30 836	
Novocure Ltd.	277	16 445	15 211	
Nykode Therapeutics ASA	156	542	505	
Olympus Corp.	1 000	21 090	20 746	
Opthea Ltd.	2 960	1 717	1 434	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Otsuka Holdings Co., Ltd.	100	4 948	4 826	
Pharming Group NV	5 014	7 588	7 774	
PhotoCure ASA	100	1 493	577	
Praram 9 Hospital PCL	1 400	1 134	925	
Pro Medicus Ltd.	479	28 173	27 694	
Prothena Corp. PLC	84	7 769	7 589	
Ramsay Health Care Ltd.	495	25 777	24 543	
RaySearch Laboratories AB	77	764	597	
Rion Co., Ltd.	100	1 998	1 785	
Santen Pharmaceutical Co., Ltd.	300	3 457	3 366	
Seed Co., Ltd.	300	1 710	1 604	
Software Service Inc.	100	9 041	9 842	
Solasto Corp.	800	5 357	4 863	
Sonic Healthcare Ltd.	1 761	55 736	55 173	
Spire Healthcare Group PLC	59	230	211	
St-Care Holding Corp.	200	1 549	1 426	
StemRIM Inc.	100	1 335	847	
Summerset Group Holdings Ltd.	194	1 470	1 508	
Surgical Science Sweden AB	83	2 481	2 453	
Telix Pharmaceuticals Ltd.	4 813	43 593	47 566	
Tokai Corp.	100	1 933	1 725	
UCB SA	201	24 963	23 562	
Vital KSK Holdings Inc.	200	1 821	1 628	
Volpara Health Technologies Ltd.	584	350	386	
Xvivo Perfusion AB	12	364	446	
Zai Lab Ltd.	91	3 195	3 339	
		1 090 053	1 119 115	6,62
Services financiers (31 décembre 2022 : 6,87 %)				
ABG Sundal Collier Holding ASA	2 464	2 207	1 586	
AEON Credit Service M Bhd	1 000	3 258	3 192	
Akita Bank Ltd.	200	3 451	3 060	
Alior Bank SA	194	2 889	3 056	
Aozora Bank Ltd.	1 200	30 918	29 383	
Ashmore Group PLC	128	495	448	
AUB Group Ltd.	555	12 069	14 372	
Avanza Bank Holding AB	830	22 013	22 319	
Axis Capital Holdings Ltd.	355	26 340	25 287	
B2Holding ASA	4 688	4 958	3 845	
Banca IFIS SpA	647	13 728	13 693	
Banca Mediolanum SpA	615	8 080	7 353	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	15 771	52 195	52 411	
Banco BBVA Argentina SA	1 482	10 340	12 021	
Banco BPM SpA	3 038	17 362	18 640	
Banco Comercial Portugues SA	41 113	13 238	13 034	
Banco del Bajio SA	100	445	401	
Bank of Georgia Group PLC	30	704	1 476	
Bank of Iwate Ltd.	200	4 418	3 746	
Bank of Nagoya Ltd.	100	3 202	3 030	
Bank of Queensland Ltd.	3 903	20 293	18 874	
Bank of Saga Ltd.	100	1 710	1 521	
Bank of the Ryukyus Ltd.	200	1 902	1 672	
Banque Cantonale Vaudoise	142	18 493	19 848	
BAWAG Group AG	683	46 094	41 629	
Bellevue Group AG	100	4 454	3 927	
Berner Kantonalbank AG	45	13 690	15 442	
BPER Banca	1 158	3 295	4 651	
Cembra Money Bank AG	4	412	439	
Chiba Bank Ltd.	200	1 750	1 600	
Chiba Kogyo Bank Ltd.	1 100	5 604	6 274	
Coface SA	33	417	601	
Commerzbank AG	589	8 360	8 631	
Credito Emiliano SpA	2 779	25 611	28 605	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Dah Sing Banking Group Ltd.	4 800	4 354	4 725	
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	2 400	7 862	7 935	
Ehime Bank Ltd.	100	890	737	
Enstar Group Ltd.	16	5 148	5 171	
Entrust Inc.	200	1 677	1 721	
EQT Holdings Ltd.	174	4 249	3 973	
Erste Group Bank AG	409	17 420	18 948	
FIBI Holdings Ltd.	22	1 312	1 173	
FIDEA Holdings Co., Ltd.	600	8 168	7 520	
FinecoBank Banca Fineco SpA	703	12 674	12 498	
FlatexDEGIRO AG	1 149	27 046	15 068	
Fukui Bank Ltd.	100	1 430	1 320	
Gentera SAB de CV	12 200	18 047	17 273	
Hargreaves Lansdown PLC	83	1 841	1 139	
Helia Group Ltd.	1 424	3 684	4 340	
Hi Sun Technology China Ltd.	6 000	1 374	719	
Hiscox Ltd.	28	428	514	
Hoist Finance AB	506	1 683	1 733	
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	300	17 409	14 954	
Hyakugo Bank Ltd.	400	1 529	1 531	
Impax Asset Management Group PLC	6	123	57	
International Personal Finance PLC	745	1 984	1 410	
Intesa Sanpaolo SpA	522	1 892	1 809	
Investec PLC	41	309	304	
ISX Financial EU Ltd.	45	-	-	
James River Group Holdings Ltd.	103	2 835	2 489	
Japan Post Holdings Co., Ltd.	500	4 819	4 745	
KBC Group NV	114	10 358	10 520	
Keiyo Bank Ltd.	400	2 304	1 948	
Krung Thai Bank PCL	1 600	898	1 158	
Kyushu Leasing Service Co., Ltd.	400	2 574	3 380	
Lancashire Holdings Ltd.	70	552	681	
Luzerner Kantonalbank AG	15	1 819	1 635	
Macquarie Group Ltd.	178	27 114	27 848	
Marusan Securities Co., Ltd.	100	443	404	
Miyazaki Bank Ltd.	100	2 374	2 132	
Mortgage Service Japan Ltd.	100	747	515	
Musashino Bank Ltd.	100	2 461	1 990	
MyState Ltd.	537	1 903	1 499	
Navigator Global Investments Ltd.	762	771	893	
NEC Capital Solutions Ltd.	100	2 740	2 943	
Netwealth Group Ltd.	375	4 426	4 571	
Ninety One PLC	442	1 629	1 249	
North Pacific Bank Ltd.	200	574	520	
Ogaki Kyoritsu Bank Ltd.	300	5 491	5 059	
Okinawa Financial Group Inc.	200	4 299	3 796	
OSB Group PLC	40	379	323	
Pacific Current Group Ltd.	100	723	653	
Pinnacle Investment Management Group Ltd.	58	409	510	
Polar Capital Holdings PLC	23	352	200	
Protector Forsikring ASA	102	1 862	2 081	
Raiffeisen Bank International AG	1 118	19 896	23 435	
Regional SAB de CV	100	1 043	957	
Resona Holdings Inc.	7 900	50 853	49 926	
Resurs Holding AB	299	945	734	
San ju San Financial Group Inc.	100	1 579	1 446	
SBI Insurance Group Co., Ltd.	100	971	929	
Shizuoka Financial Group Inc.	400	3 897	3 805	
Spar Nord Bank A/S	306	6 179	6 330	
SpareBank 1 SMN	760	12 959	13 235	
Sparebanken Vest	921	10 884	11 717	
St Galler Kantonalbank AG	1	738	717	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Steadfast Group Ltd.	1 216	6 361	6 426	
Swissquote Group Holding SA	27	5 712	7 416	
Sydbank AS	280	17 162	17 112	
Talanx AG	23	1 677	1 745	
Tamburi Investment Partners SpA	770	9 709	10 260	
TBC Bank Group PLC	324	9 231	13 463	
Thurgauer Kantonalbank	57	9 107	10 159	
Tisco Financial Group PCL	100	342	362	
Tochigi Bank Ltd.	200	558	458	
TOMONY Holdings Inc.	200	712	668	
Towa Bank Ltd.	100	541	487	
Traders Holdings Co., Ltd.	200	1 035	1 040	
Unicaja Banco SA	890	1 211	1 237	
Valiant Holding AG	101	14 460	13 923	
Vaudoise Assurances Holding SA	4	2 320	2 591	
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	115	4 200	3 976	
VZ Holding AG	27	2 898	3 283	
Wellnet Corp.	200	1 309	1 102	
XTB SA	86	833	1 163	
Yamagata Bank Ltd.	200	2 246	1 910	
Yamanashi Chuo Bank Ltd.	100	1 341	1 136	
ZhongAn Online P&C Insurance Co., Ltd.	200	865	719	
		815 558	810 248	4,80
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 5,79 %)				
A&D HOLON Holdings Co., Ltd.	400	5 071	6 529	
Aichi Tokei Denki Co., Ltd.	100	1 518	1 382	
AIXTRON SE	493	20 107	22 127	
Alps Alpine Co., Ltd.	1 600	19 948	18 413	
Ambarella Inc.	288	31 722	31 886	
Ams-OSRAM AG	996	10 955	9 490	
Anritsu Corp.	100	1 170	1 123	
AOI Electronics Co., Ltd.	200	3 904	3 375	
Arisawa Manufacturing Co., Ltd.	100	1 286	1 016	
ASML Holding NV	103	99 063	98 585	
ASML Holding NV, NASD	20	18 197	19 180	
Atled Corp.	200	2 999	2 598	
Atoss Software AG	10	2 110	2 996	
Axell Corp.	100	1 739	1 503	
Barco NV	285	9 725	9 397	
BE Semiconductor Industries NV	363	45 457	52 038	
Bechtel AG	79	4 568	4 142	
Bouvet ASA	602	4 741	4 826	
BrainPad Inc.	400	2 856	3 560	
Broadleaf Co., Ltd.	500	2 161	2 106	
Business Engineering Corp.	100	2 936	3 085	
CAC Holdings Corp.	200	3 196	3 144	
Camtek Ltd.	105	3 951	4 792	
Canon Marketing Japan Inc.	100	3 091	3 273	
Cellebrite DI Ltd.	153	1 449	1 458	
Celsys Inc.	400	2 730	2 732	
Check Point Software Technologies Ltd.	27	4 574	4 488	
China Electronics Huada Technology Co., Ltd.	10 000	2 640	2 533	
Chino Corp.	100	2 179	2 259	
CMK Corp.	300	1 389	1 527	
Computer Engineering & Consulting Ltd.	300	3 981	4 936	
Computer Institute of Japan Ltd.	300	1 652	1 703	
Credo Technology Group Holding Ltd.	576	13 409	13 216	
Cresco Ltd.	200	3 581	3 867	
CyberArk Software Ltd.	412	81 684	85 227	
Daishinku Corp.	100	752	595	
Datalogic SpA	234	2 625	2 348	
Datasonic Group Bhd	21 900	2 882	2 763	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ebase Co., Ltd.	100	672	696	
Econocom Group SA	98	350	376	
Elastic NV	515	41 479	43 696	
Elmos Semiconductor SE	4	343	434	
Enplas Corp.	100	4 223	5 337	
Esker SA	35	12 860	7 003	
ESPEC Corp.	500	10 633	10 446	
FIT Hon Teng Ltd.	84 000	27 879	19 715	
Fujitsu Ltd.	100	18 521	17 024	
Fukui Computer Holdings Inc.	100	2 712	2 550	
GL Sciences Inc.	100	1 898	2 211	
Globetronics Technology BHD	12 800	4 598	4 572	
Hochiki Corp.	200	3 178	3 270	
Hokuriku Electric Industry Co., Ltd.	200	2 857	2 281	
Hosiden Corp.	100	1 651	1 647	
Ichor Holdings Ltd.	15	746	744	
Icom Inc.	100	2 960	2 660	
Ines Corp.	100	1 398	1 373	
I-Net Corp.	100	1 306	1 510	
Infomedia Ltd.	1 251	1 582	1 763	
Init Innovation in Traffic Systems SE	100	4 728	4 288	
Innotech Corp.	100	1 416	1 490	
Intelligent Wave Inc.	200	1 440	1 403	
Inter Action Corp.	300	4 376	3 815	
Japan Electronic Materials Corp.	300	4 617	4 609	
JBCC Holdings Inc.	200	3 745	4 675	
JinkoSolar Holding Co., Ltd.	197	11 496	11 569	
Kaga Electronics Co., Ltd.	100	3 495	5 832	
Kainos Group PLC	179	4 544	3 710	
Kin & Carta PLC	372	1 646	394	
Kingboard Holdings Ltd.	2 500	9 760	9 013	
Kitron ASA	847	4 209	4 556	
Koa Corp.	200	3 492	3 290	
Kudelski SA	100	668	251	
Kyoden Co., Ltd.	400	2 067	1 685	
Kyosan Electric Manufacturing Co., Ltd.	200	876	917	
Kyowa Electronic Instruments Co., Ltd.	400	1 896	1 326	
Lagercrantz Group AB	560	5 160	9 536	
Landis+Gyr Group AG	18	1 245	2 045	
Lasertec Corp.	100	19 578	19 752	
LEM Holding SA	4	9 859	13 252	
LG Display Co., Ltd., CAAE	1 986	15 144	15 925	
LINK Mobility Group Holding ASA	3 851	4 354	5 375	
LiveChat Software SA	35	1 564	1 468	
Logo Yazilim Sanayi Ve Ticaret AS	208	749	697	
Maxon Solar Technologies Ltd.	352	13 992	13 116	
Melexis NV	36	4 572	4 672	
MIMAKI Engineering Co., Ltd.	700	4 818	6 050	
Miraial Co., Ltd.	300	5 034	4 340	
Mycronic AB	76	2 323	2 486	
Nagano Keiki Co., Ltd.	300	3 829	6 471	
NCAB Group AB	480	4 958	4 942	
NCC Group PLC	98	493	159	
Nemetschek SE	23	2 311	2 279	
NEOJAPAN Inc.	500	4 609	4 948	
Nihon Denkei Co., Ltd.	100	1 962	1 790	
Nippon Ceramic Co., Ltd.	100	2 759	2 500	
Nippon Chemi-Con Corp.	300	3 672	3 430	
Nissha Co., Ltd.	100	1 875	1 536	
Nordic Semiconductor ASA	91	1 538	1 466	
Nova Ltd.	335	34 018	50 075	
NSW Inc.	100	2 220	2 229	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Oizumi Corp.	200	1 064	906	
Optorun Co., Ltd.	200	4 714	4 437	
Osaki Electric Co., Ltd.	100	548	502	
Oxford Instruments PLC	9	270	413	
PAX Global Technology Ltd.	4 000	2 226	4 012	
Praemium Ltd.	7 299	4 371	4 340	
Proact IT Group AB	444	4 948	4 303	
Pro-Ship Inc.	100	1 328	1 295	
QT Group Oyj	10	1 220	1 104	
Radware Ltd.	695	24 363	17 832	
Renishaw PLC	103	7 996	6 761	
Reply SpA	57	9 480	8 566	
Riskified Ltd.	194	1 284	1 248	
RPMGlobal Holdings Ltd.	1 369	1 732	1 779	
RYODEN Corp.	100	2 004	2 014	
Ryosan Co., Ltd.	100	3 704	3 992	
Scala Inc.	100	748	685	
Seagate Technology Holdings PLC	140	11 469	11 462	
Sensys Gatso Group AB	141	1 556	1 339	
Siltronic AG	112	12 248	11 318	
SMA Solar Technology AG	347	22 149	56 056	
Soliton Systems KK	200	2 167	2 380	
Southern Cross Payments Ltd.	1 850	1 362	872	
SUESS MicroTec SE	139	2 981	4 886	
Sun Corp.	100	2 145	1 630	
Suzuden Corp.	100	2 677	2 040	
Suzuki Co., Ltd.	700	7 184	6 037	
System Information Co., Ltd.	200	1 519	1 403	
System Research Co., Ltd.	200	4 643	4 936	
System Support Inc.	100	1 915	1 952	
Taiyo Yuden Co., Ltd.	300	11 423	11 225	
Takachiho Koheki Co., Ltd.	100	2 369	2 866	
TAKEBISHI Corp.	100	1 756	1 587	
Tazmo Co., Ltd.	100	1 825	2 225	
TeamViewer SE	419	8 425	8 898	
Technology One Ltd.	3 064	38 209	42 237	
Technoprobe SpA	61	674	638	
Tecnos Japan Inc.	400	2 394	2 498	
Teikoku Tsushin Kogyo Co., Ltd.	100	1 546	1 538	
Tobii AB	1 295	6 846	2 649	
Tokyo Electron Ltd.	900	170 508	169 407	
Tomen Devices Corp.	100	5 476	4 614	
TomTom NV	374	4 136	3 844	
Tongda Group Holdings Ltd.	50 000	4 257	802	
Truly International Holdings Ltd.	2 000	389	311	
TXT e-solutions SpA	30	550	968	
U-blox Holding AG	80	9 045	11 608	
Uchi Technologies Bhd	22 500	22 069	22 007	
Unisem M Bhd	3 800	3 316	3 221	
UNITED Inc.	200	1 253	1 619	
USU Software AG	10	376	332	
Venture Corp. Ltd.	500	7 342	7 191	
VINX Corp.	100	1 355	1 279	
Vista Group International Ltd.	565	708	792	
VTech Holdings Ltd.	100	851	868	
Wasion Holdings Ltd.	14 000	7 060	7 541	
WILLs Inc.	100	610	554	
WiseTech Global Ltd.	746	46 942	52 442	
Wix.com Ltd.	454	49 100	47 003	
Xero Ltd.	711	63 470	74 481	
Yashima Denki Co., Ltd.	100	1 307	1 279	
Yokogawa Electric Corp.	200	4 855	4 853	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Yokowo Co., Ltd.	300	6 254	5 081	
		1 419 662	1 481 846	8,77
Services de communication (31 décembre 2022 : 1,90 %)				
Alma Media Oyj	100	926	1 331	
Amuse Inc.	300	5 519	4 958	
APG SGA SA	29	7 232	8 021	
Asahi Net Inc.	500	2 976	2 907	
Ascom Holding AG	23	363	371	
Ateam Inc.	100	806	622	
Auto Trader Group PLC	892	10 585	9 160	
Avex Inc.	100	1 515	1 382	
BAIOO Family Interactive Ltd.	4 000	382	270	
Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd.	2 038	4 038	3 289	
Cairo Communication SpA	2 024	4 384	4 827	
Carsales.com Ltd.	1 278	27 116	26 814	
Catena Media PLC	1 601	4 617	3 838	
Chorus Ltd.	115	807	785	
Cloud Music Inc.	50	525	701	
Crazy Sports Group Ltd.	10 000	435	287	
EVT Ltd.	438	4 775	4 529	
G5 Entertainment AB	11	315	269	
Homeland Interactive Technology Ltd.	2 000	515	601	
Hutchison Telecommunications Hong Kong Holdings Ltd.	2 000	435	419	
IMAGICA Group Inc.	1 100	6 685	6 838	
I-mobile Co., Ltd.	100	1 304	1 122	
Informa PLC	1 124	11 052	13 728	
IVE Group Ltd.	1 275	2 636	2 583	
Karnov Group AB	1 112	8 095	6 702	
Liberty Global PLC, série C	667	17 819	15 684	
Macquarie Technology Group Ltd.	92	5 028	5 536	
Macromill Inc.	200	1 844	1 540	
MarkLines Co., Ltd.	100	2 617	2 347	
Nexon Co., Ltd.	400	11 208	10 060	
Oricon Inc.	300	2 998	2 642	
Paradox Interactive AB	13	408	434	
Perion Network Ltd.	342	17 298	14 122	
Pico Far East Holdings Ltd.	18 000	4 556	4 164	
Proto Corp.	200	2 297	2 080	
Reach PLC	106	717	119	
Rovio Entertainment Oyj	25	272	330	
Sanoma Oyj	223	4 101	2 138	
Schibsted ASA	605	15 420	14 067	
Storytel AB	73	415	298	
Stroeer SE & Co KGaA	11	780	707	
Taboola.com Ltd.	109	394	449	
Telenor ASA	1 225	16 466	16 462	
TX Group AG	53	9 180	8 388	
United Internet AG	656	14 414	12 217	
Zengame Technology Holding Ltd.	2 000	551	1 081	
Zenrin Co., Ltd.	100	849	843	
		237 670	222 062	1,31
Services publics (31 décembre 2022 : 1,86 %)				
A2A SpA	4 294	9 288	10 371	
ACEA SpA	85	1 738	1 470	
Cia Energetica de Minas Gerais, CAAE	293	696	1 020	
Consolidated Water Co., Ltd.	100	2 351	3 206	
Encavis AG	456	11 075	9 891	
Enea SA	2 204	4 241	4 590	
Enel Chile SA	161	439	709	
Energia SA	691	1 695	1 890	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
GCL New Energy Holdings Ltd.	6 000	651	537	
Hiroshima Gas Co., Ltd.	900	3 427	3 115	
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd.	3 500	3 148	2 772	
Hokkaido Gas Co., Ltd.	100	1 995	2 153	
K&O Energy Group Inc.	300	6 453	6 237	
Kenon Holdings Ltd.	203	8 684	6 261	
Pertamina Geothermal Energy PT	1 812	142	140	
Telecom Plus PLC	14	346	398	
Toell Co., Ltd.	100	749	695	
YTL Corp. Bhd	3 400	910	1 002	
YTL Power International Bhd	4 900	1 183	1 806	
		59 211	58 263	0,34
Immobilier (31 décembre 2022 : 1,75 %)				
Alam Sutera Realty Tbk PT	190 100	3 179	3 020	
Aroundtown SA	20 277	34 954	30 941	
Concentradora Fibra Danhos SA de CV	4 400	7 580	7 312	
Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV	700	2 877	2 999	
Fabege AB	803	7 705	7 630	
Fastighets AB Balder	1 551	7 523	7 479	
FastPartner AB	239	1 182	1 186	
Garda Property Group	325	435	372	
Goodman Group	784	13 584	13 860	
Grandy House Corp.	500	2 893	2 660	
Hammerson PLC	5 133	3 396	2 150	
Intershop Holding AG	1	975	883	
Intiland Development Tbk PT	173 900	3 918	3 622	
Investis Holding SA	76	7 010	10 319	
Keihanshin Building Co., Ltd.	100	1 216	1 056	
Lendlease Corp. Ltd.	1 506	9 891	10 280	
Lifestyle Communities Ltd.	34	477	469	
Lotus's Retail Growth Freehold And Leasehold Property Fund	9 100	4 709	4 347	
Mivne Real Estate KD Ltd.	–	–	–	
NP3 Fastigheter AB	168	3 895	3 353	
NSI NV	27	914	797	
Origin Property PCL	1 000	379	396	
Peet Ltd.	88	90	96	
Property Perfect PCL	22 700	359	313	
PSP Swiss Property AG	147	22 812	21 721	
Rural Funds Group	4 475	7 445	6 957	
Sankyo Frontier Co., Ltd.	200	7 831	6 802	
Selvaag Bolig ASA	597	3 260	2 382	
Shimao Group Holdings Ltd.	2 003	2 309	1 495	
Sirius Real Estate Ltd.	180	368	258	
Stockland	776	2 961	2 755	
Summarecon Agung Tbk PT	51 800	3 270	3 017	
Swire Pacific Ltd.	4 000	30 719	40 559	
Swire Properties Ltd.	400	1 212	1 301	
TOC Co., Ltd.	300	1 920	1 730	
Tokyo Rakutenchi Co., Ltd.	100	3 979	3 781	
Unibail-Rodamco-Westfield	5	425	348	
Varia US Properties AG	156	10 154	8 606	
		217 806	217 252	1,29
Total des actions étrangères – position acheteur		8 764 176	9 113 693	53,93
Actions étrangères – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2022 : -0,76 %)				
Akastor ASA	(225)	(360)	(307)	
Aker BP ASA	(1 716)	(53 669)	(53 368)	
Cooper Energy Ltd.	(26 011)	(4 164)	(3 437)	
Cosmo Energy Holdings Co., Ltd.	(200)	(8 658)	(7 196)	
CropEnergies AG	(1 401)	(24 953)	(20 266)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Eni SpA, MIL	(2 799)	(49 935)	(53 265)	
Eni SpA, NYSE	(1 493)	(57 727)	(56 878)	
Equital Ltd.	(689)	(24 090)	(25 551)	
Karoon Energy Ltd.	(192)	(353)	(333)	
Maha Energy AB	(846)	(934)	(798)	
OMV AG	(281)	(16 896)	(15 756)	
PGS ASA	(2 274)	(1 561)	(1 673)	
Reliance Industries Ltd., CIAE	(303)	(22 707)	(24 979)	
Shell PLC, CAAE	(42)	(3 291)	(3 356)	
Tenaris SA	(921)	(36 442)	(36 500)	
TGS ASA	(1 030)	(19 173)	(20 316)	
Transport de Gas del Sur S.A., CAAE	(379)	(3 979)	(6 911)	
VERBIO Vereinigte BioEnergie AG	(330)	(21 373)	(17 555)	
Weatherford International PLC	(160)	(12 393)	(14 062)	
		(362 658)	(362 507)	(2,15)
Matières premières (31 décembre 2022 : -1,42 %)				
Aluflexpack AG	(189)	(5 365)	(4 361)	
Alumina Ltd	(578)	(709)	(705)	
APERAM SA	(187)	(9 008)	(7 716)	
BASF SE	(684)	(47 625)	(43 912)	
BHP Group Ltd., ASX	(174)	(7 154)	(6 895)	
BHP Group Ltd., NYSE	(224)	(18 308)	(17 687)	
Boral Ltd.	(175)	(658)	(621)	
Buzzi SpA	(105)	(2 907)	(3 477)	
Capricorn Metals Ltd.	(154)	(572)	(547)	
Champion Iron Ltd., ASX	(362)	(1 963)	(1 939)	
Champion Iron Ltd., TSE	(700)	(4 068)	(3 731)	
Cia de Minas Buenaventura SAA	(2 499)	(25 451)	(24 305)	
Cia Siderurgica Nacional SA	(252)	(932)	(864)	
Corbion NV	(15)	(756)	(473)	
Fortescue Metals Group Ltd.	(2 201)	(40 690)	(43 000)	
Fuchs Petrolub SE, actions priv.	(6)	(387)	(381)	
Huhtamaki Oyj	(45)	(2 243)	(1 953)	
Israel Corp. Ltd.	(3)	(1 060)	(1 039)	
KeePer Technical Laboratory Co., Ltd.	(300)	(10 465)	(13 403)	
Lynas Rare Earths Ltd.	(351)	(2 261)	(2 118)	
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	(2 000)	(22 831)	(21 661)	
Oji Holdings Corp.	(300)	(1 859)	(1 477)	
Sandfire Resources Ltd.	(159)	(829)	(826)	
Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	(300)	(13 053)	(13 096)	
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	(95)	(9 034)	(9 129)	
SOL SpA	(162)	(4 284)	(6 186)	
Symrise AG	(626)	(91 191)	(86 776)	
Syrah Resources Ltd.	(5 074)	(6 312)	(4 045)	
Talga Group Ltd.	(2 468)	(2 953)	(3 228)	
Taoka Chemical Co., Ltd.	(100)	(819)	(661)	
		(335 747)	(326 212)	(1,93)
Industries (31 décembre 2022 : -2,87 %)				
Aalberts NV	(14)	(841)	(779)	
ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	(9)	(362)	(418)	
Adecco Group AG	(215)	(13 926)	(9 295)	
AerCap Holdings NV	(773)	(56 389)	(64 972)	
AF Gruppen ASA	(346)	(6 995)	(5 684)	
AGC Inc.	(100)	(5 012)	(4 727)	
Air New Zealand Ltd.	(1 093)	(789)	(691)	
Aker Carbon Capture ASA	(88)	(56)	(153)	
Allegion PLC	(133)	(20 496)	(21 122)	
ALS Ltd.	(283)	(3 278)	(2 782)	
Ashtrom Group Ltd.	(73)	(1 497)	(1 333)	
AutoStore Holdings Ltd.	(256)	(742)	(741)	
Besterra Co., Ltd.	(200)	(3 756)	(2 137)	
Bonheur ASA	(100)	(3 840)	(3 211)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Bpost SA	(327)	(3 061)	(1 900)	
Br Holdings Corp.	(400)	(1 557)	(1 436)	
Central Japan Railway Co.	(200)	(32 657)	(33 068)	
Chugai Ro Co., Ltd.	(100)	(1 797)	(1 903)	
Clarivate PLC	(8 608)	(102 640)	(108 551)	
Cleanaway Waste Management Ltd.	(128)	(361)	(292)	
Danel Adir Yeoshua Ltd.	(4)	(390)	(374)	
Deme Group NV	(45)	(7 903)	(8 121)	
East Japan Railway Co.	(500)	(36 426)	(36 561)	
Ebara Jitsugyo Co., Ltd.	(100)	(2 894)	(2 769)	
Elco Ltd.	(118)	(8 131)	(5 344)	
Enav SpA	(1 004)	(5 134)	(5 661)	
Enento Group Oyj	(192)	(6 797)	(5 835)	
Energiekontor AG	(3)	(344)	(304)	
Ferrovial SE	(1)	(35)	(42)	
Fila SpA	(371)	(4 686)	(4 210)	
Forum Engineering Inc.	(200)	(1 770)	(2 254)	
Getlink SE	(63)	(1 408)	(1 417)	
Grab Holdings Ltd.	(780)	(2 943)	(3 540)	
Grafton Group PLC	(22)	(444)	(289)	
Hankyu Hanshin Holdings Inc.	(500)	(21 662)	(21 766)	
Hensoldt AG	(27)	(1 109)	(1 172)	
Hexagon Composites ASA	(532)	(2 025)	(1 789)	
Hilan Ltd.	(9)	(553)	(588)	
Indus Holding AG	(100)	(3 797)	(3 725)	
ISS A/S	(50)	(1 397)	(1 398)	
JAC Recruitment Co., Ltd.	(100)	(2 658)	(2 376)	
Japan Airlines Co., Ltd.	(800)	(20 845)	(22 851)	
Japan Airport Terminal Co., Ltd.	(100)	(6 695)	(5 951)	
Johns Lyng Group Ltd.	(8 834)	(52 790)	(41 396)	
Jungheinrich AG, actions priv.	(74)	(3 509)	(3 583)	
Katakura Industries Co., Ltd.	(100)	(1 796)	(1 491)	
Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	(400)	(13 029)	(12 887)	
Keihan Holdings Co., Ltd.	(400)	(14 435)	(13 887)	
Keisei Electric Railway Co., Ltd.	(500)	(24 204)	(27 264)	
Kintetsu Group Holdings Co., Ltd.	(200)	(9 276)	(9 126)	
Kornit Digital Ltd.	(291)	(10 659)	(11 309)	
Kosaido Holdings Co., Ltd.	(200)	(1 814)	(3 845)	
Kuehne + Nagel International AG	(2)	(766)	(783)	
Leonardo SpA	(1 945)	(30 419)	(29 188)	
Link Administration Holdings Ltd.	(94)	(373)	(138)	
Link And Motivation Inc.	(100)	(488)	(393)	
Makita Corp.	(800)	(30 429)	(29 560)	
Marubeni Corp.	(1 200)	(27 725)	(26 806)	
Midac Holdings Co., Ltd.	(100)	(3 793)	(1 396)	
Mitsui & Co., Ltd.	(900)	(39 112)	(44 585)	
Mpac Group PLC	(72)	(675)	(259)	
MTU Aero Engines AG	(72)	(24 235)	(24 676)	
Nichiban Co., Ltd.	(100)	(1 656)	(1 734)	
Nolato AB	(30)	(383)	(186)	
Noritz Corp.	(100)	(1 761)	(1 624)	
Odakyu Electric Railway Co., Ltd.	(200)	(3 965)	(3 526)	
OHB SE	(235)	(11 788)	(10 839)	
PNE AG	(316)	(3 665)	(6 460)	
Qube Holdings Ltd.	(7 641)	(19 729)	(19 181)	
Raksul Inc.	(100)	(1 342)	(1 230)	
Rheinmetall AG	(39)	(14 303)	(14 121)	
Service Stream Ltd.	(91 076)	(53 979)	(64 979)	
Shapir Engineering and Industry Ltd.	(221)	(2 173)	(2 012)	
SIF Holding NV	(100)	(1 289)	(1 920)	
SIF Holding NV, droits, éch. le 4 juillet 2023	(100)	-	(22)	
Sohgo Security Services Co., Ltd.	(1 500)	(11 003)	(11 181)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Tadano Ltd.	(300)	(3 169)	(3 143)	
Talenom Oyj	(76)	(1 161)	(798)	
TDCX Inc.	(33)	(370)	(345)	
Techno Smart Corp.	(100)	(1 480)	(1 474)	
Tinexta SpA	(100)	(3 155)	(2 431)	
Trane Technologies PLC	(24)	(5 861)	(6 074)	
Vestas Wind Systems A/S	(1 060)	(41 150)	(37 293)	
Visional Inc.	(300)	(22 496)	(21 808)	
West Japan Railway Co.	(1 200)	(68 405)	(65 807)	
Worley Ltd.	(180)	(2 527)	(2 503)	
		(966 435)	(966 795)	(5,72)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -1,70 %)				
AB Dynamics PLC	(11)	(347)	(348)	
Aptiv PLC	(55)	(7 234)	(7 430)	
ARB Corp. Ltd.	(47)	(1 319)	(1 184)	
Azorim-Investment Development & Construction Co., Ltd.	(1 199)	(5 409)	(4 810)	
Baby Bunting Group Ltd.	(213)	(463)	(258)	
BHG Group AB	(1 807)	(3 170)	(3 323)	
Chargeurs SA	(360)	(6 432)	(5 758)	
Cie Automotive SA	(10)	(347)	(404)	
Daimler Truck Holding AG	(745)	(33 996)	(35 492)	
De' Longhi SpA	(650)	(19 195)	(18 786)	
Delivery Hero SE	(95)	(4 926)	(5 541)	
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	(1 345)	(60 919)	(55 006)	
Dufry AG	(136)	(8 059)	(8 199)	
Electra Consumer Products 1970 Ltd.	(200)	(7 719)	(6 547)	
ES-Con Japan Ltd.	(300)	(2 648)	(2 263)	
Eslead Corp.	(100)	(2 360)	(2 376)	
Farfetch Ltd.	(2 826)	(21 254)	(22 586)	
Fiskars OYJ Abp	(100)	(2 352)	(2 235)	
Fox Wixel Ltd.	(15)	(1 595)	(1 624)	
Golf Digest Online Inc.	(200)	(2 394)	(1 514)	
GreenTree Hospitality Group Ltd.	(82)	(409)	(562)	
H2O Retailing Corp.	(900)	(11 066)	(12 112)	
Hella GmbH & Co KGaA	(224)	(18 020)	(23 315)	
IDP Education Ltd.	(1 326)	(28 004)	(25 812)	
InvoCare Ltd.	(110)	(1 221)	(1 220)	
Istyle Inc.	(100)	(511)	(505)	
JINS Holdings Inc.	(200)	(6 714)	(5 445)	
Just Eat Takeaway.com NV	(7)	(453)	(142)	
Kendrion NV	(172)	(3 784)	(4 191)	
KMD Brands Ltd.	(5 783)	(5 423)	(4 688)	
K's Holdings Corp.	(100)	(1 258)	(1 149)	
Maytronics Ltd.	(112)	(1 887)	(2 022)	
Mercari Inc.	(200)	(6 212)	(6 150)	
Moncler SpA	(108)	(10 258)	(9 876)	
Neinor Homes SA	(54)	(894)	(720)	
Nitori Holdings Co., Ltd.	(300)	(49 575)	(44 233)	
NOK Corp.	(800)	(12 152)	(15 377)	
Oriental Land Co., Ltd.	(500)	(25 862)	(25 639)	
Puma SE	(26)	(1 958)	(2 069)	
Sumitomo Electric Industries Ltd.	(600)	(10 150)	(9 651)	
Tadiran Group Ltd.	(50)	(6 114)	(5 015)	
Tokmanni Group Corp.	(246)	(4 376)	(4 247)	
Uxin Ltd.	(206)	(464)	(447)	
Wesfarmers Ltd.	(505)	(23 077)	(21 947)	
Zeal Network SE	(29)	(1 503)	(1 444)	
Zensho Holdings Co., Ltd.	(100)	(2 964)	(5 860)	
		(426 447)	(419 522)	(2,48)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -1,48 %)				
AG Barr PLC	(100)	(844)	(791)	
Agrana Beteiligungs AG	(102)	(2 613)	(2 555)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ajinomoto Co Inc.	(700)	(37 221)	(36 683)	
Anora Group Oyj	(215)	(2 221)	(1 527)	
Bakkafrost P/F	(51)	(4 349)	(4 044)	
Bega Cheese Ltd.	(399)	(1 142)	(1 002)	
Beiersdorf AG	(102)	(18 079)	(17 854)	
BrasilAgro - Co Brasileira de Propriedades Agricolas	(1 603)	(12 429)	(10 988)	
Bunge Ltd.	(300)	(37 344)	(37 454)	
Carlsberg AS	(207)	(42 781)	(43 766)	
Cia Brasileira de Distribuicao	(1 231)	(6 068)	(6 271)	
Coca-Cola Europacific Partners PLC	(166)	(10 123)	(14 153)	
Costa Group Holdings Ltd.	(145)	(364)	(347)	
Cranswick PLC	(117)	(5 466)	(6 389)	
Elders Ltd.	(270)	(1 860)	(1 565)	
Établissements Franz Colruyt NV	(7)	(362)	(345)	
Euglena Co., Ltd.	(700)	(5 915)	(5 704)	
Fresh Del Monte Produce Inc.	(37)	(1 333)	(1 259)	
Haleon PLC	(219)	(2 613)	(2 428)	
HelloFresh SE	(1 140)	(38 120)	(37 194)	
Henkel AG & Co KGaA, actions priv.	(25)	(2 680)	(2 644)	
Humble Group AB	(188)	(472)	(151)	
Inageya Co., Ltd.	(200)	(2 925)	(2 736)	
Italian Wine Brands SpA	(100)	(3 477)	(3 068)	
Japan Tobacco Inc.	(4 200)	(120 457)	(121 238)	
J-Oil Mills Inc.	(100)	(1 573)	(1 465)	
Kansai Food Market Ltd.	(200)	(2 274)	(2 758)	
Kerur Holdings Ltd.	(50)	(1 482)	(1 447)	
Key Coffee Inc.	(500)	(10 184)	(9 457)	
KWS Saat SE & Co KGaA	(125)	(13 983)	(10 160)	
MARR SpA	(134)	(2 015)	(2 720)	
Neto ME Holdings Ltd.	(114)	(4 624)	(3 572)	
Newlat Food SpA	(100)	(778)	(885)	
Nisshin Oillio Group Ltd.	(100)	(3 566)	(3 131)	
Nissui Corp.	(1 500)	(9 230)	(8 873)	
Pola Orbis Holdings Inc.	(400)	(7 418)	(7 672)	
Raisio Oyj	(958)	(3 469)	(2 828)	
Salmar ASA	(773)	(40 908)	(41 331)	
Savencia SA	(16)	(1 349)	(1 344)	
Schouw & Co A/S	(109)	(10 981)	(11 391)	
Suedzucker AG	(125)	(2 856)	(2 947)	
Unilever PLC	(147)	(10 057)	(10 140)	
United Malt Grp Ltd.	(14 511)	(46 970)	(56 239)	
Watahan & Co., Ltd.	(200)	(2 837)	(2 505)	
Yukiguni Maitake Co., Ltd.	(200)	(1 994)	(1 785)	
		(539 806)	(544 806)	(3,22)
Soins de santé (31 décembre 2022 : -1,59 %)				
3-D Matrix Ltd.	(100)	(397)	(157)	
ArcticZymes Technologies ASA	(344)	(3 203)	(1 700)	
Argenx SE	(46)	(24 207)	(23 723)	
AstraZeneca PLC, CAAE	(610)	(56 191)	(57 770)	
Atrys Health SA	(51)	(751)	(383)	
Bachem Holding AG	(3)	(422)	(346)	
Bactiguard Holding AB	(159)	(3 541)	(1 391)	
Bavarian Nordic A/S	(363)	(13 985)	(13 654)	
Bayer AG	(1 714)	(142 377)	(125 378)	
BioGaia AB	(36)	(438)	(512)	
Chemometec A/S	(189)	(16 263)	(17 076)	
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	(2 600)	(92 733)	(97 261)	
Clinuvel Pharmaceuticals Ltd.	(44)	(741)	(693)	
Coloplast A/S	(496)	(83 008)	(82 050)	
Compugen Ltd.	(553)	(1 752)	(834)	
CSL Ltd.	(14)	(3 512)	(3 420)	
Demant A/S	(640)	(31 811)	(35 799)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
DiaSorin SpA	(449)	(68 175)	(61 838)	
EssilorLuxottica SA	(60)	(15 713)	(14 950)	
Eurobio Scientific SA	(50)	(1 391)	(1 003)	
Galapagos NV	(173)	(9 385)	(9 333)	
Galapagos NV, CAAE	(505)	(25 983)	(27 171)	
Genmab A/S	(87)	(45 637)	(43 520)	
GN Store Nord AS	(378)	(13 069)	(12 474)	
Guerbet	(100)	(2 631)	(2 454)	
Hoya Corp.	(300)	(51 363)	(46 897)	
I-Mab	(211)	(1 091)	(835)	
Imugene Ltd.	(2 848)	(435)	(228)	
JMDC Inc.	(100)	(6 359)	(5 222)	
Kyorin Pharmaceutical Co., Ltd.	(200)	(4 373)	(3 206)	
Lonza Group AG	(15)	(12 964)	(11 834)	
Medios AG	(290)	(11 945)	(6 531)	
Medius Holdings Co., Ltd.	(100)	(719)	(801)	
Merus NV	(77)	(2 333)	(2 683)	
Mesoblast Ltd.	(316)	(347)	(316)	
Mesoblast Ltd., CAAE	(174)	(731)	(900)	
Molecular Partners AG	(49)	(964)	(393)	
Nexus AG	(59)	(5 105)	(4 812)	
Orion Oyj	(59)	(3 236)	(3 238)	
ProQR Therapeutics NV	(452)	(1 305)	(969)	
QIAGEN NV	(436)	(26 163)	(25 895)	
Ryman Healthcare Ltd.	(14 146)	(68 994)	(75 459)	
Sartorius AG	(80)	(35 566)	(36 622)	
Scancell Holdings PLC	(2 967)	(585)	(661)	
Ship Healthcare Holdings Inc.	(300)	(8 558)	(6 537)	
Synlab AG	(30)	(413)	(392)	
Symex Corp.	(500)	(44 921)	(44 869)	
UniQure NV	(261)	(7 095)	(3 958)	
Vetoquinol SA	(73)	(7 640)	(9 632)	
Xbrane Biopharma AB	(362)	(3 872)	(3 424)	
		(964 393)	(931 204)	(5,51)
Services financiers (31 décembre 2022 : -1,49 %)				
ABC arbitrage	(112)	(1 218)	(962)	
Aegon NV, AMS	(4)	(17)	(27)	
Aegon NV, NYSE	(869)	(5 221)	(5 830)	
Assicurazioni Generali SpA	(551)	(14 842)	(14 811)	
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	(790)	(16 686)	(16 498)	
Baloise Holding AG	(83)	(16 809)	(16 131)	
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, CAAE	(2 961)	(28 450)	(30 091)	
Banco Macro SA	(499)	(8 825)	(17 425)	
Banco Santander Chile	(1 775)	(41 816)	(44 274)	
Banco Santander SA, CAAE	(11 338)	(56 782)	(55 661)	
Bancolombia SA	(1 801)	(58 788)	(63 583)	
Bendigo & Adelaide Bank Ltd.	(3)	(27)	(23)	
Challenger Ltd.	(175)	(1 006)	(999)	
Clal Insurance Enterprises Holdings Ltd.	(200)	(4 686)	(4 106)	
Commonwealth Bank of Australia	(1 531)	(133 718)	(135 217)	
Daiwa Securities Group Inc.	(2 900)	(19 426)	(19 655)	
DWS Group GmbH & Co KGaA	(25)	(985)	(1 012)	
Euronext NV	(13)	(1 254)	(1 169)	
Flow Traders Ltd.	(244)	(10 452)	(7 122)	
Futu Holdings Ltd.	(1 405)	(84 078)	(73 883)	
Greenlight Capital Re Ltd.	(347)	(3 132)	(4 837)	
Grupo Financiero Galicia SA	(1 323)	(17 221)	(30 111)	
Grupo Supervielle SA	(1 876)	(4 456)	(7 720)	
Gruppo MutuiOnline SpA	(125)	(4 216)	(5 567)	
Heartland Group Holdings Ltd.	(3 796)	(5 921)	(5 231)	
Hokkoku Financial Holdings Inc.	(100)	(4 274)	(3 799)	
HSBC Holdings PLC, CAAE	(846)	(35 545)	(44 353)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Illimity Bank SpA	(640)	(9 210)	(5 867)	
Japan Exchange Group Inc.	(100)	(2 377)	(2 296)	
Lifenet Insurance Co.	(600)	(6 905)	(5 916)	
M&A Capital Partners Co., Ltd.	(200)	(8 110)	(6 097)	
Migdal Insurance & Financial Holdings Ltd.	(936)	(1 124)	(1 500)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	(15 100)	(133 382)	(147 229)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc., CAAE	(500)	(4 213)	(4 876)	
Nexi SpA	(8 398)	(109 337)	(87 073)	
Nomura Holdings Inc.	(1 500)	(7 642)	(7 515)	
Platinum Asset Management Ltd.	(5 754)	(11 558)	(8 819)	
Prudential PLC, NYSE	(477)	(17 784)	(17 875)	
Topdanmark AS	(162)	(11 352)	(10 528)	
Toyo Securities Co., Ltd	(200)	(361)	(564)	
Tryg A/S	(1 301)	(38 735)	(37 244)	
Tyro Payments Ltd.	(620)	(796)	(623)	
UBS Group AG	(2 073)	(58 225)	(55 481)	
Westpac Banking Corp.	(6 443)	(126 463)	(121 107)	
		(1 127 425)	(1 130 707)	(6,69)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -2,14 %)				
Advantest Corp.	(700)	(111 586)	(122 725)	
Appier Group Inc.	(700)	(11 033)	(11 209)	
Avant Group Corp.	(100)	(1 473)	(1 292)	
BrainChip Holdings Ltd.	(2 142)	(1 080)	(689)	
Bravura Solutions Ltd.	(2 566)	(4 648)	(1 062)	
Canaan Inc.	(168)	(573)	(474)	
Citizen Watch Co., Ltd.	(100)	(831)	(793)	
Cyberlinks Co., Ltd.	(100)	(1 021)	(669)	
Dicker Data Ltd.	(825)	(6 097)	(5 959)	
Digital Value SpA	(100)	(8 897)	(8 590)	
FUJIFILM Holdings Corp.	(800)	(64 439)	(62 555)	
Innoviz Technologies Ltd.	(506)	(1 815)	(1 902)	
Ituran Location and Control Ltd.	(404)	(13 351)	(12 477)	
IVU Traffic Technologies AG	(104)	(2 522)	(2 279)	
Japan Cash Machine Co., Ltd.	(400)	(2 593)	(4 303)	
Japan Display Inc.	(1 000)	(372)	(357)	
Japan System Techniques Co., Ltd.	(100)	(1 689)	(2 299)	
JIG-SAW Inc.	(100)	(4 927)	(5 392)	
Kapsch TrafficCom AG	(21)	(421)	(347)	
Keyence Corp.	(100)	(64 872)	(62 118)	
Lime Technologies AB	(148)	(4 873)	(4 959)	
Manz AG	(100)	(6 540)	(2 749)	
Money Forward Inc.	(300)	(15 258)	(15 598)	
Nano Dimension Ltd.	(596)	(2 115)	(2 279)	
Netcompany Group A/S	(436)	(39 482)	(23 872)	
OBIC Business Consultants Co., Ltd.	(100)	(4 825)	(4 816)	
Pexip Holding ASA	(1 043)	(5 255)	(2 512)	
Rakus Co., Ltd.	(100)	(4 205)	(2 224)	
Renesas Electronics Corp.	(2 200)	(51 849)	(54 412)	
Ricoh Co., Ltd.	(600)	(6 771)	(6 715)	
Sakura Internet Inc.	(100)	(1 280)	(1 190)	
Sanken Electric Co., Ltd.	(100)	(10 722)	(12 295)	
Sansan Inc.	(100)	(1 783)	(1 538)	
Secunet Security Networks AG	(6)	(3 816)	(1 884)	
SHIFT Inc.	(100)	(19 968)	(23 982)	
Shimadzu Corp.	(300)	(12 838)	(12 162)	
Sinch AB	(172)	(2 631)	(513)	
SMART Global Holdings Inc.	(237)	(6 481)	(9 098)	
Softwareone Holding AG	(127)	(2 454)	(3 330)	
		(507 386)	(493 619)	(2,92)
Services de communication (31 décembre 2022 : -1,44 %)				
Adevinta ASA	(2 783)	(31 524)	(24 199)	
Adways Inc.	(200)	(1 102)	(1 219)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Bittium Oyj	(136)	(1 291)	(827)	
Bolloré SE	(735)	(6 047)	(6 059)	
Borussia Dortmund GmbH & Co KGaA	(730)	(3 896)	(4 600)	
Ceres Inc.	(200)	(2 040)	(1 902)	
COOKPAD Inc.	(100)	(285)	(157)	
CTS Eventim AG & Co KGaA	(137)	(11 782)	(11 442)	
CyberAgent Inc.	(600)	(6 235)	(5 757)	
Dentsu Group Inc.	(300)	(13 713)	(12 944)	
Deutsche Telekom AG	(675)	(19 027)	(19 466)	
Domain Holdings Australia Ltd.	(4 244)	(11 471)	(14 168)	
Grupo Televisa SAB	(5 250)	(47 267)	(35 638)	
Gurunavi Inc.	(1 300)	(5 142)	(4 154)	
Herz Inc.	(200)	(2 789)	(4 019)	
Japan Communications Inc.	(800)	(1 747)	(1 772)	
Kadokawa Corp.	(100)	(3 132)	(3 149)	
Kahoot! ASA	(1 931)	(9 503)	(6 983)	
Kakaku.com Inc.	(100)	(1 889)	(1 889)	
Liberty Latin America Ltd.	(393)	(4 161)	(4 483)	
Link-U Inc.	(200)	(1 695)	(2 113)	
MFE-MediaForEurope NV, cat. A	(4 134)	(2 184)	(3 050)	
MFE-MediaForEurope NV, cat. B	(307)	(367)	(311)	
Millicom International Cellular SA	(32)	(694)	(646)	
Mobile TeleSystems PJSC	(1 375)	(12 856)	-	
MTI Ltd.	(300)	(2 268)	(1 642)	
Nippon BS Broadcasting Corp.	(200)	(1 818)	(1 692)	
NOS SGPS SA	(2 143)	(11 160)	(10 073)	
Orange SA, CAAE	(1 284)	(17 606)	(19 777)	
Rizzoli Corriere Della Sera Mediagroup SpA	(436)	(415)	(459)	
RPA Holdings Inc.	(400)	(1 658)	(1 527)	
RTL Group SA	(100)	(5 807)	(5 287)	
Septeni Holdings Co., Ltd.	(1 600)	(5 528)	(5 859)	
Stillfront Group AB	(670)	(2 617)	(1 480)	
TBS Holdings Inc.	(300)	(4 688)	(7 201)	
Telecom Argentina SA	(3 317)	(20 994)	(26 730)	
Telefonica SA	(100)	(581)	(533)	
Tow Co., Ltd.	(400)	(1 173)	(1 132)	
		(278 152)	(254 339)	(1,51)
Services publics (31 décembre 2022 : -0,60 %)				
APA Group	(16)	(138)	(137)	
Ascopiave SpA	(567)	(3 076)	(1 928)	
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC	(709)	(27 052)	(21 991)	
Central Puerto SA	(935)	(5 877)	(8 574)	
Electric Power Development Co., Ltd.	(100)	(1 934)	(1 940)	
Elmera Group ASA	(559)	(1 673)	(1 475)	
Empresa Distribuidora Y Comercializadora Norte	(31)	(365)	(633)	
Fortum Oyj	(6)	(117)	(106)	
Genesis Energy Ltd.	(1 718)	(3 914)	(3 802)	
Grenergy Renovables SA	(8)	(339)	(326)	
Italgas SpA	(656)	(5 554)	(5 138)	
Meridian Energy Ltd.	(113)	(502)	(513)	
OPC Energy Ltd.	(466)	(4 299)	(4 058)	
Orsted AS	(259)	(30 643)	(32 380)	
RWE AG	(1 033)	(62 672)	(59 458)	
Scatec ASA	(767)	(16 005)	(6 660)	
		(164 160)	(149 119)	(0,88)
Immobilier (31 décembre 2022 : -1,21 %)				
Alony Hetz Properties & Investments Ltd.	(725)	(7 777)	(7 461)	
Altisource Portfolio Solutions SA	(122)	(1 652)	(920)	
Amot Investments Ltd.	(394)	(3 059)	(2 730)	
Atenor	(158)	(13 076)	(5 976)	
Big Shopping Centers Ltd.	(19)	(2 248)	(2 258)	
Blue Square Real Estate Ltd.	(100)	(8 743)	(7 656)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
BWP Trust	(1 435)	(5 271)	(4 588)	
CA Immobilien Anlagen AG	(37)	(1 719)	(1 418)	
Cedar Woods Properties Ltd.	(682)	(2 969)	(3 022)	
Centuria Industrial REIT	(174)	(479)	(475)	
Charter Hall Group	(3 456)	(43 849)	(32 602)	
Charter Hall Long Wale REIT	(1 589)	(7 199)	(5 612)	
Charter Hall Social Infrastructure REIT	(1 793)	(5 256)	(4 643)	
Cofinimmo SA	(68)	(12 466)	(6 754)	
CRE Logistics REIT Inc.	(1)	(2 435)	(1 632)	
Daiwa House Industry Co., Ltd.	(500)	(17 521)	(17 358)	
Deutsche Wohnen SE	(306)	(13 976)	(9 330)	
Dexus Industria REIT	(1 064)	(2 468)	(2 418)	
Electra Real Estate Ltd.	(280)	(3 630)	(4 206)	
Gav-Yam Lands Corp. Ltd.	(36)	(356)	(335)	
GLP J-Reit	(2)	(3 031)	(2 602)	
Goodman Property Trust	(1 197)	(2 155)	(2 154)	
Grand City Properties SA	(242)	(2 602)	(2 514)	
Hamborner REIT AG .	(679)	(7 738)	(6 264)	
HMC Capital Ltd	(296)	(1 360)	(1 319)	
Immobel SA	(233)	(24 574)	(11 706)	
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp.	(3)	(4 476)	(4 164)	
Ingenia Communities Group	(1 104)	(4 448)	(3 870)	
Instone Real Estate Group SE	(100)	(1 102)	(793)	
Invincible Investment Corp.	(19)	(10 622)	(9 950)	
Isras Investment Co., Ltd.	(40)	(10 212)	(9 746)	
Japan Hotel REIT Investment Corp.	(3)	(2 223)	(2 019)	
Japan Logistics Fund Inc.	(2)	(5 781)	(5 722)	
Japan Metropolitan Fund Invest	(10)	(10 252)	(8 816)	
JINUSHI Co., Ltd.	(300)	(5 713)	(5 218)	
JSB Co., Ltd.	(300)	(12 188)	(13 843)	
Kiwi Property Group Ltd.	(3 050)	(2 375)	(2 250)	
Mega Or Holdings Ltd.	(50)	(1 406)	(1 368)	
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	(1 300)	(34 015)	(34 045)	
Miyakoshi Holdings Inc.	(200)	(1 754)	(1 558)	
Mobimo Holding AG	(5)	(2 060)	(1 782)	
Palace Capital PLC	(100)	(423)	(389)	
Peach Property Group AG	(52)	(930)	(1 021)	
Prashkovsky Investments and Construction Ltd.	(150)	(4 601)	(4 812)	
Region RE Ltd.	(2 385)	(5 264)	(4 769)	
SAMTY Co., Ltd.	(200)	(4 083)	(4 098)	
Stendorren Fastigheter AB	(104)	(2 280)	(2 072)	
TAG Immobilien AG	(193)	(2 038)	(2 413)	
Takara Leben Real Estate Investment Corp.	(2)	(1 829)	(1 769)	
Tosei Reit Investment Corp.	(2)	(3 187)	(2 443)	
Vicinity Ltd.	(211)	(381)	(343)	
Vital Healthcare Property Trust	(3 521)	(6 847)	(6 679)	
Wallenstam AB	(226)	(1 060)	(1 011)	
Warehouses De Pauw CVA	(8)	(347)	(290)	
		<u>(339 506)</u>	<u>(285 206)</u>	(1,69)
Total des actions étrangères – position vendeur		<u>(6 012 115)</u>	<u>(5 864 036)</u>	(34,70)
Commissions de courtage intégrées (note 3)		<u>(10 665)</u>		

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Total des placements		6 427 059	7 261 967	42,98
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			233 257	1,38
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			(31 918)	(0,19)
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			310 539	1,84
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			(578 351)	(3,42)
Autres actifs, moins les passifs			9 700 060	57,41
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			16 895 554	100,00

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Contrats de change à terme (Annexe 1) (non audité)

Au 30 juin 2023

Contrepartie*	Code de devise	Montant vendu	Code de devise	Montant acheté	Date d'échéance	Plus-value (moins-value) latente \$
Banque Royale du Canada	ILS	(730 000)	USD	203 198	20 sept. 2023	7 656
Banque Royale du Canada	JPY	(188 456 000)	USD	1 370 562	20 sept. 2023	64 717
Banque Royale du Canada	JPY	(17 463 000)	USD	125 174	20 sept. 2023	3 612
Banque Royale du Canada	SEK	(4 240 000)	USD	394 116	20 sept. 2023	6
Banque Royale du Canada	USD	(11 960 460)	CAD	15 963 000	20 sept. 2023	154 943
Banque Royale du Canada	ZAR	(2 102 000)	USD	112 109	20 sept. 2023	2 323
						233 257
Banque Royale du Canada	CHF	(317 000)	USD	352 211	20 sept. 2023	(6 855)
Banque Royale du Canada	DKK	(1 848 000)	USD	268 190	20 sept. 2023	(5 212)
Banque Royale du Canada	EUR	(646 000)	USD	698 037	20 sept. 2023	(12 674)
Banque Royale du Canada	JPY	(21 043 000)	USD	147 265	20 sept. 2023	(309)
Banque Royale du Canada	NOK	(2 434 000)	USD	225 661	20 sept. 2023	(2 854)
Banque Royale du Canada	USD	(446 318)	CAD	588 000	20 sept. 2023	(1 810)
Banque Royale du Canada	USD	(197 514)	GBP	154 000	20 sept. 2023	(2 204)
						(31 918)
						201 339

* Toutes les contreparties ont une notation de AA ou mieux.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
Contreparties : La Banque de Nouvelle-Écosse, notation AA				
Swaps d'actions – position acheteur				
Dollar australien – taux de swap des acceptations bancaires (BBSW) à 1 mois				
2 875	31 juill. 2023	Firefinch Ltd, swap sur rendement total	506	61
466	31 juill. 2023	Ten Sixty Four Ltd, swap sur rendement total	234	(1)
				<u>60</u>
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
246	31 juill. 2023	4Imprint Group Plc, swap sur rendement total	19 844	710
1 166	31 juill. 2023	888 Holdings Plc, swap sur rendement total	1 922	547
164	31 juill. 2023	Aj Bell Plc, swap sur rendement total	886	2
615	31 juill. 2023	Alfa Financial Software Hold, swap sur rendement total	2 018	289
344	31 juill. 2023	Ascential Plc, swap sur rendement total	1 281	(24)
208	31 juill. 2023	Asos Plc, swap sur rendement total	1 339	122
1 384	31 juill. 2023	Aston Martin Lagonda Global, swap sur rendement total	8 266	1 093
3 726	31 juill. 2023	Auto Trader Group Plc, swap sur rendement total	38 262	(1 396)
706	31 juill. 2023	Babcock Intl Group Plc, swap sur rendement total	3 356	(317)
857	31 juill. 2023	Bakkavor Group Plc, swap sur rendement total	1 370	67
256	31 juill. 2023	Bank Of Georgia Group Plc, swap sur rendement total	13 347	316
805	31 juill. 2023	Beazley Plc, swap sur rendement total	7 977	(252)
334	31 juill. 2023	Bellway Plc, swap sur rendement total	11 423	(1 398)
585	31 juill. 2023	Bodycote Plc, swap sur rendement total	6 308	7
333	31 juill. 2023	Breedon Group Plc, swap sur rendement total	1 826	(87)
385	31 juill. 2023	British Land Co Plc, swap sur rendement total	2 033	51
846	31 juill. 2023	Brown (N) Group Plc, swap sur rendement total	332	(68)
3 468	31 juill. 2023	Bt Group Plc, swap sur rendement total	7 138	(63)
1 237	31 juill. 2023	Burford Capital Ltd, swap sur rendement total	19 947	(2 523)
2 302	31 juill. 2023	Centamin Plc, swap sur rendement total	3 530	(358)
159	31 juill. 2023	Chemring Group Plc, swap sur rendement total	757	70
42	31 juill. 2023	Close Brothers Group Plc, swap sur rendement total	623	32
4 476	31 juill. 2023	Convatec Group Plc, swap sur rendement total	15 452	12
50	31 juill. 2023	Craneware Plc, swap sur rendement total	1 148	(21)
764	31 juill. 2023	Currys Plc, swap sur rendement total	673	22
29	31 juill. 2023	Cvs Group Plc, swap sur rendement total	965	(61)
4 184	31 juill. 2023	Deliveroo Plc, swap sur rendement total	8 059	654
232	31 juill. 2023	Derwent London Plc, swap sur rendement total	8 001	(342)
174	31 juill. 2023	Diploma Plc, swap sur rendement total	8 735	(192)
27	31 juill. 2023	Discoverie Group Plc, swap sur rendement total	385	20
197	31 juill. 2023	Drax Group Plc, swap sur rendement total	1 922	(31)
4 412	31 juill. 2023	Easyjet Plc, swap sur rendement total	35 820	(69)
866	31 juill. 2023	Entain Plc, swap sur rendement total	18 532	(753)
598	31 juill. 2023	Equals Group Plc, swap sur rendement total	936	(53)
174	31 juill. 2023	Fdm Group Holdings Plc, swap sur rendement total	1 642	(326)
908	31 juill. 2023	Finsbury Food Group Plc, swap sur rendement total	1 428	18
4 162	31 juill. 2023	Firstgroup Plc, swap sur rendement total	10 216	1 255
448	31 juill. 2023	Galliford Try Plc, swap sur rendement total	1 467	104
718	31 juill. 2023	Genel Energy Plc, swap sur rendement total	1 249	(102)
20	31 juill. 2023	Genus Plc, swap sur rendement total	729	(59)
359	31 juill. 2023	Greggs Plc, swap sur rendement total	15 425	(792)
3 067	31 juill. 2023	Halfords Group Plc, swap sur rendement total	11 124	568
16 553	31 juill. 2023	Hammerson Plc, swap sur rendement total	6 934	4
2 415	31 juill. 2023	Hargreaves Lansdown Plc, swap sur rendement total	33 136	436
500	31 juill. 2023	Hiscox Ltd, swap sur rendement total	9 177	(725)
529	31 juill. 2023	Hollywood Bowl Group Plc, swap sur rendement total	2 250	(192)
496	31 juill. 2023	Hostelworld Group Plc, swap sur rendement total	1 060	45
704	31 juill. 2023	Hunting Plc, swap sur rendement total	2 362	(219)
788	31 juill. 2023	Ibstock Plc, swap sur rendement total	1 855	(255)
195	31 juill. 2023	Imi Plc, swap sur rendement total	5 380	68
123	31 juill. 2023	Inchcape Plc, swap sur rendement total	1 609	24
1 209	31 juill. 2023	Informa Plc, swap sur rendement total	14 905	673
7 310	31 juill. 2023	Investec Plc, swap sur rendement total	54 208	3 358

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
4 229	31 juill. 2023	Itv Plc, swap sur rendement total	4 859	(125)
2 221	31 juill. 2023	Iwg Plc, swap sur rendement total	5 149	(298)
12 566	31 juill. 2023	Just Group Plc, swap sur rendement total	16 447	(1 439)
1 260	31 juill. 2023	Kainos Group Plc, swap sur rendement total	26 115	(1 168)
567	31 juill. 2023	Keller Group Plc, swap sur rendement total	6 677	177
429	31 juill. 2023	Kier Group Plc, swap sur rendement total	542	(20)
379	31 juill. 2023	Lancashire Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 685	(284)
2 766	31 juill. 2023	Learning Technologies Group, swap sur rendement total	3 899	(777)
87 509	31 juill. 2023	Lloyds Banking Group Plc, swap sur rendement total	64 172	(939)
2 768	31 juill. 2023	Lookers Plc, swap sur rendement total	5 569	1 789
123	31 juill. 2023	M&C Saatchi Plc, swap sur rendement total	318	(35)
3 038	31 juill. 2023	Man Group Plc/Jersey, swap sur rendement total	11 167	(104)
4 414	31 juill. 2023	Marks & Spencer Group Plc, swap sur rendement total	14 309	354
1 028	31 juill. 2023	Marston'S Plc, swap sur rendement total	508	(40)
391	31 juill. 2023	Mears Group Plc, swap sur rendement total	1 914	316
1 193	31 juill. 2023	Mitchells & Butlers Plc, swap sur rendement total	4 098	(24)
3 576	31 juill. 2023	Mitie Group Plc, swap sur rendement total	5 932	555
906	31 juill. 2023	Mobico Group Plc, swap sur rendement total	1 482	(114)
1 824	31 juill. 2023	Moneysupermarket.Com, swap sur rendement total	8 310	571
1 785	31 juill. 2023	Morgan Advanced Materials Pl, swap sur rendement total	8 444	(275)
560	31 juill. 2023	Morgan Sindall Group Plc, swap sur rendement total	17 240	39
3 922	31 juill. 2023	Natwest Group Plc, swap sur rendement total	15 888	449
3 378	31 juill. 2023	Ncc Group Plc, swap sur rendement total	5 495	311
289	31 juill. 2023	Netcall Plc, swap sur rendement total	496	(62)
899	31 juill. 2023	Ninety One Plc, swap sur rendement total	2 541	59
2 325	31 juill. 2023	Onesavings Bank Plc, swap sur rendement total	18 775	(463)
477	31 juill. 2023	Oxford Instruments Plc, swap sur rendement total	21 907	(369)
325	31 juill. 2023	Oxford Nanopore Technologies, swap sur rendement total	1 166	(319)
2 936	31 juill. 2023	Pan African Resources Plc, swap sur rendement total	618	(59)
632	31 juill. 2023	Paragon Banking Group Plc, swap sur rendement total	5 646	194
3 527	31 juill. 2023	Pendragon Plc, swap sur rendement total	1 048	17
947	31 juill. 2023	Persimmon Plc, swap sur rendement total	16 338	(2 389)
6 291	31 juill. 2023	Premier Foods Plc, swap sur rendement total	13 636	(535)
604	31 juill. 2023	Primary Health Properties, swap sur rendement total	970	(462)
606	31 juill. 2023	Puretech Health Plc, swap sur rendement total	2 217	(19)
933	31 juill. 2023	Pz Cussons Plc, swap sur rendement total	2 543	(356)
2 155	31 juill. 2023	Rank Group Plc, swap sur rendement total	3 205	(321)
58	31 juill. 2023	Reach Plc, swap sur rendement total	65	(6)
342	31 juill. 2023	Redde Plc, swap sur rendement total	2 158	1
477	31 juill. 2023	Renew Holdings Plc, swap sur rendement total	6 018	250
681	31 juill. 2023	Renewi Plc, swap sur rendement total	5 900	(241)
59	31 juill. 2023	Renishaw Plc, swap sur rendement total	3 873	(159)
257	31 juill. 2023	Rightmove Plc, swap sur rendement total	2 262	(15)
62 208	31 juill. 2023	Rolls-Royce Holdings Plc, swap sur rendement total	158 079	6 988
743	31 juill. 2023	Safestore Holdings Plc, swap sur rendement total	10 612	(858)
1 251	31 juill. 2023	Sainsbury (J) Plc, swap sur rendement total	5 855	179
2 923	31 juill. 2023	Schroders Plc, swap sur rendement total	21 504	(974)
3 995	31 juill. 2023	Segro Plc, swap sur rendement total	48 175	(5 624)
1 249	31 juill. 2023	Senior Plc, swap sur rendement total	3 686	155
6 146	31 juill. 2023	Serco Group Plc, swap sur rendement total	16 099	1 269
293	31 juill. 2023	Sirius Real Estate Ltd, swap sur rendement total	421	11
986	31 juill. 2023	Smiths News Plc, swap sur rendement total	800	(70)
763	31 juill. 2023	Somero Enterprises Inc., actions ord., swap sur rendement total	3 568	(595)
28	31 juill. 2023	Spirax-Sarco Engineering Plc, swap sur rendement total	4 882	(59)
305	31 juill. 2023	Spire Healthcare Group Plc, swap sur rendement total	1 090	(58)
3 472	31 juill. 2023	Spirent Communications Plc, swap sur rendement total	9 556	(942)
1 241	31 juill. 2023	Ssp Group Plc, swap sur rendement total	5 236	(407)
6 509	31 juill. 2023	Taylor Wimpey Plc, swap sur rendement total	11 251	(1 307)
45	31 juill. 2023	Telecom Plus Plc, swap sur rendement total	1 279	97
100	31 juill. 2023	Ten Entertainment Group Plc, swap sur rendement total	471	3
4 312	31 juill. 2023	Tesco Plc, swap sur rendement total	18 019	(428)
1 699	31 juill. 2023	Tp Icap Plc, swap sur rendement total	4 322	(32)
2 235	31 juill. 2023	Trustpilot Group Plc, swap sur rendement total	2 553	(489)
7 406	31 juill. 2023	Tullow Oil Plc, swap sur rendement total	3 518	335
579	31 juill. 2023	Tyman Plc, swap sur rendement total	2 498	(119)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
2 019	31 juill. 2023	Vertu Motors Plc, swap sur rendement total	2 474	376
989	31 juill. 2023	Victorian Plumbing Plc, swap sur rendement total	1 114	(188)
51	31 juill. 2023	Vistry Group Plc, swap sur rendement total	567	(57)
356	31 juill. 2023	Volex Plc, swap sur rendement total	1 698	110
491	31 juill. 2023	Weir Group Plc/The, swap sur rendement total	14 505	300
412	31 juill. 2023	Wetherspoon (J.D.) Plc, swap sur rendement total	4 661	(405)
1 918	31 juill. 2023	Wincanton Plc, swap sur rendement total	8 115	67
488	31 juill. 2023	Wizz Air Holdings Plc, swap sur rendement total	22 454	(561)
144	31 juill. 2023	Wynnstay Group Plc, swap sur rendement total	1 145	87
230	31 juill. 2023	Xp Power Ltd, swap sur rendement total	7 684	(419)
				<u>(10 061)</u>
Euro – taux à court terme (ESTR)				
39 039	31 juill. 2023	Air France-Klm, swap sur rendement total	97 107	1 997
18	31 juill. 2023	Akwel, swap sur rendement total	350	(16)
3 810	31 juill. 2023	Alstom, swap sur rendement total	150 270	8 287
184	31 juill. 2023	Alten Sa, swap sur rendement total	38 331	(1 133)
278	31 juill. 2023	Assystem, swap sur rendement total	19 023	1 075
125	31 juill. 2023	Aubay, swap sur rendement total	8 590	234
592	31 juill. 2023	Axa Sa, swap sur rendement total	23 097	317
100	31 juill. 2023	Axway Software Sa, swap sur rendement total	3 003	(51)
108	31 juill. 2023	Bank Of Ireland Group Plc, swap sur rendement total	1 362	14
1	31 juill. 2023	Bawag Group Ag, swap sur rendement total	61	2
100	31 juill. 2023	Believe Sa, swap sur rendement total	1 643	15
331	31 juill. 2023	Beneteau, swap sur rendement total	7 397	(141)
876	31 juill. 2023	Bouygues Sa, swap sur rendement total	38 901	867
956	31 juill. 2023	Bureau Veritas Sa, swap sur rendement total	34 669	1 589
29 506	31 juill. 2023	Caixabank Sa, swap sur rendement total	161 314	14 908
9	31 juill. 2023	Cargotec Oyj, actions, B, swap sur rendement total	654	5
878	31 juill. 2023	Carrefour Sa, swap sur rendement total	21 998	1 227
23	31 juill. 2023	Christian Dior Se, swap sur rendement total	26 995	1 237
6	31 juill. 2023	Commerzbank Ag, swap sur rendement total	88	6
136	31 juill. 2023	Compagnie De Saint Gobain, swap sur rendement total	10 942	195
274	31 juill. 2023	Compagnie Des Alpes, swap sur rendement total	5 475	(212)
251	31 juill. 2023	Covivio, swap sur rendement total	15 647	(862)
142	31 juill. 2023	Crédit Agricole Sa, swap sur rendement total	2 229	82
54	31 juill. 2023	Dassault Aviation Sa, swap sur rendement total	14 297	1 887
247	31 juill. 2023	Derichebourg, swap sur rendement total	1 815	65
6	31 juill. 2023	Duerr Ag, swap sur rendement total	257	18
15	31 juill. 2023	Eckert & Ziegler Strahlen Un, swap sur rendement total	788	(86)
86	31 juill. 2023	Elior Group, swap sur rendement total	326	(23)
127	31 juill. 2023	Elis Sa, swap sur rendement total	3 264	(240)
14	31 juill. 2023	Erste Group Bank Ag, swap sur rendement total	649	34
23	31 juill. 2023	Esker Sa, swap sur rendement total	4 602	(182)
81	31 juill. 2023	Eurofins Scientific, swap sur rendement total	6 801	83
28	31 juill. 2023	Flatex Ag, swap sur rendement total	367	10
606	31 juill. 2023	F-Secure Corp, swap sur rendement total	2 043	(285)
43	31 juill. 2023	Groupe Crit, swap sur rendement total	4 594	(24)
204	31 juill. 2023	Intl Consolidated Airline-Di, swap sur rendement total	556	24
31	31 juill. 2023	Ipsen, swap sur rendement total	4 932	80
100	31 juill. 2023	Jacquet Metal Service Sa, swap sur rendement total	2 743	95
126	31 juill. 2023	Kbc Group Nv, swap sur rendement total	11 627	465
219	31 juill. 2023	Kering, swap sur rendement total	159 852	1 600
4	31 juill. 2023	Kingspan Group Plc, swap sur rendement total	352	1
88	31 juill. 2023	Legrand Sa, swap sur rendement total	11 535	349
345	31 juill. 2023	Lisi, swap sur rendement total	13 099	652
169	31 juill. 2023	Maurel Et Prom, swap sur rendement total	953	53
63	31 juill. 2023	Mersen, swap sur rendement total	3 774	512
31	31 juill. 2023	Metso Oyj, swap sur rendement total	494	35
166	31 juill. 2023	Michelin (Cgde), swap sur rendement total	6 485	143
50	31 juill. 2023	Mlp Se, swap sur rendement total	433	69
52	31 juill. 2023	Nexans Sa, swap sur rendement total	5 957	518
15	31 juill. 2023	Nordex Se, swap sur rendement total	241	(4)
968	31 juill. 2023	Origin Enterprises Plc, swap sur rendement total	4 661	(249)
284	31 juill. 2023	Raiffeisen Bank Internationa, swap sur rendement total	5 953	320
106	31 juill. 2023	Rothschild & Co, swap sur rendement total	7 123	1
134	31 juill. 2023	Schneider Electric Se, swap sur rendement total	32 202	1 044

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
5	31 juill. 2023	Ses Imagotag, swap sur rendement total	679	(420)
361	31 juill. 2023	Smcp Sa, swap sur rendement total	4 159	291
4 822	31 juill. 2023	Société Générale Sa, swap sur rendement total	165 680	12 642
57	31 juill. 2023	Sopra Steria Group, swap sur rendement total	15 042	504
81	31 juill. 2023	Stef, swap sur rendement total	12 723	528
6 288	31 juill. 2023	Stellantis Nv, swap sur rendement total	145 971	14 497
13	31 juill. 2023	Stmicroelectronics Nv, swap sur rendement total	855	7
16	31 juill. 2023	Suess Microtec Se, swap sur rendement total	562	(11)
12	31 juill. 2023	Synergie Sa, swap sur rendement total	570	21
32	31 juill. 2023	Tomtom, swap sur rendement total	329	(2)
596	31 juill. 2023	Ubisoft Entertainment, swap sur rendement total	22 268	(622)
1 697	31 juill. 2023	Valeo Sa, swap sur rendement total	48 092	2 795
1 649	31 juill. 2023	Veolia Environnement, swap sur rendement total	68 919	3 165
2 175	31 juill. 2023	Withsecure Oyj, swap sur rendement total	3 677	(639)
81	31 juill. 2023	Worldline Sa, swap sur rendement total	3 917	104
163	31 juill. 2023	X-Fab Silicon Foundries Se, swap sur rendement total	2 334	343
				<u>69 810</u>
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
1 000	31 juill. 2023	China Aoyuan Group Ltd., swap sur rendement total	199	16
11 000	31 juill. 2023	China Evergrande New Energy, swap sur rendement total	5 944	(20)
4 997	31 juill. 2023	Shimao Property Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 729	2 702
				<u>2 698</u>
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
104	31 juill. 2023	Absa Group Ltd, swap sur rendement total	1 223	66
431	31 juill. 2023	Afrimat Ltd, swap sur rendement total	1 846	246
1 055	31 juill. 2023	Alexander Forbes Group Holdi, swap sur rendement total	418	12
1 190	31 juill. 2023	Arcelormittal South Africa, swap sur rendement total	298	7
6 955	31 juill. 2023	Arrowhead Properties Ltd-B, swap sur rendement total	1 423	(71)
301	31 juill. 2023	Aspen Pharmacare Holdings Lt, swap sur rendement total	3 871	222
471	31 juill. 2023	Bid Corp Ltd, swap sur rendement total	13 635	(289)
49	31 juill. 2023	Bidvest Group Ltd, swap sur rendement total	898	56
142	31 juill. 2023	Discovery Ltd, swap sur rendement total	1 451	122
2 209	31 juill. 2023	Firststrand Ltd, swap sur rendement total	10 599	761
1 488	31 juill. 2023	Grindrod Ltd, swap sur rendement total	997	49
100	31 juill. 2023	Hosken Cons Investments Ltd, swap sur rendement total	1 571	119
68	31 juill. 2023	Impala Platinum Holdings Ltd, swap sur rendement total	597	(115)
477	31 juill. 2023	Investec Property Fund Ltd, swap sur rendement total	248	(5)
150	31 juill. 2023	Lewis Group Ltd, swap sur rendement total	417	-
7 914	31 juill. 2023	Merafe Resources Ltd, swap sur rendement total	621	(32)
105	31 juill. 2023	Multichoice Group Ltd, swap sur rendement total	702	(26)
239	31 juill. 2023	Outsurance Group Ltd, swap sur rendement total	569	36
2 156	31 juill. 2023	Ppc Ltd, swap sur rendement total	409	67
446	31 juill. 2023	Psg Konsult Ltd, swap sur rendement total	412	52
693	31 juill. 2023	Sappi Limited, swap sur rendement total	1 894	(218)
22	31 juill. 2023	Sasol Ltd, swap sur rendement total	359	3
1 006	31 juill. 2023	Sun International Ltd, swap sur rendement total	2 416	(214)
110	31 juill. 2023	Thungela Resources Ltd, swap sur rendement total	1 140	86
418	31 juill. 2023	Tsogo Sun Gaming Ltd, swap sur rendement total	374	15
				<u>949</u>
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
750	31 juill. 2023	Addtech Ab, actions, B, swap sur rendement total	21 574	1 079
188	31 juill. 2023	Alimak Group Ab, swap sur rendement total	1 939	157
100	31 juill. 2023	Beijer Alma Ab, swap sur rendement total	2 763	(183)
255	31 juill. 2023	Bonesupport Holding Ab, swap sur rendement total	3 986	287
52	31 juill. 2023	Electrolux Ab - série B, swap sur rendement total	938	25
500	31 juill. 2023	Elekta Ab, actions, B, swap sur rendement total	5 105	212
31	31 juill. 2023	Hennes & Mauritz Ab, actions, B, swap sur rendement total	703	187
127	31 juill. 2023	Hexatronic Group Ab, swap sur rendement total	1 251	197
43	31 juill. 2023	Intrum Ab, swap sur rendement total	369	(42)
720	31 juill. 2023	Lagercrantz Group Ab, actions, B, swap sur rendement total	12 261	635
317	31 juill. 2023	Lindab International Ab, swap sur rendement total	5 957	(648)
500	31 juill. 2023	Net Insight Ab-B, swap sur rendement total	295	(17)
19	31 juill. 2023	Nibe Industrier Ab, actions, B, swap sur rendement total	238	(3)
66	31 juill. 2023	Np3 Fastigheter Ab, swap sur rendement total	1 317	(92)
8	31 juill. 2023	Paradox Interactive Ab, swap sur rendement total	267	6
133	31 juill. 2023	Proact It Group Ab, swap sur rendement total	1 289	21

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
600	31 juill. 2023	Systemair Ab, swap sur rendement total	5 777	(579)
54	31 juill. 2023	Tobii Ab, swap sur rendement total	110	(17)
200	31 juill. 2023	Volati Ab, swap sur rendement total	2 764	(39)
				<u>1 186</u>
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
73	31 juill. 2023	Ascom Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	1 179	138
15	31 juill. 2023	Bell Food Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	5 646	(262)
13	31 juill. 2023	Berner Kantonalbank Ag, actions ord., swap sur rendement total	4 461	(63)
7	31 juill. 2023	Bossard Holding Ag, actions ord., A, swap sur rendement total	2 058	(117)
4	31 juill. 2023	Lem Holding Sa, actions ord., swap sur rendement total	13 252	1 138
12	31 juill. 2023	Sig Combibloc Group Ag, swap sur rendement total	438	(7)
1	31 juill. 2023	Swissquote Group Holding, actions ord., swap sur rendement total	275	-
47	31 juill. 2023	Thurgauer Kantonalbank-Cert, swap sur rendement total	8 377	(248)
18	31 juill. 2023	U-Blox Holding Ag, swap sur rendement total	2 612	(511)
100	31 juill. 2023	Varia Us Properties Ag, swap sur rendement total	5 517	25
				<u>93</u>
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
48 400	31 juill. 2023	Alfa S.A.B.-A, swap sur rendement total	39 845	24
1 300	31 juill. 2023	Azul Sa, swap sur rendement total	7 855	2 127
100	31 juill. 2023	B3 Sa-Brasil Bolsa Balcao, swap sur rendement total	405	22
2 900	31 juill. 2023	Banco Do Brasil Sa -, swap sur rendement total	39 599	5 705
100	31 juill. 2023	Bb Seguridade Participacoes, swap sur rendement total	851	43
400	31 juill. 2023	Braskem Sa, actions priv., A, swap sur rendement total	3 080	737
700	31 juill. 2023	C&A Modas Ltda, swap sur rendement total	1 051	211
7 900	31 juill. 2023	Camil Alimentos Sa, swap sur rendement total	15 417	897
841	31 juill. 2023	Celsia Sa Esp, swap sur rendement total	715	37
1 109	31 juill. 2023	Cementos Argos Sa	1 196	77
44	31 juill. 2023	Cia Energetica Minas Ger, actions priv., swap sur rendement total	156	22
6 300	31 juill. 2023	Cia Saneamento Minas Gerais, swap sur rendement total	37 421	3 781
189 713	31 juill. 2023	Cia Sud Americana De Vapores, swap sur rendement total	17 036	(1 494)
2 700	31 juill. 2023	Cielo Sa, swap sur rendement total	3 426	125
400	31 juill. 2023	Construtora Tenda Sa, swap sur rendement total	1 272	395
2 100	31 juill. 2023	Cruzeiro Do Sul Educacional, swap sur rendement total	2 235	385
1 500	31 juill. 2023	Csu Cardsystem S A Com Npv, swap sur rendement total	5 518	362
300	31 juill. 2023	Dimed Sa Distribuidora De Me, swap sur rendement total	1 061	151
3 900	31 juill. 2023	Ecorodovias Infra E Log Sa, swap sur rendement total	7 007	470
4 900	31 juill. 2023	Eternit Sa, swap sur rendement total	15 113	1 167
200	31 juill. 2023	Eucatex Sa Industria, actions priv., swap sur rendement total	622	86
1 000	31 juill. 2023	Fras-Le Sa, swap sur rendement total	3 538	286
27 400	31 juill. 2023	Gentera Sab De Cv, swap sur rendement total	38 866	(273)
300	31 juill. 2023	Gol Linhas Aereas, actions priv., swap sur rendement total	1 092	441
600	31 juill. 2023	Grupo Comercial Chedraui Sa, swap sur rendement total	4 532	401
1 817	31 juill. 2023	Grupo Energia Bogota Sa Esp, swap sur rendement total	1 115	154
42	31 juill. 2023	Grupo Nutresa Sa, swap sur rendement total	699	(29)
7 800	31 juill. 2023	Guararapes Confeccoes Sa, swap sur rendement total	16 688	6 719
8 500	31 juill. 2023	Hidroviias Do Brasil Sa, swap sur rendement total	7 471	636
1 300	31 juill. 2023	Hypera Sa, swap sur rendement total	16 533	2 344
185	31 juill. 2023	Hyundai Motor Co, actions ord., S, CIAE, swap sur rendement total	10 061	504
318	31 juill. 2023	Interconexion Electrica Sa, swap sur rendement total	1 704	32
420	31 juill. 2023	Inversiones Aguas Metropol, swap sur rendement total	454	9
5 100	31 juill. 2023	Iochpe-Maxion S.A., swap sur rendement total	17 607	469
815 697	31 juill. 2023	Latam Airlines Group Sa, swap sur rendement total	10 207	549
400	31 juill. 2023	M Dias Branco Sa , swap sur rendement total	4 707	632
900	31 juill. 2023	Mahle-Metal Leve Sa, swap sur rendement total	11 578	1 209
35 500	31 juill. 2023	Marcopolo Sa, actions priv., swap sur rendement total	51 124	6 424
20 802	31 juill. 2023	Masisa Sa, swap sur rendement total	816	40
8 700	31 juill. 2023	Metalurgica Gerdau Sa, swap sur rendement total	28 425	2 996
800	31 juill. 2023	Mills Estruturas E Servicos, swap sur rendement total	2 509	(112)
2 000	31 juill. 2023	Multipan Empreendimentos, swap sur rendement total	15 297	762
400	31 juill. 2023	Neoenergia Sa, swap sur rendement total	2 347	272
1 166	31 juill. 2023	Parque Arauco S.A., swap sur rendement total	2 481	50
2 200	31 juill. 2023	Porto Seguro Sa, swap sur rendement total	17 100	3 320
6 900	31 juill. 2023	Positivo Tecnologia Sa -, swap sur rendement total	18 222	5 999
3 300	31 juill. 2023	Profarma Distribuidora, swap sur rendement total	3 594	559
7 300	31 juill. 2023	Randon Participacoes Sa, actions priv., swap sur rendement total	24 557	4 026
15 767	31 juill. 2023	Smu Sa, swap sur rendement total	3 670	127

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
3 015	31 juill. 2023	Sonda Sa, swap sur rendement total	1 940	(95)
2 900	31 juill. 2023	Syn Prop E Tech Sa, swap sur rendement total	3 190	195
3 300	31 juill. 2023	Taurus Armas, swap sur rendement total	13 746	686
800	31 juill. 2023	Totvs Sa, swap sur rendement total	6 630	585
3 700	31 juill. 2023	Usinas Sider Minas Ger, actions priv., A, swap sur rendement total	7 231	446
2 100	31 juill. 2023	Valid Solucoes Sa, swap sur rendement total	8 504	702
3 200	31 juill. 2023	Vibra Energia Sa, swap sur rendement total	15 966	2 508
500	31 juill. 2023	Vulcabras Azaleia Sa, swap sur rendement total	2 391	151
100	31 juill. 2023	Weg Sa, swap sur rendement total	1 045	40
100	31 juill. 2023	Wilson Sons Holdings Brasil, swap sur rendement total	373	89
9 900	31 juill. 2023	Wiz Co, swap sur rendement total	17 240	2 128
1 400	31 juill. 2023	Yduqs Part, swap sur rendement total	7 670	1 999
12 200	31 juill. 2023	Zamp Sa, swap sur rendement total	15 344	3 217
				<u>66 527</u>
				<u>131 262</u>

Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position acheteur

Swaps d'actions – position vendeur

Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)

(2 131)	31 juill. 2023	4D Pharma Plc, swap sur rendement total	(597)	2
(220)	31 juill. 2023	Ab Dynamics Plc, swap sur rendement total	(6 958)	581
(1 453)	31 juill. 2023	Alliance Pharma Plc, swap sur rendement total	(1 247)	261
(78)	31 juill. 2023	Antofagasta Plc, swap sur rendement total	(1 917)	(94)
(3 491)	31 juill. 2023	Aviva Plc, swap sur rendement total	(23 210)	76
(243)	31 juill. 2023	Barclays Plc, swap sur rendement total	(627)	(6)
(1 402)	31 juill. 2023	Batm Advanced Communications, swap sur rendement total	(622)	(59)
(395)	31 juill. 2023	Berkeley Group Holdings/The, swap sur rendement total	(26 069)	(121)
(472)	31 juill. 2023	Bhp Group Ltd-Di, swap sur rendement total	(18 581)	931
(623)	31 juill. 2023	Big Yellow Group Plc, swap sur rendement total	(11 246)	307
(12 789)	31 juill. 2023	Boohoo Group Plc, swap sur rendement total	(7 291)	1 157
(72)	31 juill. 2023	Boot (Henry) Plc, swap sur rendement total	(254)	30
(834)	31 juill. 2023	Bunzl Plc, swap sur rendement total	(42 714)	573
(2 125)	31 juill. 2023	C&C Group Plc, swap sur rendement total	(4 484)	533
(683)	31 juill. 2023	Cairn Energy Plc, swap sur rendement total	(2 146)	109
(4 968)	31 juill. 2023	Cairn Homes Plc, swap sur rendement total	(8 333)	(707)
(8 057)	31 juill. 2023	Centrica Plc, swap sur rendement total	(17 072)	(1 054)
(186)	31 juill. 2023	Chesnara Plc, swap sur rendement total	(846)	31
(8 298)	31 juill. 2023	Costain Group Plc, swap sur rendement total	(6 422)	698
(169)	31 juill. 2023	Crest Nicholson Holdings, swap sur rendement total	(536)	109
(590)	31 juill. 2023	Croda International Plc, swap sur rendement total	(55 842)	658
(27)	31 juill. 2023	Dcc Plc, swap sur rendement total	(2 055)	22
(2 301)	31 juill. 2023	De La Rue Plc, swap sur rendement total	(1 858)	(351)
(817)	31 juill. 2023	Diageo Plc, swap sur rendement total	(46 443)	(558)
(4 850)	31 juill. 2023	Direct Line Insurance Group, swap sur rendement total	(11 092)	2 363
(5 760)	31 juill. 2023	Diversified Energy Co Plc, swap sur rendement total	(8 566)	(291)
(241)	31 juill. 2023	Dr. Martens Plc, swap sur rendement total	(513)	60
(622)	31 juill. 2023	Ekf Diagnostics Holdings Plc, swap sur rendement total	(330)	(8)
(3 140)	31 juill. 2023	Elementis Plc, swap sur rendement total	(5 388)	284
(654)	31 juill. 2023	Empiric Student Property Plc, swap sur rendement total	(926)	77
(646)	31 juill. 2023	Energiean Plc, swap sur rendement total	(11 129)	936
(904)	31 juill. 2023	Essentra Plc, swap sur rendement total	(2 467)	319
(363)	31 juill. 2023	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(96 487)	(43)
(446)	31 juill. 2023	Fresnillo Plc, swap sur rendement total	(4 578)	306
(29)	31 juill. 2023	Frontier Developments Plc, swap sur rendement total	(288)	(25)
(333)	31 juill. 2023	Future Plc, swap sur rendement total	(3 781)	277
(20)	31 juill. 2023	Gamma Communications Plc, swap sur rendement total	(384)	5
(100)	31 juill. 2023	Globaldata Plc, swap sur rendement total	(2 061)	201
(2 920)	31 juill. 2023	Grainger Plc, swap sur rendement total	(11 273)	975
(145)	31 juill. 2023	Great Portland Estates Plc, swap sur rendement total	(1 032)	152
(9 800)	31 juill. 2023	Greatland Gold Plc, swap sur rendement total	(1 187)	119
(270)	31 juill. 2023	Gulf Keystone Petroleum Ltd, swap sur rendement total	(546)	58
(6 747)	31 juill. 2023	Gym Group Plc/The, swap sur rendement total	(10 352)	558
(20 886)	31 juill. 2023	Haleon Plc, swap sur rendement total	(113 228)	(333)
(100)	31 juill. 2023	Hargreaves Services Plc, swap sur rendement total	(668)	(3)
(27)	31 juill. 2023	Headlam Group Plc, swap sur rendement total	(113)	(3)
(2 150)	31 juill. 2023	Helical Plc, swap sur rendement total	(9 719)	(881)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(913)	31 juill. 2023	Hikma Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	(29 037)	(1 309)
(611)	31 juill. 2023	Hill & Smith Holdings Plc, swap sur rendement total	(15 665)	(643)
(287)	31 juill. 2023	Hilton Food Group Plc, swap sur rendement total	(3 013)	500
(574)	31 juill. 2023	Hotel Chocolat Group Plc, swap sur rendement total	(1 149)	322
(4 679)	31 juill. 2023	Hyve Group Plc, swap sur rendement total	(9 493)	33
(253)	31 juill. 2023	Ig Design Group Plc, swap sur rendement total	(611)	(2)
(33)	31 juill. 2023	Indivior Plc, swap sur rendement total	(1 012)	(43)
(7 206)	31 juill. 2023	Itm Power Plc, swap sur rendement total	(8 762)	(340)
(51)	31 juill. 2023	James Fisher & Sons Plc, swap sur rendement total	(344)	(28)
(4 072)	31 juill. 2023	John Wood Group Plc, swap sur rendement total	(9 269)	389
(173)	31 juill. 2023	Johnson Matthey Plc, swap sur rendement total	(5 242)	(228)
(56)	31 juill. 2023	Knights Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(60)	25
(3 398)	31 juill. 2023	Legal & General Group Plc, swap sur rendement total	(12 994)	112
(235)	31 juill. 2023	Londonmetric Property Plc, swap sur rendement total	(664)	53
(109)	31 juill. 2023	M&G Plc, swap sur rendement total	(351)	18
(50)	31 juill. 2023	Mortgage Advice Bureau Holdi, swap sur rendement total	(496)	100
(162)	31 juill. 2023	Network International Holdin, swap sur rendement total	(1 045)	(33)
(283)	31 juill. 2023	Next Plc, swap sur rendement total	(32 851)	(2 498)
(6 844)	31 juill. 2023	Ocado Group Plc, swap sur rendement total	(65 398)	(19 010)
(295)	31 juill. 2023	Oxford Biomedica Plc, swap sur rendement total	(2 084)	147
(391)	31 juill. 2023	Pearson Plc, swap sur rendement total	(5 407)	(53)
(1 157)	31 juill. 2023	Petrofac Ltd, swap sur rendement total	(1 538)	(158)
(418)	31 juill. 2023	Pets At Home Group Plc, swap sur rendement total	(2 707)	(53)
(11 186)	31 juill. 2023	Phoenix Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(100 076)	4 253
(629)	31 juill. 2023	Phoenix Spree Deutschland Lt, swap sur rendement total	(1 968)	99
(496)	31 juill. 2023	Picton Property Income Ltd, swap sur rendement total	(584)	43
(88)	31 juill. 2023	Plus500 Ltd, swap sur rendement total	(2 169)	(17)
(441)	31 juill. 2023	Prs Reit Plc/The, swap sur rendement total	(596)	44
(5 665)	31 juill. 2023	Prudential Plc, swap sur rendement total	(105 643)	(4 524)
(4 311)	31 juill. 2023	Quilter Plc, swap sur rendement total	(5 744)	376
(1 188)	31 juill. 2023	Regional Reit Ltd, swap sur rendement total	(966)	58
(306)	31 juill. 2023	Serica Energy Plc, swap sur rendement total	(1 155)	(29)
(4 234)	31 juill. 2023	Shaftesbury Capital Plc, swap sur rendement total	(8 198)	372
(1 529)	31 juill. 2023	St James'S Place Plc, swap sur rendement total	(27 973)	809
(5 591)	31 juill. 2023	Standard Chartered Plc, swap sur rendement total	(64 242)	(4 215)
(503)	31 juill. 2023	Strix Group Plc, swap sur rendement total	(896)	(51)
(2 819)	31 juill. 2023	Supermarket Income Reit Plc, swap sur rendement total	(3 462)	284
(1 085)	31 juill. 2023	Target Healthcare Reit Plc, swap sur rendement total	(1 311)	39
(124)	31 juill. 2023	Tate & Lyle Plc, swap sur rendement total	(1 542)	53
(6 634)	31 juill. 2023	Thg Plc, swap sur rendement total	(9 096)	(2 147)
(200)	31 juill. 2023	Treatt Plc, swap sur rendement total	(2 111)	235
(323)	31 juill. 2023	Tremor International Ltd, swap sur rendement total	(1 539)	(13)
(2 259)	31 juill. 2023	Tritax Eurobox Plc, swap sur rendement total	(1 942)	309
(51)	31 juill. 2023	Wh Smith Plc, swap sur rendement total	(1 328)	29
(911)	31 juill. 2023	Workspace Group Plc, swap sur rendement total	(7 246)	436
				(18 025)
Euro – taux à court terme (ESTR)				
(79)	31 juill. 2023	Aalberts Nv, swap sur rendement total	(4 521)	(32)
(997)	31 juill. 2023	Accor Sa, swap sur rendement total	(48 966)	(3 718)
(281)	31 juill. 2023	Adp, swap sur rendement total	(53 346)	4 419
(3)	31 juill. 2023	Adyen Nv, swap sur rendement total	(6 868)	(66)
(9)	31 juill. 2023	Aedifica Sa- droits, swap sur rendement total	(5)	(5)
(51)	31 juill. 2023	Aedifica, swap sur rendement total	(4 322)	(356)
(17 875)	31 juill. 2023	Aegon Nv, swap sur rendement total	(119 480)	(12 737)
(485)	31 juill. 2023	Agfa-Gevaert Nv, swap sur rendement total	(1 575)	144
(481)	31 juill. 2023	Aktia Bank Oyj, swap sur rendement total	(6 458)	(74)
(112)	31 juill. 2023	Alfen Nv, swap sur rendement total	(9 957)	675
(41)	31 juill. 2023	Altearea, swap sur rendement total	(6 606)	397
(1 161)	31 juill. 2023	Amper Sa, swap sur rendement total	(170)	(6)
(17)	31 juill. 2023	Argenx Se, swap sur rendement total	(8 722)	238
(178)	31 juill. 2023	Asm International Nv, swap sur rendement total	(99 795)	4 167
(31)	31 juill. 2023	Asr Nederland Nv, swap sur rendement total	(1 846)	(67)
(111)	31 juill. 2023	Atos Se, swap sur rendement total	(2 096)	108
(457)	31 juill. 2023	B&S Group Sarl, swap sur rendement total	(2 665)	(213)
(11)	31 juill. 2023	Basic-Fit Nv, swap sur rendement total	(556)	(11)
(82)	31 juill. 2023	Biomerieux, swap sur rendement total	(11 379)	(392)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(1 284)	31 juill. 2023	Bpost Sa, swap sur rendement total	(7 459)	(179)
(127)	31 juill. 2023	Brunel International, swap sur rendement total	(2 189)	(63)
(478)	31 juill. 2023	Ca Immobilien Anlagen Ag, swap sur rendement total	(18 321)	(623)
(300)	31 juill. 2023	Carmila, swap sur rendement total	(6 167)	(97)
(417)	31 juill. 2023	Collectis, swap sur rendement total	(1 068)	49
(3 051)	31 juill. 2023	Cellnex Telecom Sa, swap sur rendement total	(162 927)	4 045
(96)	31 juill. 2023	Cofinimmo, swap sur rendement total	(9 535)	556
(344)	31 juill. 2023	Colruyt Sa, swap sur rendement total	(16 960)	(1 520)
(86)	31 juill. 2023	Corbion Nv, swap sur rendement total	(2 714)	480
(385)	31 juill. 2023	Corticeira Amorim Sa, swap sur rendement total	(5 375)	100
(1 658)	31 juill. 2023	Dalata Hotel Group Plc, swap sur rendement total	(11 094)	(783)
(152)	31 juill. 2023	Danone, swap sur rendement total	(12 319)	(37)
(127)	31 juill. 2023	Dassault Systemes Sa, swap sur rendement total	(7 448)	(295)
(4)	31 juill. 2023	Dredging Environmental, swap sur rendement total	(722)	(21)
(87)	31 juill. 2023	Edenred, swap sur rendement total	(7 704)	(25)
(4)	31 juill. 2023	Elia Group Sa/Nv, swap sur rendement total	(672)	(15)
(100)	31 juill. 2023	Enento Group Oyj, swap sur rendement total	(3 039)	(335)
(569)	31 juill. 2023	Essilorluxottica, swap sur rendement total	(141 782)	(2 963)
(107)	31 juill. 2023	Eurocommercial Propertie-Cv, swap sur rendement total	(3 435)	(131)
(23)	31 juill. 2023	Euronext Nv, swap sur rendement total	(2 069)	16
(7 779)	31 juill. 2023	Fortum Oyj, swap sur rendement total	(137 739)	2 348
(3 790)	31 juill. 2023	Galp Energia Sgps Sa, swap sur rendement total	(58 654)	(4 367)
(336)	31 juill. 2023	Gaztransport Et Techniga Sa, swap sur rendement total	(45 233)	261
(1 105)	31 juill. 2023	Greenvolt, swap sur rendement total	(9 755)	12
(100)	31 juill. 2023	Harvia Oyj, swap sur rendement total	(3 335)	(147)
(113)	31 juill. 2023	Heineken Nv, swap sur rendement total	(15 364)	104
(43)	31 juill. 2023	Huhtamaki Oyj, swap sur rendement total	(1 866)	49
(385)	31 juill. 2023	Icade, swap sur rendement total	(21 221)	(463)
(1 408)	31 juill. 2023	Just Eat Takeaway.Com Nv, swap sur rendement total	(28 531)	135
(795)	31 juill. 2023	Kapsch Trafficom Ag, swap sur rendement total	(13 141)	(1 003)
(86)	31 juill. 2023	Kaufman & Broad Sa, swap sur rendement total	(3 365)	(153)
(116)	31 juill. 2023	Kerry Group Plc-A, swap sur rendement total	(14 968)	(198)
(305)	31 juill. 2023	Kesko Oyj, actions, B, swap sur rendement total	(7 595)	352
(489)	31 juill. 2023	Kojamo Oyj, swap sur rendement total	(6 085)	556
(75)	31 juill. 2023	Koninklijke Ahold Delhaize N, swap sur rendement total	(3 385)	(39)
(41)	31 juill. 2023	Lagardere Sca, swap sur rendement total	(1 270)	(27)
(335)	31 juill. 2023	Lassila & Tikanoja Oyj, swap sur rendement total	(4 822)	85
(122)	31 juill. 2023	Lectra, swap sur rendement total	(4 808)	52
(129)	31 juill. 2023	Lvmh Moët Hennessy Louis Vui, swap sur rendement total	(160 719)	(7 731)
(598)	31 juill. 2023	M6-Métropole Télévision, swap sur rendement total	(11 206)	(9)
(187)	31 juill. 2023	Maisons Du Monde Sa, swap sur rendement total	(2 489)	48
(250)	31 juill. 2023	Manitou Bf, swap sur rendement total	(8 842)	(1 118)
(31)	31 juill. 2023	Mayr-Melnhof Karton Ag, swap sur rendement total	(6 006)	94
(131)	31 juill. 2023	Mephy Energy Sa, swap sur rendement total	(1 585)	192
(692)	31 juill. 2023	Mercialys, swap sur rendement total	(8 257)	(740)
(73)	31 juill. 2023	Metsa Board Oyj, swap sur rendement total	(712)	68
(85)	31 juill. 2023	Montea, swap sur rendement total	(8 663)	662
(50)	31 juill. 2023	Musti Group Oy, swap sur rendement total	(1 291)	89
(159)	31 juill. 2023	Nacon Sa, swap sur rendement total	(454)	62
(34)	31 juill. 2023	Neinor Homes Sa, swap sur rendement total	(453)	(13)
(667)	31 juill. 2023	Neoen Sa, swap sur rendement total	(27 925)	(826)
(274)	31 juill. 2023	Nn Group Nv, swap sur rendement total	(13 414)	(11)
(145)	31 juill. 2023	Oci Nv, swap sur rendement total	(4 599)	(187)
(33)	31 juill. 2023	Oeneo, swap sur rendement total	(665)	16
(170)	31 juill. 2023	Omv Ag, swap sur rendement total	(9 532)	622
(18)	31 juill. 2023	Orange Belgium, swap sur rendement total	(360)	(3)
(1 325)	31 juill. 2023	Oriola Corp-B, swap sur rendement total	(2 460)	156
(320)	31 juill. 2023	Orion Oyj, cat. B, swap sur rendement total	(17 564)	754
(146)	31 juill. 2023	Pernod Ricard Sa, swap sur rendement total	(42 661)	-
(620)	31 juill. 2023	Prosus Nv, swap sur rendement total	(60 068)	(1 011)
(225)	31 juill. 2023	Raisio Oyj, actions, V, swap sur rendement total	(664)	21
(777)	31 juill. 2023	Randstad Nv, swap sur rendement total	(54 191)	(2 533)
(413)	31 juill. 2023	Recticel, swap sur rendement total	(6 499)	886
(100)	31 juill. 2023	Redes Energeticas Nacionais, swap sur rendement total	(360)	3
(7)	31 juill. 2023	Rémy Cointreau, swap sur rendement total	(1 485)	(38)
(83)	31 juill. 2023	Retail Estates, swap sur rendement total	(7 693)	25

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(1)	31 juill. 2023	Robertet Sa, swap sur rendement total	(1 216)	11
(34)	31 juill. 2023	S.O.I.T.E.C., swap sur rendement total	(7 606)	(1 130)
(24)	31 juill. 2023	Sartorius Stedim Biotech, swap sur rendement total	(7 924)	1 060
(376)	31 juill. 2023	Sbm Offshore Nv, swap sur rendement total	(6 818)	92
(128)	31 juill. 2023	Seb Sa, swap sur rendement total	(17 490)	(1 222)
(1 567)	31 juill. 2023	Ses, swap sur rendement total	(12 205)	92
(399)	31 juill. 2023	Signify Nv, swap sur rendement total	(14 787)	(855)
(200)	31 juill. 2023	Sligro Food Group Nv, swap sur rendement total	(4 550)	(6)
(964)	31 juill. 2023	Smurfit Kappa Group Plc, swap sur rendement total	(42 488)	4 227
(22)	31 juill. 2023	Société Bic Sa, swap sur rendement total	(1 667)	110
(360)	31 juill. 2023	Sodexo Sa, swap sur rendement total	(52 414)	252
(3 217)	31 juill. 2023	Stora Enso Oyj, actions, R, swap sur rendement total	(49 345)	5 741
(852)	31 juill. 2023	Technip Energies Nv, swap sur rendement total	(25 965)	(3 048)
(1 366)	31 juill. 2023	Télévision Française (T.F.1), swap sur rendement total	(12 414)	461
(121)	31 juill. 2023	Terveystalo Oyj, swap sur rendement total	(1 443)	(31)
(209)	31 juill. 2023	Thales Sa, swap sur rendement total	(41 397)	(1 978)
(771)	31 juill. 2023	Universal Music Group Nv, swap sur rendement total	(22 651)	(634)
(1 416)	31 juill. 2023	Upm-Kymmene Oyj, swap sur rendement total	(55 746)	2 175
(120)	31 juill. 2023	Vastned Retail Nv, swap sur rendement total	(3 378)	31
(2)	31 juill. 2023	Vib Vermoegen Ag, swap sur rendement total	(40)	5
(652)	31 juill. 2023	Volitalia Sa, actions ord., swap sur rendement total	(13 724)	474
(186)	31 juill. 2023	Waga Energy Sa, swap sur rendement total	(7 733)	(771)
(477)	31 juill. 2023	Warehouses De Pauw Sca, swap sur rendement total	(17 298)	859
(132)	31 juill. 2023	Wavestone, swap sur rendement total	(9 547)	(959)
(678)	31 juill. 2023	Wereldhave Nv, swap sur rendement total	(13 703)	(272)
				<u>(17 651)</u>
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
(2 000)	31 juill. 2023	Redco Properties Group Ltd, swap sur rendement total	(449)	<u>1</u>
				<u>1</u>
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
(696)	31 juill. 2023	Attacq Ltd, swap sur rendement total	(412)	(20)
(440)	31 juill. 2023	Dis-Chem Pharmacies Pty Ltd, swap sur rendement total	(727)	(35)
(470)	31 juill. 2023	Fortress Reit Ltd-A, swap sur rendement total	(423)	1
(1 366)	31 juill. 2023	Growthpoint Properties Ltd, swap sur rendement total	(1 116)	10
(945)	31 juill. 2023	Kap Industrial Holdings Ltd, swap sur rendement total	(179)	(31)
(938)	31 juill. 2023	Pepkor Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 084)	(125)
(131)	31 juill. 2023	Pick N Pay Stores Ltd, swap sur rendement total	(357)	(42)
(100)	31 juill. 2023	Resilient Reit Ltd, swap sur rendement total	(296)	(15)
(100)	31 juill. 2023	Spar Group Limited/The, swap sur rendement total	(735)	(22)
(231)	31 juill. 2023	Telkom Sa Soc Ltd, swap sur rendement total	(513)	<u>(62)</u>
				<u>(341)</u>
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
(370)	31 juill. 2023	Atrium Ljungberg Ab, actions, B, swap sur rendement total	(8 458)	(443)
(101)	31 juill. 2023	Axfood Ab, swap sur rendement total	(2 824)	79
(33)	31 juill. 2023	Bactiguard Holding Ab, swap sur rendement total	(289)	(4)
(197)	31 juill. 2023	Bioarectic Ab, swap sur rendement total	(6 806)	509
(671)	31 juill. 2023	Bonava Ab, actions, B, swap sur rendement total	(1 491)	8
(329)	31 juill. 2023	Bygghemma Group First Ab, swap sur rendement total	(605)	(115)
(1 653)	31 juill. 2023	Byggmax Group Ab, swap sur rendement total	(5 856)	268
(413)	31 juill. 2023	Cellavision Ab, swap sur rendement total	(9 289)	1 035
(46)	31 juill. 2023	Cibus Nordic Real Estate Ab, swap sur rendement total	(591)	(35)
(723)	31 juill. 2023	Coor Service Management, swap sur rendement total	(4 686)	(124)
(1 593)	31 juill. 2023	Corem Property Group, actions, B, swap sur rendement total	(988)	200
(318)	31 juill. 2023	Dios Fastigheter Ab, swap sur rendement total	(2 682)	(177)
(247)	31 juill. 2023	Dustin Group Ab, swap sur rendement total	(905)	23
(200)	31 juill. 2023	Electrolux Professional Ab-B, swap sur rendement total	(1 433)	(83)
(920)	31 juill. 2023	Embracer Group Ab, swap sur rendement total	(3 039)	(170)
(100)	31 juill. 2023	Eolus Vind Ab, actions, B, swap sur rendement total	(873)	30
(301)	31 juill. 2023	Garö Ab, swap sur rendement total	(2 318)	205
(527)	31 juill. 2023	Granges Ab, swap sur rendement total	(6 643)	(310)
(194)	31 juill. 2023	Hemnet Group Ab, swap sur rendement total	(4 487)	(105)
(371)	31 juill. 2023	Jm Ab, swap sur rendement total	(6 531)	(579)
(544)	31 juill. 2023	K-Fast Holding Ab, swap sur rendement total	(1 287)	(17)
(100)	31 juill. 2023	Lime Technologies Ab, swap sur rendement total	(3 351)	98
(307)	31 juill. 2023	Ncc Ab, actions, B, swap sur rendement total	(3 545)	(163)
(1 695)	31 juill. 2023	Nolato Ab, actions, B, swap sur rendement total	(10 528)	633

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(527)	31 juill. 2023	Nyfosa Ab, swap sur rendement total	(3 848)	27
(1 838)	31 juill. 2023	Pandox Ab, swap sur rendement total	(28 281)	(3 079)
(401)	31 juill. 2023	Platzer Fastigheter Hold- B, swap sur rendement total	(3 925)	(156)
(291)	31 juill. 2023	Powercell Sweden Ab, swap sur rendement total	(2 992)	(203)
(1 377)	31 juill. 2023	Rvrc Holding Ab, swap sur rendement total	(5 604)	(214)
(714)	31 juill. 2023	Sedana Medical Ab, swap sur rendement total	(2 365)	254
(9 663)	31 juill. 2023	Sinch Ab, swap sur rendement total	(28 825)	(2 004)
(503)	31 juill. 2023	Skistar Ab, swap sur rendement total	(7 111)	518
(141)	31 juill. 2023	Troax Group Ab, swap sur rendement total	(3 676)	163
(603)	31 juill. 2023	Viaplay Group Ab-B, swap sur rendement total	(4 565)	6 452
(546)	31 juill. 2023	Vitrolife Ab, swap sur rendement total	(14 007)	323
(3 141)	31 juill. 2023	Wallenstam Ab, actions, B, swap sur rendement total	(14 053)	(598)
				2 246
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
(372)	31 juill. 2023	Adecco Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(16 083)	(1 095)
(286)	31 juill. 2023	Arbonia Ag, swap sur rendement total	(4 281)	115
(64)	31 juill. 2023	Bachem Holding Ag, actions ord., B, swap sur rendement total	(7 384)	1 547
(135)	31 juill. 2023	Baloise Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(26 237)	1 740
(10)	31 juill. 2023	Bystronic Ag, swap sur rendement total	(8 800)	365
(119)	31 juill. 2023	Cosmo Pharmaceuticals Nv, swap sur rendement total	(7 964)	418
(108)	31 juill. 2023	Dufry Ag, actions ord., swap sur rendement total	(6 511)	(167)
(1 041)	31 juill. 2023	Gam Holding Ag, swap sur rendement total	(831)	38
(1)	31 juill. 2023	Givaudan, actions ord., swap sur rendement total	(4 385)	(15)
(53)	31 juill. 2023	Gurit Holding Ag-Br, swap sur rendement total	(6 530)	64
(1 003)	31 juill. 2023	Julius Baer Group Ltd, swap sur rendement total	(83 581)	(973)
(68)	31 juill. 2023	Kuehne + Nagel Intl Ag, actions ord., swap sur rendement total	(26 623)	(505)
(812)	31 juill. 2023	Logitech International, actions ord., swap sur rendement total	(63 941)	3 492
(193)	31 juill. 2023	Lonza Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(152 265)	9 282
(2 112)	31 juill. 2023	Meyer Burger Technology Ag, swap sur rendement total	(1 887)	(92)
(26)	31 juill. 2023	Mobimo Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(9 268)	(147)
(32)	31 juill. 2023	Polypeptide Group Ag, swap sur rendement total	(888)	222
(2)	31 juill. 2023	Sfs Group Ag, swap sur rendement total	(348)	13
(500)	31 juill. 2023	Sgs Sa, actions ord., swap sur rendement total	(62 535)	(2 661)
(52)	31 juill. 2023	Sika Ag, actions ord., swap sur rendement total	(19 666)	(530)
(502)	31 juill. 2023	Softwareone Holding Ag, swap sur rendement total	(13 164)	(2 658)
(145)	31 juill. 2023	Temenos Ag, actions ord., swap sur rendement total	(15 257)	1 174
(1 070)	31 juill. 2023	Ubs Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(28 637)	(1 028)
(60)	31 juill. 2023	Vat Group Ag, swap sur rendement total	(32 835)	451
(95)	31 juill. 2023	Zurich Insurance Group Ag, swap sur rendement total	(59 703)	(37)
				9 013
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
(32)	31 juill. 2023	10X Genomics Inc, cat. A, swap sur rendement total	(2 364)	(13)
(295)	31 juill. 2023	3D Systems Corp, swap sur rendement total	(3 876)	(437)
(3 100)	31 juill. 2023	3R Petroleum Oleo E Gas Sa, swap sur rendement total	(25 578)	(540)
(172)	31 juill. 2023	Adicet Bio Inc, swap sur rendement total	(553)	(10)
(149)	31 juill. 2023	Adobe Inc, swap sur rendement total	(96 411)	(273)
(69)	31 juill. 2023	Aehr Test Systems, swap sur rendement total	(3 766)	(740)
(4)	31 juill. 2023	Aerovironment Inc, swap sur rendement total	(541)	(45)
(37)	31 juill. 2023	Aersale Corp, swap sur rendement total	(720)	19
(3 000)	31 juill. 2023	Aes Brasil Energia Sa, swap sur rendement total	(10 158)	(595)
(522)	31 juill. 2023	Affirm Holdings Inc, swap sur rendement total	(10 589)	1 711
(547)	31 juill. 2023	Agilon Health Inc, swap sur rendement total	(12 551)	1 892
(487)	31 juill. 2023	Albemarle Corp, swap sur rendement total	(144 022)	(9 974)
(17)	31 juill. 2023	Allegion Plc, swap sur rendement total	(2 700)	(68)
(58)	31 juill. 2023	Allison Transmission Holding, swap sur rendement total	(4 333)	(458)
(8 000)	31 juill. 2023	Alpargatas Sa, actions priv., swap sur rendement total	(20 565)	1 299
(2 284)	31 juill. 2023	Alupar Investimento Sa, parts, swap sur rendement total	(19 003)	(1 758)
(100)	31 juill. 2023	Ambipar Participacoes E Empr, swap sur rendement total	(606)	(73)
(136)	31 juill. 2023	Amdocs Ltd, swap sur rendement total	(17 868)	(739)
(1 125)	31 juill. 2023	America Movil, CAAE parrainé, cat. L, swap sur rendement total	(32 215)	591
(2 229)	31 juill. 2023	American Airlines Group Inc, swap sur rendement total	(52 914)	(6 463)
(566)	31 juill. 2023	Amphenol Corp, cat. A, swap sur rendement total	(63 781)	(6 187)
(35)	31 juill. 2023	Andersons Inc/The, swap sur rendement total	(2 146)	(332)
(1 041)	31 juill. 2023	Anglogold Ashanti, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(29 052)	3 334
(198)	31 juill. 2023	Aptiv Plc, swap sur rendement total	(26 748)	(883)
(100)	31 juill. 2023	Arca Continental Sab De Cv, swap sur rendement total	(1 360)	8

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(427)	31 juill. 2023	Arcutis Biotherapeutics Inc, swap sur rendement total	(5 385)	370
(32)	31 juill. 2023	Argenx Se - CAAE, swap sur rendement total	(16 503)	252
(99)	31 juill. 2023	Arista Networks Inc, swap sur rendement total	(21 230)	(107)
(160)	31 juill. 2023	Arlington Asset Investment-A, swap sur rendement total	(7 713)	(276)
(415)	31 juill. 2023	Array Technologies Inc, swap sur rendement total	(12 411)	(685)
(77)	31 juill. 2023	Associated Banc-Corp, swap sur rendement total	(1 654)	(9)
(1 066)	31 juill. 2023	Astrazeneca Plc, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(100 956)	2 541
(12 500)	31 juill. 2023	Atacadao Sa, swap sur rendement total	(38 698)	(1 590)
(79)	31 juill. 2023	Atmos Energy Corp, swap sur rendement total	(12 162)	(109)
(19)	31 juill. 2023	Autozone Inc, swap sur rendement total	(62 687)	(1 929)
(63)	31 juill. 2023	Avid Technology Inc, swap sur rendement total	(2 126)	(117)
(14)	31 juill. 2023	Avient Corp, swap sur rendement total	(762)	(83)
(87)	31 juill. 2023	Banco Bradesco, CAAE, swap sur rendement total	(398)	(42)
(2 637)	31 juill. 2023	Bank Of New York Mellon Corp, swap sur rendement total	(155 349)	(10 278)
(349)	31 juill. 2023	Beauty Health Co/The, swap sur rendement total	(3 865)	188
(9 100)	31 juill. 2023	Beckm Sab De Cv, swap sur rendement total	(29 474)	(890)
(310)	31 juill. 2023	Becton Dickinson And Co, swap sur rendement total	(108 299)	(7 970)
(822)	31 juill. 2023	Bill.Com Holdings Inc, swap sur rendement total	(127 099)	(13 983)
(5)	31 juill. 2023	Bio-Rad Laboratories-A, swap sur rendement total	(2 508)	(90)
(182)	31 juill. 2023	Boston Properties Inc, swap sur rendement total	(14 106)	(529)
(146)	31 juill. 2023	Broadcom Inc, swap sur rendement total	(167 583)	(10 553)
(153)	31 juill. 2023	Callon Petroleum Co, swap sur rendement total	(7 100)	(322)
(784)	31 juill. 2023	Canadian Solar Inc, swap sur rendement total	(40 138)	(164)
(151)	31 juill. 2023	Capital One Financial Corp, swap sur rendement total	(21 853)	(863)
(305)	31 juill. 2023	Carrier Global Corp, swap sur rendement total	(20 137)	(445)
(350)	31 juill. 2023	Carvana Co, swap sur rendement total	(12 005)	(1 309)
(629)	31 juill. 2023	Cbre Group Inc-A, swap sur rendement total	(67 177)	(3 431)
(27)	31 juill. 2023	Celldex Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(1 212)	97
(11 043)	31 juill. 2023	Cemex Sab- CAAE parrainé, Part. Cer., swap sur rendement total	(103 458)	(15 371)
(139)	31 juill. 2023	Cf Industries Holdings Inc, swap sur rendement total	(12 769)	93
(68)	31 juill. 2023	Chart Industries Inc, swap sur rendement total	(14 378)	(3 795)
(153)	31 juill. 2023	Charter Communications Inc-A, swap sur rendement total	(74 377)	(8 076)
(33)	31 juill. 2023	Cheniere Energy Inc, swap sur rendement total	(6 653)	(143)
(200)	31 juill. 2023	Cia Brasileira De Distribuic, swap sur rendement total	(1 034)	(56)
(1 294)	31 juill. 2023	Cia De Minas Buenaventur, CAAE, swap sur rendement total	(12 585)	176
(2 900)	31 juill. 2023	Cia De Transmissao De Ene, actions priv., swap sur rendement total	(20 329)	(1 864)
(100)	31 juill. 2023	Cia Ferro Ligas Da Bahia, Fe, swap sur rendement total	(1 340)	(77)
(500)	31 juill. 2023	Cia Siderurgica Nacional Sa, swap sur rendement total	(1 676)	130
(328)	31 juill. 2023	Cigna Corp, swap sur rendement total	(121 788)	(11 657)
(964)	31 juill. 2023	Cognizant Tech Solutions-A, swap sur rendement total	(83 272)	(2 683)
(37)	31 juill. 2023	Compass Minerals Internation, swap sur rendement total	(1 665)	(66)
(3 410)	31 juill. 2023	Corning Inc, swap sur rendement total	(158 110)	(12 022)
(720)	31 juill. 2023	Corteva Inc, swap sur rendement total	(54 592)	60
(5 400)	31 juill. 2023	Cosar Sa Industria Comercio., swap sur rendement total	(26 658)	(4 864)
(180)	31 juill. 2023	Costar Group Inc, swap sur rendement total	(21 198)	167
(119)	31 juill. 2023	Coty Inc, cat. A, swap sur rendement total	(1 935)	(222)
(150)	31 juill. 2023	Cousins Properties Inc, swap sur rendement total	(4 526)	(273)
(144)	31 juill. 2023	Crown Castle Intl Corp, swap sur rendement total	(21 711)	(23)
(225)	31 juill. 2023	Cvs Health Corp, swap sur rendement total	(20 582)	65
(100)	31 juill. 2023	Cyrela Brazil Realty Sa Emp, swap sur rendement total	(556)	(67)
(1 847)	31 juill. 2023	Delta Air Lines Inc, swap sur rendement total	(116 190)	(14 382)
(58)	31 juill. 2023	Diageo Plc, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(13 314)	(292)
(400)	31 juill. 2023	Diagnosticos Da America Sa, swap sur rendement total	(1 308)	(165)
(31)	31 juill. 2023	Dick'S Sporting Goods Inc, swap sur rendement total	(5 423)	189
(634)	31 juill. 2023	Dollar Tree Inc, swap sur rendement total	(120 388)	(8 209)
(16)	31 juill. 2023	Dover Corp, swap sur rendement total	(3 126)	(259)
(29)	31 juill. 2023	Eagle Bulk Shipping Inc, swap sur rendement total	(1 843)	(197)
(45)	31 juill. 2023	Echostar Corp-A, swap sur rendement total	(1 033)	(90)
(400)	31 juill. 2023	El Puerto De Liverpool-C1, swap sur rendement total	(3 225)	(105)
(78)	31 juill. 2023	Eli Lilly & Co, swap sur rendement total	(48 405)	(2 976)
(14)	31 juill. 2023	Enanta Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(396)	18
(16 100)	31 juill. 2023	Eneva Sa, swap sur rendement total	(54 605)	(6 425)
(300)	31 juill. 2023	Engie Brasil Energia Sa, swap sur rendement total	(3 789)	(478)
(96)	31 juill. 2023	Enhabit Inc, swap sur rendement total	(1 461)	(89)
(9)	31 juill. 2023	Epam Systems Inc, swap sur rendement total	(2 677)	44
(1 822)	31 juill. 2023	Equitable Holdings Inc, swap sur rendement total	(65 482)	(6 001)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(753)	31 juill. 2023	Equitrans Midstream Corp, swap sur rendement total	(9 526)	(440)
(4 000)	31 juill. 2023	Even Construtora E Inco Sa, swap sur rendement total	(7 530)	(859)
(204)	31 juill. 2023	Evolent Health Inc-A, swap sur rendement total	(8 179)	(292)
(33)	31 juill. 2023	Expro Group Holdings Nv, swap sur rendement total	(774)	(46)
(5 200)	31 juill. 2023	Ez Tec Empreendimentos E Par, swap sur rendement total	(26 476)	(2 575)
(106)	31 juill. 2023	Fedex Corp, swap sur rendement total	(34 948)	(115)
(16)	31 juill. 2023	First Citizens Beshs, cat. A, swap sur rendement total	(27 173)	(663)
(26)	31 juill. 2023	Fleetcor Technologies Inc, swap sur rendement total	(8 638)	(813)
(595)	31 juill. 2023	Fortive Corp, swap sur rendement total	(58 869)	(3 691)
(24)	31 juill. 2023	Franklin Resources Inc, swap sur rendement total	(858)	(92)
(900)	31 juill. 2023	Gaec Educacao Sa, swap sur rendement total	(1 042)	(340)
(500)	31 juill. 2023	Gafisa Sa, swap sur rendement total	(956)	13
(135)	31 juill. 2023	Ge Healthcare Tech, swap sur rendement total	(14 513)	(274)
(126)	31 juill. 2023	General Electric Co, swap sur rendement total	(18 315)	(972)
(2 100)	31 juill. 2023	Genomma Lab Internacional-B, swap sur rendement total	(2 143)	227
(70)	31 juill. 2023	Glacier Bancorp Inc, swap sur rendement total	(2 887)	450
(1 970)	31 juill. 2023	Gold Fields Ltd, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(36 052)	3 450
(490)	31 juill. 2023	Goodyear Tire & Rubber Co, swap sur rendement total	(8 870)	68
(346)	31 juill. 2023	Grab Holdings Ltd, cat. A, swap sur rendement total	(1 570)	(201)
(83)	31 juill. 2023	Graco Inc, swap sur rendement total	(9 484)	(310)
(350)	31 juill. 2023	Graftech International Ltd, swap sur rendement total	(2 334)	(340)
(2 200)	31 juill. 2023	Grendene Sa, swap sur rendement total	(4 549)	(537)
(1 800)	31 juill. 2023	Grupo De Moda Soma Sa, swap sur rendement total	(5 971)	(1 103)
(7 500)	31 juill. 2023	Grupo Mexico Sab De Cv, série B, swap sur rendement total	(47 778)	(3 491)
(85 100)	31 juill. 2023	Hapvida Participacoes E Inve, swap sur rendement total	(103 030)	(13 355)
(894)	31 juill. 2023	Hdfc Bank Ltd, CAAE, swap sur rendement total	(82 454)	(5 969)
(1 470)	31 juill. 2023	Hewlett Packard Enterprise, swap sur rendement total	(32 912)	(183)
(2 285)	31 juill. 2023	Hsbc Holdings Plc, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(119 796)	(8 023)
(511)	31 juill. 2023	Hyatt Hotels Corp, cat. A, swap sur rendement total	(77 477)	(4 439)
(27)	31 juill. 2023	Idexx Laboratories Inc, swap sur rendement total	(17 944)	(1 272)
(600)	31 juill. 2023	Industrias Penoles Sab De Cv, swap sur rendement total	(11 151)	1 150
(2 300)	31 juill. 2023	Infracommerce Cxaas Sa, swap sur rendement total	(1 087)	(60)
(168)	31 juill. 2023	Ingersoll-Rand Plc, swap sur rendement total	(14 530)	(1 065)
(622)	31 juill. 2023	Intl Flavors & Fragrances, swap sur rendement total	(66 174)	(1 715)
(109)	31 juill. 2023	Intrepid Potash Inc, swap sur rendement total	(3 273)	(727)
(134)	31 juill. 2023	Iovance Biotherapeutics Inc, swap sur rendement total	(1 248)	71
(900)	31 juill. 2023	Irani Sa, swap sur rendement total	(2 306)	(352)
(300)	31 juill. 2023	Irb Brasil Resseguros Sa, swap sur rendement total	(3 611)	(378)
(43)	31 juill. 2023	Janus Henderson Group Plc, swap sur rendement total	(1 551)	(25)
(9 200)	31 juill. 2023	Jhsf Participacoes Sa, swap sur rendement total	(12 944)	(1 585)
(147)	31 juill. 2023	Kirby Corp, swap sur rendement total	(14 968)	(993)
(71)	31 juill. 2023	Kla Corp, swap sur rendement total	(45 568)	(2 443)
(179)	31 juill. 2023	Kratos Defense & Security, swap sur rendement total	(3 397)	(167)
(49)	31 juill. 2023	Kronos Worldwide Inc, swap sur rendement total	(566)	(29)
(234)	31 juill. 2023	Kura Oncology Inc, swap sur rendement total	(3 276)	58
(158)	31 juill. 2023	Kymera Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(4 807)	1 373
(935)	31 juill. 2023	Kyndryl Holdings Inc, swap sur rendement total	(16 431)	(829)
(74)	31 juill. 2023	L3Harris Technologies Inc, swap sur rendement total	(19 170)	(312)
(10)	31 juill. 2023	Lam Research Corp, swap sur rendement total	(8 529)	91
(62)	31 juill. 2023	Lci Industries, swap sur rendement total	(10 367)	(361)
(619)	31 juill. 2023	Legend Biotech Corp, CAAE, swap sur rendement total	(56 542)	(3 042)
(196)	31 juill. 2023	Lightwave Logic Inc, swap sur rendement total	(1 808)	122
(188)	31 juill. 2023	Lions Gate Entertainment-A, swap sur rendement total	(2 197)	377
(1 900)	31 juill. 2023	Localiza Rent A Car, swap sur rendement total	(35 975)	(5 142)
(49)	31 juill. 2023	Lockheed Martin Corp, swap sur rendement total	(29 851)	112
(600)	31 juill. 2023	Log Commercial Properties E, swap sur rendement total	(3 879)	(209)
(500)	31 juill. 2023	Log-In Logistica Intermodal, swap sur rendement total	(7 093)	(574)
(277)	31 juill. 2023	Lyondellbasell Indu, cat. A, swap sur rendement total	(33 659)	(2 079)
(30)	31 juill. 2023	Marathon Petroleum Corp, swap sur rendement total	(4 629)	(34)
(27)	31 juill. 2023	Marriott International, cat. A, swap sur rendement total	(6 563)	(127)
(975)	31 juill. 2023	Marvell Technology Group Ltd, swap sur rendement total	(77 126)	(1 403)
(1 702)	31 juill. 2023	Match Group Inc, swap sur rendement total	(94 253)	(6 894)
(103)	31 juill. 2023	Matson Inc, swap sur rendement total	(10 594)	(1 233)
(60)	31 juill. 2023	Mercer International Inc, swap sur rendement total	(647)	44
(381)	31 juill. 2023	Merck & Co. Inc., swap sur rendement total	(58 543)	(1 691)
(374)	31 juill. 2023	Mersana Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(1 628)	167

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(336)	31 juill. 2023	Microchip Technology Inc, swap sur rendement total	(39 833)	(2 705)
(1 777)	31 juill. 2023	Micron Technology Inc, swap sur rendement total	(148 398)	12 417
(148)	31 juill. 2023	Microvast Holdings Inc, swap sur rendement total	(313)	(70)
(1 800)	31 juill. 2023	Minerva Sa, swap sur rendement total	(5 289)	(489)
(763)	31 juill. 2023	Moderna Inc, swap sur rendement total	(122 671)	6 669
(6)	31 juill. 2023	Modivcare Inc, swap sur rendement total	(359)	(1)
(249)	31 juill. 2023	Mongodb Inc, swap sur rendement total	(135 417)	(22 686)
(9)	31 juill. 2023	Monolithic Power Systems Inc, swap sur rendement total	(6 446)	(356)
(3 600)	31 juill. 2023	Movida Participacoes Sa, swap sur rendement total	(10 478)	(819)
(2 300)	31 juill. 2023	Mpm Corporeos Sa, swap sur rendement total	(1 157)	(285)
(8 300)	31 juill. 2023	Mrv Engenharia, swap sur rendement total	(26 544)	(4 655)
(29)	31 juill. 2023	Mueller Water Products Inc-A, swap sur rendement total	(623)	(95)
(11 700)	31 juill. 2023	Nemak Sab De Cv, swap sur rendement total	(3 699)	(57)
(70)	31 juill. 2023	Nextera Energy Partners Lp, swap sur rendement total	(5 432)	198
(35)	31 juill. 2023	Northrop Grumman Corp, swap sur rendement total	(21 110)	(27)
(111)	31 juill. 2023	Nucor Corp, swap sur rendement total	(24 160)	(1 614)
(1 034)	31 juill. 2023	Ocular Therapeutix Inc, swap sur rendement total	(7 060)	(554)
(2 600)	31 juill. 2023	Omega Energia Sa, swap sur rendement total	(8 121)	(1 441)
(13)	31 juill. 2023	Omnicell Inc, swap sur rendement total	(1 267)	1
(1 100)	31 juill. 2023	Operadora De Sites Mex-A-1, swap sur rendement total	(1 385)	(95)
(98)	31 juill. 2023	Oracle Corp, swap sur rendement total	(15 443)	(156)
(129)	31 juill. 2023	O'Reilly Automotive Inc, swap sur rendement total	(163 069)	(8 543)
(238)	31 juill. 2023	Organon & Co, swap sur rendement total	(6 554)	(96)
(569)	31 juill. 2023	Otis Worldwide Corp, swap sur rendement total	(67 018)	(1 493)
(128)	31 juill. 2023	Paccar Inc, swap sur rendement total	(14 168)	(740)
(1 692)	31 juill. 2023	Palantir Technologies Inc-A, swap sur rendement total	(34 323)	(1 248)
(5)	31 juill. 2023	Parker Hannifin Corp, swap sur rendement total	(2 581)	(201)
(61)	31 juill. 2023	Paycom Software Inc, swap sur rendement total	(25 930)	(1 259)
(4 100)	31 juill. 2023	Petroreconcavo Sa, swap sur rendement total	(21 725)	(1 502)
(161)	31 juill. 2023	Pitney Bowes Inc, swap sur rendement total	(754)	(44)
(98)	31 juill. 2023	Privia Health Group Inc, swap sur rendement total	(3 386)	(138)
(243)	31 juill. 2023	Proassurance Corp, swap sur rendement total	(4 852)	(122)
(265)	31 juill. 2023	Pultegroup Inc, swap sur rendement total	(27 295)	(675)
(349)	31 juill. 2023	Purecycle Technologies Inc, swap sur rendement total	(4 937)	(1 742)
(2 700)	31 juill. 2023	Qgep Participacoes Sa, swap sur rendement total	(10 254)	(1 177)
(298)	31 juill. 2023	Quimica Y Minera Chil, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(28 636)	(2 567)
(340)	31 juill. 2023	Quinstreet Inc, swap sur rendement total	(3 973)	192
(2 281)	31 juill. 2023	R1 Rcm Inc, swap sur rendement total	(55 688)	(6 403)
(389)	31 juill. 2023	Rackspace Technology Inc, swap sur rendement total	(1 400)	(335)
(1 812)	31 juill. 2023	Range Resources Corp, swap sur rendement total	(70 493)	(4 561)
(21)	31 juill. 2023	Rocky Brands Inc, swap sur rendement total	(584)	(50)
(49)	31 juill. 2023	Ross Stores Inc, swap sur rendement total	(7 270)	(279)
(411)	31 juill. 2023	Sanofi, CAAE, swap sur rendement total	(29 314)	(259)
(14)	31 juill. 2023	Schnitzer Steel Inds Inc-A, swap sur rendement total	(556)	43
(159)	31 juill. 2023	Scorpio Tankers Inc, swap sur rendement total	(9 937)	(186)
(625)	31 juill. 2023	Sentinelone Inc, cat. A, swap sur rendement total	(12 488)	(1 240)
(1 200)	31 juill. 2023	Ser Educacional Sa, , swap sur rendement total	(1 658)	(456)
(14)	31 juill. 2023	Servicenow Inc, swap sur rendement total	(10 411)	(96)
(1 059)	31 juill. 2023	Shell Plc, CAAE, swap sur rendement total	(84 612)	(3 984)
(89)	31 juill. 2023	Shoe Carnival Inc, swap sur rendement total	(2 765)	(451)
(1 400)	31 juill. 2023	Sinqia Sa, swap sur rendement total	(8 578)	(1 280)
(212)	31 juill. 2023	Skyworks Solutions Inc, swap sur rendement total	(31 052)	(1 309)
(308)	31 juill. 2023	Sl Green Realty Corp, swap sur rendement total	(12 358)	(2 453)
(1 760)	31 juill. 2023	Slc Agricola Sa, swap sur rendement total	(18 594)	(2 714)
(73)	31 juill. 2023	Sleep Number Corp, swap sur rendement total	(2 635)	(338)
(2 227)	31 juill. 2023	Sofi Technologies Inc, swap sur rendement total	(24 577)	(4 036)
(35)	31 juill. 2023	Southern Copper Corp, swap sur rendement total	(3 323)	(40)
(64)	31 juill. 2023	Stagwell Inc, swap sur rendement total	(611)	56
(161)	31 juill. 2023	Stanley Black & Decker Inc, swap sur rendement total	(19 964)	(1 398)
(4)	31 juill. 2023	Stepan Co, swap sur rendement total	(506)	(17)
(26)	31 juill. 2023	Sun Country Airlines Holding, swap sur rendement total	(773)	(95)
(1 317)	31 juill. 2023	Sunrun Inc, swap sur rendement total	(31 125)	259
(345)	31 juill. 2023	Taiwan Semiconductor, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(46 072)	393
(116)	31 juill. 2023	Targa Resources Corp, swap sur rendement total	(11 681)	(498)
(55)	31 juill. 2023	Taskus Inc-A, swap sur rendement total	(824)	(31)
(67)	31 juill. 2023	Td Synnex Corp, swap sur rendement total	(8 334)	(373)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(403)	31 juill. 2023	Tesla Inc, swap sur rendement total	(139 594)	(17 832)
(2 074)	31 juill. 2023	Teva Pharmaceutical, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(20 665)	162
(82)	31 juill. 2023	Texas Capital Bancshares Inc, swap sur rendement total	(5 588)	59
(138)	31 juill. 2023	Thredup Inc, cat. A, swap sur rendement total	(446)	(66)
(75)	31 juill. 2023	T-Mobile Us Inc, swap sur rendement total	(13 785)	(284)
(972)	31 juill. 2023	Trade Desk Inc/The, cat. A, swap sur rendement total	(99 320)	(5 869)
(20)	31 juill. 2023	Transcat Inc, swap sur rendement total	(2 258)	(12)
(3 500)	31 juill. 2023	Transmissora Alianca De, parts, swap sur rendement total	(36 415)	(2 261)
(172)	31 juill. 2023	Transunion, swap sur rendement total	(17 828)	(1 381)
(121)	31 juill. 2023	Trex Company Inc, swap sur rendement total	(10 497)	(2 243)
(1 029)	31 juill. 2023	Twist Bioscience Corp, swap sur rendement total	(27 859)	(4 173)
(2 700)	31 juill. 2023	Unifin Financiera Sab De Cv, swap sur rendement total	(250)	(7)
(394)	31 juill. 2023	Unilever Plc, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(27 179)	(101)
(632)	31 juill. 2023	United Airlines Holdings Inc, swap sur rendement total	(45 887)	(4 198)
(778)	31 juill. 2023	Unity Software Inc, swap sur rendement total	(44 700)	(4 542)
(12)	31 juill. 2023	Universal Health Services-B, swap sur rendement total	(2 505)	(101)
(255)	31 juill. 2023	Us Cellular Corp, swap sur rendement total	(5 949)	(668)
(510)	31 juill. 2023	Us Foods Holding Corp, swap sur rendement total	(29 694)	(1 737)
(75)	31 juill. 2023	Vaalco Energy Inc, swap sur rendement total	(373)	11
(34)	31 juill. 2023	Valero Energy Corp, swap sur rendement total	(5 277)	(176)
(600)	31 juill. 2023	Vamos Locacao De Caminhos M, swap sur rendement total	(2 011)	(17)
(159)	31 juill. 2023	Viavi Solutions Inc, swap sur rendement total	(2 384)	(305)
(249)	31 juill. 2023	Vista Outdoor Inc, swap sur rendement total	(9 117)	(308)
(4)	31 juill. 2023	Visteon Corp, swap sur rendement total	(760)	(50)
(1 200)	31 juill. 2023	Walmart De Mexico Sab De Cv, swap sur rendement total	(6 282)	-
(164)	31 juill. 2023	Warby Parker Inc, cat. A, swap sur rendement total	(2 537)	(138)
(6 018)	31 juill. 2023	Warner Bros Discovery Inc, swap sur rendement total	(99 860)	(6 061)
(172)	31 juill. 2023	Westrock Co, swap sur rendement total	(6 616)	50
(269)	31 juill. 2023	Wp Carey Inc, swap sur rendement total	(24 429)	508
(13)	31 juill. 2023	Ww Grainger Inc, swap sur rendement total	(13 566)	(396)
(576)	31 juill. 2023	Ww International Inc, swap sur rendement total	(5 122)	(102)
(556)	31 juill. 2023	Zentalis Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(20 755)	231
(303)	31 juill. 2023	Zoetis Inc, swap sur rendement total	(69 047)	(2 438)
(235)	31 juill. 2023	Zumiez Inc, swap sur rendement total	(5 181)	(430)
				<u>(374 317)</u>
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position vendeur		<u>(399 074)</u>
		Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total		<u>310 539</u>
		Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total		<u>(578 351)</u>
		Plus-value (moins-value) latente des swaps sur rendement total, montant net		<u>(267 812)</u>

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Il est conseillé de lire les présentes notes propres au Fonds en parallèle avec les notes annexes des états financiers, qui font partie intégrante des présents états financiers. Les présentes notes propres au Fonds peuvent faire référence aux notes annexes en indiquant le numéro de la note correspondante. Comme elles complètent les notes annexes, il n'y a pas nécessairement de note propre au Fonds correspondante pour chacune des notes annexes.

Entité publiante et objectif de placement (note 1)

Le Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L) (le « Fonds ») est une fiducie de fonds commun de placement à capital variable établie en vertu des lois de l'Ontario et est régi par une déclaration de fiducie datée du 1^{er} mai 2012 dans sa version modifiée. Le Fonds est entré en activité le 15 février 2019. L'adresse du siège social du Fonds est le 1400 – 130 King St. West, P.O. Box 240, Toronto (Ontario) Canada, M5X 1C8. Le 23 mars 2023, le Fonds a changé de nom et le Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L est devenu le Fonds mondial neutre au marché CC&L II.

L'objectif de placement du Fonds est de procurer un rendement absolu positif et attrayant redressé en fonction du risque sur une longue période de temps qui présente une faible corrélation avec les portefeuilles de placements en actions traditionnels et qui est moins volatil que celui de tels portefeuilles en investissant dans des titres et des contrats dérivés, ainsi qu'en employant des stratégies de couverture de titres et des stratégies neutres sur le marché des actions.

Juste valeur des instruments financiers (note 5)

Classement des placements selon la hiérarchie des justes valeurs

Les tableaux ci-dessous présentent le classement des instruments financiers du Fonds évalués à la juste valeur à la date de clôture. Les montants sont établis selon les valeurs comptabilisées dans l'état de la situation financière.

Au 30 juin 2023

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	1 259 844 \$	– \$	– \$	1 259 844 \$
Actions américaines – position acheteur	11 308 286	351	–	11 308 637
Actions étrangères – position acheteur	9 095 845	17 848	–	9 113 693
Contrats de change à terme	–	233 257	–	233 257
Contrats de swap	–	310 539	–	310 539
	21 663 975 \$	561 995 \$	– \$	22 225 970 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	1 520 071 \$	780 \$	– \$	1 520 851 \$
Actions américaines – position vendeur	7 034 991	329	–	7 035 320
Actions étrangères – position vendeur	5 863 504	532	–	5 864 036
Contrats de change à terme	–	31 918	–	31 918
Contrats de swap	–	578 351	–	578 351
	14 418 566 \$	611 910 \$	– \$	15 030 476 \$

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Au 31 décembre 2022

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	2 214 102 \$	– \$	– \$	2 214 102 \$
Actions américaines – position acheteur	14 067 976	755	–	14 068 731
Actions étrangères – position acheteur	9 798 976	11 683	–	9 810 659
Contrats de change à terme	–	26 488	–	26 488
Contrats de swap	–	335 931	–	335 931
	26 081 054 \$	374 857 \$	– \$	26 455 911 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	1 443 820 \$	780 \$	– \$	1 444 600 \$
Actions américaines – position vendeur	2 323 589	–	–	2 323 589
Actions étrangères – position vendeur	3 457 569	13 232	–	3 470 801
Contrats de change à terme	–	2 663	–	2 663
Contrats de swap	–	380 013	–	380 013
	7 224 978 \$	396 688 \$	– \$	7 621 666 \$

Il n'y a eu aucun transfert important d'actifs ou de passifs financiers entre les niveaux 1, 2 et 3 pour la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022, les changements aux parts en circulation ont été les suivants :

	Solde à l'ouverture de la période	Parts rachetables émises	Parts rachetables réinvesties	Parts rachetables rachetées	Solde à la clôture de la période
2023					
Série A	14 220	5 470	–	(18)	19 672
Série F	187 498	426 919	–	(86 466)	527 951
Série I	1 833 972	–	–	(814 333)	1 019 639
2022					
Série A	13 355	1 377	743	(1 255)	14 220
Série F	321 623	20 845	9 858	(164 828)	187 498
Série I	1 970 842	49	136 669	(273 588)	1 833 972

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2022, le Fonds disposait de pertes en capital inutilisées de 759 913 \$ (néant au 31 décembre 2021) qui peuvent être reportées indéfiniment pour réduire ses gains en capital réalisés futurs. Il ne disposait d'aucune perte autre qu'en capital inutilisée pouvant être reportée aux fins de l'impôt (néant au 31 décembre 2021).

Au cours de la période, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2022).

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Transactions avec des parties liées et autres charges (note 8)

Frais de gestion

Le Fonds paie des frais de gestion, qui sont comptabilisés quotidiennement et payés mensuellement. Les taux des frais de gestion annuels, avant taxes, sont de 1,90 % pour la série A et de 0,90 % pour la série F. Le Fonds ne paie aucuns frais de gestion pour les parts de série I. Les frais de gestion pour ces parts sont négociés et payés directement par les porteurs de parts au gestionnaire et ne peuvent pas être plus élevés que les frais de gestion des parts de série A du Fonds.

Rémunération au rendement

Le Fonds verse trimestriellement une rémunération au rendement au gestionnaire (la « rémunération au rendement »), celle-ci étant calculée et comptabilisée quotidiennement. Cette rémunération au rendement correspond à 20 % du rendement positif net de la série pour la période de rendement, sous réserve d'un rendement de référence perpétuel. La rémunération au rendement s'applique aux parts des séries A et F. Les porteurs de parts de série I peuvent négocier une rémunération au rendement qui sera versée directement au gestionnaire.

Parts détenues par des parties liées

Connor, Clark & Lunn Financial Group Investments Inc. (« CCLFGII ») et Groupe financier Connor, Clark & Lunn Ltée (« GFCC&L »), sociétés liées au gestionnaire du fait d'une propriété commune, détiennent des parts du Fonds. Au 30 juin 2023, CCLFGII détenait 934 361 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 10 062 788 \$ (1 747 173 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 17 820 990 \$ au 31 décembre 2022). Au 30 juin 2023, GFCC&L détenait 6 649 parts de série A, 6 892 parts de série F et 7 260 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 71 717 \$, 74 439 \$ et 78 188 \$ (6 649 parts de série A, 6 892 parts de série F et 7 260 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 68 677 \$, 70 966 \$ et 74 051 \$ au 31 décembre 2022).

Commissions de courtage et autres coûts de transactions (note 9)

Le Fonds a payé 27 694 \$ (36 316 \$ en 2022) en commissions de courtage et autres coûts de transactions relativement à des opérations de portefeuille durant la période. Les paiements indirects effectués pour la période se sont établis à 4 902 \$ (2 773 \$ en 2022).

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, en dollars canadiens. Les montants présentés sont fondés sur la juste valeur des actifs monétaires (y compris la trésorerie et les placements à court terme) et sur le capital sous-jacent des contrats de change à terme, le cas échéant.

Les tableaux indiquent également l'effet potentiel, sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, d'une fluctuation de 5 % des devises par rapport au dollar canadien, toutes les autres variables restant constantes. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Au 30 juin 2023

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar australien	17 588	–	17 588	0,1	879
Livre sterling	20 692	259 076	279 768	1,7	13 988
Renminbi chinois	559	–	559	–	28
Couronne danoise	451 295	(358 303)	92 992	0,5	4 650
Euro	424 997	(932 608)	(507 611)	(3,0)	(25 381)
Dollar de Hong Kong	75 934	–	75 934	0,4	3 797
Forint hongrois	1 612	–	1 612	–	81
Roupie indonésienne	(7 439)	–	(7 439)	–	(372)
Nouveau shekel israélien	152 567	(260 303)	(107 736)	(0,6)	(5 387)
Yen japonais	1 840 458	(2 077 887)	(237 429)	(1,4)	(11 871)
Ringgit malaisien	234	–	234	–	12
Peso mexicain	4 633	–	4 633	–	232
Dollar néo-zélandais	26 910	–	26 910	0,2	1 346
Couronne norvégienne	(31 402)	(300 628)	(332 030)	(2,0)	(16 602)
Peso philippin	2 800	–	2 800	–	140
Zloty polonais	8 911	–	8 911	0,1	446
Dollar de Singapour	265	–	265	–	13
Rand sud-africain	(3 251)	(147 236)	(150 487)	(0,9)	(7 524)
Couronne suédoise	108 966	(519 436)	(410 470)	(2,4)	(20 524)
Franc suisse	140 087	(468 865)	(328 778)	(1,9)	(16 439)
Lire turque	4 778	–	4 778	–	239
Dirham des ÉAU	733	–	733	–	37
Dollar américain	5 781 559	(11 522 555)	(5 740 996)	(34,0)	(287 050)
Total	9 023 486	(16 328 745)	(7 305 259)	(43,2)	(365 262)

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Au 31 décembre 2022

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar australien	3 730	149 774	153 504	0,7	7 675
Livre sterling	113 860	179 286	293 146	1,4	14 657
Renminbi chinois	64	–	64	–	3
Couronne danoise	19 385	–	19 385	0,1	969
Euro	125 452	–	125 452	0,6	6 273
Dollar de Hong Kong	(4 871)	–	(4 871)	–	(244)
Forint hongrois	10 197	–	10 197	–	510
Roupie indonésienne	238	–	238	–	12
Nouveau shekel israélien	43 609	–	43 609	0,2	2 180
Yen japonais	(67 404)	579 842	512 438	2,5	25 622
Ringgit malaisien	8	–	8	–	–
Peso mexicain	(3 720)	–	(3 720)	–	(186)
Dollar néo-zélandais	32 097	–	32 097	0,2	1 605
Couronne norvégienne	6 308	–	6 308	–	315
Zloty polonais	7	–	7	–	–
Dollar de Singapour	(7 576)	–	(7 576)	–	(379)
Rand sud-africain	5 469	–	5 469	–	273
Couronne suédoise	10 862	(205 983)	(195 121)	(0,9)	(9 756)
Franc suisse	8 815	–	8 815	–	441
Lire turque	3 452	–	3 452	–	173
Dirham des ÉAU	751	–	751	–	38
Dollar américain	1 330 745	(211 409)	1 119 336	5,4	55 967
Total	1 631 478	491 510	2 122 988	10,2	106 148

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le risque de taux d'intérêt était négligeable, l'exposition du Fonds aux placements portant intérêt à long terme n'étant pas importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix, principalement en raison de ses placements en actions négociées sur des bourses. La quasi-totalité de l'actif net du Fonds attribuable aux porteurs de parts rachetables est exposé à l'autre risque de prix en raison de son exposition aux fluctuations du marché (ne découlant pas d'autres facteurs précités). Si les cours des actions négociées avaient augmenté ou diminué de 10 %, tous les autres facteurs demeurant inchangés, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué d'environ 726 000 \$ (1 885 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le risque de crédit était négligeable, car l'exposition du Fonds aux titres de créance n'était pas importante. Le Fonds était exposé au risque de crédit du fait de ses placements dans des instruments dérivés. Les gains latents sur les obligations contractuelles avec les contreparties correspondaient à 3,2 % (1,7 % au 31 décembre 2022) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables. Les contreparties aux instruments dérivés avaient toutes obtenu des notations de AA ou mieux (résultat de la combinaison des notations attribuées par diverses agences, comme Standard & Poor's, Moody's et Dominion Bond Rating Services).

Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Prêt de titre (note 12)

Pour les périodes closes les 30 juin 2023 et 2022, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2023 (\$)	2022 (\$)
Revenus bruts tirés du prêt de titres	1 502	1 104
Charges liées au prêt de titres	(297)	(217)
Revenus nets tirés du prêt de titres	1 205	887
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	(82)	(91)
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	1 123	796

Les charges liées au prêt de titres ont représenté 19,8 % (19,7 % en 2022) des revenus bruts tirés du prêt de titres, et ont été payées en totalité au dépositaire du Fonds.

Le tableau qui suit présente un aperçu des titres prêtés et des garanties détenues au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022.

	30 juin 2023 (en milliers de \$)	31 décembre 2022 (en milliers de \$)
Titres prêtés	953	848
Garanties reçues	1 000	890
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Effet de levier et emprunt (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 72,6 % à 208,0 % (de 62,1 % à 79,8 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 30 juin 2023, l'exposition totale du Fonds correspondait à 148,3 % (73,0 % au 31 décembre 2022) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur actions, de positions vendeur sur contrats de swap d'actions et des emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de 1 619 \$ à 15 765 627 \$ (de 1 873 990 \$ à 4 792 875 \$ en 2022), avec un taux d'intérêt moyen de 5,22 % (1,95 % en 2022). Au 30 juin 2023, les emprunts en trésorerie correspondaient à néant (15,7 % au 31 décembre 2022) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L
(auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)
États de la situation financière aux

	30 juin 2023 (non audité)	31 décembre 2022 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	7 197 713 \$	2 409 454 \$
Placements	12 267 958	22 962 988
Plus-value latente des contrats de change à terme	191 404	22 253
Plus-value latente des contrats de swap	583 640	320 991
Marge de variation quotidienne	1 629 643	2 029 587
Montant à recevoir du courtier	521 989	579 416
Dividendes à recevoir	31 804	60 755
Autres créances	33 073	205
Souscriptions à recevoir	51 070	–
	22 508 294	28 385 649
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	47 872	3 388 108
Placements vendus à découvert	9 694 434	5 619 834
Moins-value latente des contrats de change à terme	19 754	1 727
Moins-value latente des contrats de swap	372 540	320 346
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	39 666	14 881
Montant à payer au courtier	335 143	472 464
Frais d'emprunt de titres à payer	–	6 277
Charges à payer	18 383	59 483
Frais de gestion à payer	1 849	2 074
Rémunération au rendement à payer	–	5 991
	10 529 641	9 891 185
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	11 978 653 \$	18 494 464 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	456 375 \$	483 210 \$
Série F	943 534 \$	3 195 816 \$
Série I	10 578 744 \$	14 815 438 \$
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	44 592	48 055
Série F	90 397	313 938
Série I	1 004 039	1 454 887
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	10,23 \$	10,06 \$
Série F	10,44 \$	10,18 \$
Série I	10,54 \$	10,18 \$

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

Administrateur

« Tim Elliott »

Administrateur

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2023	2022
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	(394 442) \$	9 460 \$
Variation du gain (perte) de change latent	35 894	(16 750)
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	1 846	1 141
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	280 531	346 301
Charges de dividende sur les titres vendus à découvert	(105 998)	(70 887)
Intérêts aux fins des distributions	95 510	656
Gain (perte) net réalisé sur les placements	928 126	873 589
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	(257 565)	498 304
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	428 391	(68 478)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	(19 252)	37 979
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	87 243	(140 139)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	(119 988)	(4 118 755)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	(547 046)	832 142
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	151 124	(10 181)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	210 455	(87 556)
Gain (perte) net total sur placements	<u>1 131 531</u>	<u>(1 907 025)</u>
Total des revenus (pertes) nets	<u>774 829</u>	<u>(1 913 174)</u>
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	8 131	13 191
Honoraires des dépositaires	28 974	39 012
Frais de dépôt	12 389	22 251
Honoraires du comité d'examen indépendant	2 232	2 480
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	-	321
Charges d'intérêts	80 616	13 374
Frais de gestion	8 790	11 199
Rémunération au rendement	65	770
Coût d'emprunt de titres	7 941	40 743
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	5 962	4 589
Coûts d'opérations (note 9)	19 681	14 488
Total des charges d'exploitation	<u>174 781</u>	<u>162 418</u>
Retenues d'impôts (note 7)	<u>(21 155)</u>	<u>(6 902)</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>578 893 \$</u>	<u>(2 082 494) \$</u>

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2023	2022
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	10 412 \$	(53 431) \$
Série F	180 096 \$	(492 658) \$
Série I	<u>388 385 \$</u>	<u>(1 536 405) \$</u>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	44 019	43 340
Série F	119 199	221 970
Série I	<u>1 209 398</u>	<u>1 529 897</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	0,24 \$	(1,23) \$
Série F	1,51 \$	(2,22) \$
Série I	<u>0,32 \$</u>	<u>(1,00) \$</u>

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série A 2023	Série A 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	483 210 \$	491 333 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	10 412	(53 431)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	49 693	25 000
Rachat de parts rachetables	(86 940)	–
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(37 247)	25 000
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(26 835)	(28 431)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	456 375 \$	462 902 \$
	Série F 2023	Série F 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	3 195 816 \$	423 659 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	180 096	(492 658)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	541 571	4 013 635
Rachat de parts rachetables	(2 973 949)	(620)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(2 432 378)	4 013 015
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(2 252 282)	3 520 357
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	943 534 \$	3 944 016 \$

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série I 2023	Série I 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	14 815 438 \$	23 987 936 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	388 385	(1 536 405)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	15 002	32 882
Rachat de parts rachetables	(4 640 081)	(8 361 958)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(4 625 079)	(8 329 076)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(4 236 694)	(9 865 481)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	10 578 744 \$	14 122 455 \$
	Total 2023	Total 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	18 494 464 \$	24 902 928 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	578 893	(2 082 494)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	606 266	4 071 517
Rachat de parts rachetables	(7 700 970)	(8 362 578)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(7 094 704)	(4 291 061)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(6 515 811)	(6 373 555)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	11 978 653 \$	18 529 373 \$

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2023	2022
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	578 893 \$	(2 082 494) \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	(35 894)	16 750
(Gain) perte net réalisé sur les placements	(928 126)	(873 589)
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	257 565	(498 304)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	119 988	4 118 755
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	547 046	(832 142)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	(151 124)	10 181
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	(210 455)	87 556
Achat de placements	(51 637 394)	(37 113 191)
Produit de la vente de placements	66 330 657	41 420 720
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	399 944	(41 353)
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	28 951	(10 695)
(Augmentation) diminution des autres créances	(32 868)	-
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	(6 277)	5 800
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	24 785	22 681
Augmentation (diminution) des charges à payer	(41 100)	(590)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(225)	3 533
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	(5 991)	(2 874)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	15 238 375	4 230 744
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables	555 196	4 071 517
Rachat de parts rachetables	(7 700 970)	(8 362 578)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(7 145 774)	(4 291 061)
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	8 092 601	(60 317)
Variation du gain (perte) de change latent	35 894	(16 750)
Trésorerie, à l'ouverture de la période	2 409 454	804 922
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	(3 388 108)	(1 915 637)
	7 149 841	(1 187 782)
Trésorerie, à la clôture de la période	7 197 713 \$	2 467 158 \$
Dette bancaire, à la clôture de la période	(47 872) \$	(3 654 940) \$
	7 149 841 \$	(1 187 782) \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	288 372 \$	328 789 \$
Dividendes payés*	81 213	48 206
Intérêts reçus*	95 510	656
Intérêts payés*	80 616	13 374

* Inclus dans les activités d'exploitation.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Actions canadiennes – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 17,98 %)				
Athabasca Oil Corp.	8 700	12 380	24 969	
Baytex Energy Corp., TSE	700	3 691	3 024	
Bonterra Energy Corp.	600	5 538	3 354	
Crew Energy Inc.	2 600	9 560	14 144	
Ensign Energy Services Inc.	800	1 671	1 512	
Gear Energy Ltd.	1 500	1 692	1 440	
Parex Resources Inc.	1 586	36 777	42 124	
Peyto Exploration & Development Corp.	300	3 810	3 288	
Tourmaline Oil Corp.	900	56 706	56 176	
Whitecap Resources Inc.	600	6 432	5 562	
Yangarra Resources Ltd.	1 200	3 153	1 980	
		141 410	157 573	1,32
Matières premières (31 décembre 2022 : 12,16 %)				
Aris Mining Corp.	1 600	9 132	5 104	
Calibre Mining Corp.	1 800	1 934	2 502	
Capstone Copper Corp.	2 700	14 266	16 227	
Cascades inc.	900	11 455	10 521	
Centerra Gold Inc.	400	3 745	3 176	
Chemtrade Logistics Income Fund	1 527	13 209	12 506	
GoldMining Inc.	500	887	600	
IAMGOLD Corp.	300	1 229	1 053	
Interfor Corp.	900	20 945	22 482	
Labrador Iron Ore Royalty Corp.	800	28 937	24 864	
Liberty Gold Corp.	4 796	5 276	2 086	
Lucara Diamond Corp.	2 500	4 054	1 150	
Neo Performance Materials Inc.	200	2 247	1 640	
New Gold Inc.	7 700	11 814	11 088	
OceanaGold Corp.	9 699	26 606	25 314	
Orezone Gold Corp.	600	776	756	
Minière Osisko Inc.	2 400	9 633	7 728	
Silvercorp Metals inc.	1 800	11 017	6 786	
Taseko Mines Ltd.	571	706	1 085	
Western Forest Products Inc.	100	180	104	
		178 048	156 772	1,31
Industries (31 décembre 2022 : 14,92 %)				
ATS Corp.	1 300	49 523	79 235	
Black Diamond Group Ltd.	1 900	3 999	11 495	
Calian Group Ltd.	100	6 362	6 153	
Canadien Pacifique Kansas City Limitée, TSE	500	51 645	53 500	
Civeo Corp.	62	1 051	1 598	
Dexterra Group Inc.	140	1 133	804	
Doman Building Materials Group Ltd.	700	4 888	4 585	
Héroux-Devtek Inc.	300	5 378	4 602	
Magellan Aerospace Corp.	500	6 219	4 170	
NFI Group Inc. (NFI CN)	681	9 312	7 777	
Thomson Reuters Corp.	192	31 909	34 341	
Corporation Wajax	200	4 004	4 988	
Waste Connections Inc.	593	95 566	112 273	
		270 989	325 521	2,72

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 3,11 %)				
Les Industries Dorel Inc., cat B	700	7 725	3 213	
Roots Corp.	500	1 465	1 545	
		9 190	4 758	0,04
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 3,54 %)				
Soins de santé (31 décembre 2022 : 0,27 %)				
Dentalcorp Holdings Ltd.	500	4 049	3 670	
Extencicare Inc.	500	3 533	3 565	
XBiotech Inc.	200	1 018	1 572	
		8 600	8 807	0,07
Services financiers (31 décembre 2022 : 30,49 %)				
Brookfield Corp.	1 300	55 652	57 980	
Corporation Nuvei	400	44 894	15 648	
Onex Corp.	500	34 042	36 585	
		134 588	110 213	0,92
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 5,58 %)				
BlackBerry Ltd.	200	1 490	1 468	
Quarterhill Inc.	2 400	3 540	3 552	
Shopify Inc.	840	60 466	71 921	
		65 496	76 941	0,64
Services de communication (31 décembre 2022 : 5,34 %)				
Aimia Inc.	8 401	30 726	27 723	
BCE Inc.	600	36 728	36 240	
Cogeco Communications inc.	100	6 465	7 069	
Corus Entertainment Inc.	1 500	7 381	1 965	
Illumin Holdings Inc.	1 900	4 028	4 218	
Québecor inc.	800	25 786	26 120	
Rogers Communications Inc., TSE	200	11 496	12 088	
		122 610	115 423	0,96
Services publics (31 décembre 2022 : 4,71 %)				
Borex inc.	700	27 695	25 249	
Brookfield Infrastructure Corp.	400	22 725	24 164	
Fortis Inc.	1 300	74 652	74 217	
Northland Power Inc.	1 816	68 262	50 176	
Polaris Renewable Energy Inc.	1 100	19 062	15 675	
Superior Plus Corp.	2 628	31 225	24 940	
TransAlta Renewables Inc.	900	15 856	10 242	
		259 477	224 663	1,88
Immobilier (31 décembre 2022 : 3,16 %)				
Groupe Altus limitée	945	51 553	41 514	
FirstService Corp.	300	60 652	61 206	
FPI Granite	900	82 577	70 542	
InterRent REIT	2 400	30 798	30 768	
Killam Apartment REIT	1 800	37 542	31 788	
Morguard North American Residential Real Estate Investment	1 000	16 319	16 850	
		279 441	252 668	2,11
Total des actions canadiennes – position acheteur		1 469 849	1 433 339	11,97
Actions canadiennes – position vendeur				

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Énergie (31 décembre 2022 : -0,53 %)				
Computer Modelling Group Ltd.	(300)	(1 767)	(1 998)	
Denison Mines Corp.	(22 900)	(42 071)	(38 014)	
Energy Fuels Inc., NYSE	(7 284)	(51 435)	(60 131)	
Energy Fuels Inc., TSE	(5 000)	(47 513)	(41 150)	
Gibson Energy Inc.	(1 300)	(28 202)	(27 079)	
Headwater Exploration Inc.	(100)	(645)	(635)	
Pason Systems Inc.	(1 100)	(12 722)	(12 639)	
Petrus Resources Ltd.	(100)	(183)	(159)	
Pipestone Energy Corp.	(1 300)	(3 415)	(2 951)	
Shawcor Ltée	(100)	(680)	(1 916)	
Tamarack Valley Energy Ltd.	(3 700)	(13 791)	(11 877)	
Ur-Energy Inc.	(1 900)	(2 280)	(2 603)	
Vermilion Energy Inc., TSE	(4 800)	(84 999)	(79 296)	
		(289 703)	(280 448)	(2,34)
Matières premières (31 décembre 2022 : -0,49 %)				
Americas Gold & Silver Corp.	(3 500)	(8 455)	(1 628)	
Archer Exploration Corp.	(81)	(66)	(13)	
Canfor Pulp Products Inc.	(200)	(1 851)	(408)	
EcoSynthetix Inc.	(200)	(759)	(610)	
Endeavour Silver Corp.	(700)	(2 603)	(2 695)	
Equinox Gold Corp.	(2 400)	(14 996)	(14 568)	
Fortuna Silver Mines Inc.	(3 300)	(17 179)	(14 223)	
Largo Inc.	(100)	(760)	(562)	
Lithium Americas Corp.	(200)	(5 345)	(5 362)	
MAG Silver Corp.	(1 237)	(20 890)	(18 246)	
Marathon Gold Corp.	(1 000)	(763)	(810)	
Novagold Resources Inc.	(1 500)	(9 941)	(7 875)	
Orla Mining Ltd.	(900)	(5 320)	(5 004)	
Platinum Group Metals Ltd.	(700)	(1 738)	(1 316)	
SilverCrest Metals Inc.	(1 798)	(15 891)	(13 952)	
Skeena Resources Ltd.	(800)	(6 752)	(5 112)	
Wallbridge Mining Co., Ltd.	(1 500)	(997)	(218)	
Wesdome Gold Mines Ltd.	(500)	(3 371)	(3 450)	
		(117 677)	(96 052)	(0,80)
Industries (31 décembre 2022 : -0,09 %)				
Ballard Power Systems Inc.	(3 500)	(21 512)	(20 300)	
CAE inc., TSE	(4 000)	(117 160)	(118 600)	
Chorus Aviation Inc.	(1 400)	(5 239)	(4 242)	
La Compagnie Électrique Lion Corporation Internationale Masonite	(1 200)	(3 298)	(2 940)	
	(4)	(479)	(542)	
PyroGenèse Canada Inc.	(2 462)	(8 485)	(2 265)	
Corporation Savaria	(100)	(1 386)	(1 690)	
Transat AT inc.	(200)	(825)	(986)	
Westport Fuel Systems Inc.	(140)	(2 457)	(1 427)	
Xebec Adsorption Inc.	(4 300)	(9 817)	(2 236)	
		(170 658)	(155 228)	(1,30)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -0,25 %)				
Bragg Gaming Group Inc.	(200)	(1 088)	(818)	
Canada Goose Holdings Inc.	(1 000)	(22 302)	(23 580)	
ElectraMeccanica Vehicles Corp.	(5 245)	(20 874)	(4 307)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.	(500)	(31 237)	(30 295)	
Pollard Banknote Ltd.	(100)	(1 885)	(2 580)	
		(77 386)	(61 580)	(0,51)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -0,03 %)				
Andrew Peller Ltée	(200)	(1 208)	(820)	
SunOpta Inc.	(100)	(719)	(886)	
		(1 927)	(1 706)	(0,01)
Soins de santé (31 décembre 2022 : -0,42 %)				
Aurora Cannabis Inc.	(20 300)	(21 455)	(14 210)	
Bausch Health Cos Inc.	(500)	(5 655)	(5 300)	
Canopy Growth Corp.	(14 200)	(11 090)	(7 242)	
Cronos Group Inc.	(5 100)	(23 154)	(13 311)	
Oncolytics Biotech Inc.	(200)	(359)	(698)	
Organigram Holdings Inc.	(12 000)	(10 535)	(6 000)	
SNDL Inc.	(22 053)	(76 125)	(39 979)	
Well Health Technologies Corp.	(4 700)	(23 005)	(22 325)	
		(171 378)	(109 065)	(0,91)
Technologies de l'information (31 décembre 2022: -0,22 %)				
Canadian Solar Inc.	(444)	(22 645)	(22 731)	
Converge Technology Solutions Corp.	(3 200)	(11 687)	(10 240)	
Dye & Durham Ltd.	(200)	(3 286)	(3 622)	
Hut 8 Mining Corp	(13 200)	(34 867)	(58 080)	
Lightspeed Commerce Inc.	(4 500)	(97 412)	(100 845)	
Softchoice Corp.	(200)	(3 424)	(3 618)	
		(173 321)	(199 136)	(1,66)
Services de communication (31 décembre 2022 : -0,07 %)				
Enthusiast Gaming Holdings Inc.	(7 700)	(9 063)	(5 005)	
IMAX Corp.	(375)	(8 363)	(8 431)	
Telesat Corp.	(8)	(349)	(100)	
WildBrain Ltd.	(600)	(1 398)	(954)	
		(19 173)	(14 490)	(0,12)
Immobilier (31 décembre 2022 : -0,02 %)				
Fiducie d'impact Dream	(475)	(5 693)	(4 313)	
European Residential REIT	(900)	(3 302)	(2 574)	
Morguard REIT	(100)	(533)	(542)	
Tricon Residential Inc	(7 500)	(77 000)	(87 600)	
True North Commercial REIT	(1 200)	(3 805)	(2 856)	
		(90 333)	(97 885)	(0,82)
Total des actions canadiennes – position vendeur		(1 111 556)	(1 015 590)	(8,47)
Actions américaines – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 2,20 %)				
Baker Hughes Co.	2 199	85 587	91 979	
Chevron Corp.	416	92 014	86 616	
ConocoPhillips	169	23 883	23 170	
Exxon Mobil Corp.	718	105 034	101 897	
Forum Energy Technologies Inc.	11	428	372	
Gran Tierra Energy Inc., NYSE	5	62	32	
Gran Tierra Energy Inc., TSE	400	8 884	2 592	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Helix Energy Solutions Group Inc.	58	614	566	
Hess Corp.	19	3 633	3 418	
NACCO Industries Inc.	8	549	367	
Natural Gas Services Group Inc.	100	1 469	1 310	
Newpark Resources Inc.	339	1 850	2 346	
NOV Inc.	3	52	64	
Oil States International Inc.	260	1 789	2 570	
PHX Minerals Inc.	717	3 360	2 960	
Pioneer Natural Resources Co.	50	13 656	13 707	
SM Energy Co.	86	3 170	3 599	
Smart Sand Inc.	745	1 827	1 617	
Solaris Oilfield Infrastructure Inc.	91	1 288	1 003	
US Silica Holdings Inc.	98	1 866	1 573	
		351 015	341 758	2,85
Matières premières (31 décembre 2022 : 0,15 %)				
Gold Resource Corp.	161	439	134	
McEwen Mining Inc.	30	343	286	
Rayonier Advanced Materials Inc.	47	345	266	
RPM International Inc.	291	33 652	34 552	
Ryerson Holding Corp.	141	6 922	8 094	
		41 701	43 332	0,36
Industries (31 décembre 2022 : 0,51 %)				
ACCO Brands Corp.	886	5 405	6 108	
Acuty Brands Inc.	224	51 960	48 338	
Air Transport Services Group Inc.	229	6 381	5 718	
American Superconductor Corp.	92	580	762	
Applied Industrial Technologies Inc.	10	1 816	1 916	
ARC Document Solutions Inc.	100	477	429	
Armstrong World Industries Inc.	99	9 304	9 623	
Astronics Corp.	32	341	841	
Asure Software Inc.	177	2 535	2 848	
Axon Enterprise Inc.	16	4 782	4 131	
Babcock & Wilcox Enterprises Inc.	90	737	703	
BGSF Inc.	42	713	530	
BlueLinX Holdings Inc.	207	18 605	25 687	
BrightView Holdings Inc.	16	360	152	
CH Robinson Worldwide Inc.	424	55 587	52 935	
Comfort Systems USA Inc.	22	4 272	4 780	
Concrete Pumping Holdings Inc.	437	3 982	4 643	
Core & Main Inc.	868	26 694	35 996	
CoreCivic Inc.	761	9 381	9 476	
Curtiss-Wright Corp.	3	708	729	
Ducommun Inc.	22	1 277	1 268	
EMCOR Group Inc.	53	11 211	12 959	
Encore Wire Corp.	8	1 707	1 968	
Ennis Inc.	1 255	35 273	33 844	
Franklin Electric Co Inc.	5	597	681	
Frontier Group Holdings Inc.	488	6 927	6 244	
Generac Holdings Inc.	176	25 138	34 731	
Global Industrial Co.	287	10 154	10 546	
Graham Corp.	150	2 694	2 636	
Heartland Express Inc.	406	8 476	8 816	
Hexcel Corp.	16	1 617	1 609	
HireRight Holdings Corp.	472	6 883	7 064	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
HNI Corp.	95	3 540	3 542	
Hurco Cos Inc.	160	5 362	4 584	
Jacobs Solutions Inc.	38	6 014	5 978	
Kennametal Inc.	81	2 990	3 043	
Landstar System Inc.	145	34 428	36 943	
Liquidity Services Inc.	147	2 579	3 210	
LSI Industries Inc.	320	2 929	5 318	
Lyft Inc.	4 286	61 171	54 389	
Manitowoc Co Inc.	307	6 510	7 649	
McGrath RentCorp	28	3 358	3 426	
MillerKnoll Inc.	210	5 752	4 107	
Mistras Group Inc.	292	2 570	2 983	
Mueller Industries Inc.	20	1 946	2 310	
NL Industries Inc.	100	822	732	
Orion Group Holdings Inc.	104	358	387	
Park Aerospace Corp.	138	2 327	2 520	
Park-Ohio Holdings Corp.	150	2 635	3 771	
Powell Industries Inc.	234	13 347	18 761	
Proto Labs Inc.	405	17 895	18 736	
Radiant Logistics Inc.	100	723	889	
Sarcos Technology & Robotics Corp.	1 058	898	450	
Spirit AeroSystems Holdings Inc.	266	9 014	10 274	
Steelcase Inc.	1 018	11 360	10 386	
Sterling Infrastructure Inc.	182	7 085	13 438	
SunPower Corp.	1 123	21 227	14 563	
Terex Corp.	41	2 719	3 246	
Twin Disc Inc.	200	2 986	2 980	
Upwork Inc.	765	14 187	9 455	
V2X Inc.	200	11 124	13 116	
Wabash National Corp.	110	3 672	3 732	
Watco Inc.	86	36 325	43 411	
Woodward Inc.	5	627	787	
		615 054	647 827	5,41
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 1,55 %)				
2U Inc.	260	7 756	1 386	
ADT Inc.	648	6 775	5 170	
American Axle & Manufacturing Holdings Inc.	72	851	788	
AutoNation Inc.	17	3 053	3 703	
Beazer Homes USA Inc.	21	401	786	
Biglari Holdings Inc.	75	10 041	19 565	
Bluegreen Vacations Holding Corp.	65	1 316	3 066	
Carter's Inc.	278	26 428	26 707	
Cheesecake Factory Inc.	8	373	366	
Chegg Inc.	162	4 361	1 904	
Coursera Inc.	130	2 204	2 240	
Dana Inc.	389	7 709	8 751	
Dream Finders Homes Inc.	147	2 799	4 783	
Etsy Inc.	675	98 545	75 573	
Foot Locker Inc.	213	11 565	7 641	
Gap Inc.	197	2 514	2 328	
Green Brick Partners Inc.	28	868	2 104	
Group 1 Automotive Inc.	2	454	683	
Hanesbrands Inc.	514	4 061	3 088	
Harley-Davidson Inc.	147	7 115	6 849	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Hibbett Inc.	54	3 675	2 593	
Installed Building Products Inc.	4	658	742	
iRobot Corp.	3	422	180	
Kandi Technologies Group Inc.	113	379	592	
Landsea Homes Corp.	301	2 565	3 720	
Legacy Housing Corp.	99	3 046	3 038	
LGI Homes Inc.	9	1 263	1 606	
Lincoln Educational Services Corp.	46	345	410	
Lindblad Expeditions Holdings Inc.	54	767	777	
Lithia Motors Inc.	18	5 410	7 243	
Malibu Boats Inc.	117	8 680	9 082	
Marine Products Corp.	147	2 509	3 280	
Mister Car Wash Inc.	401	4 585	5 120	
National Vision Holdings Inc.	8	201	257	
Newell Brands Inc.	939	11 308	10 810	
Noodles & Co.	54	360	242	
Peloton Interactive Inc.	1 350	14 937	13 737	
PetMed Express Inc.	680	15 127	12 408	
PlayAGS Inc.	992	4 838	7 417	
Polaris Inc.	366	54 992	58 567	
Potbelly Corp.	175	2 529	2 033	
Qurate Retail Inc.	287	1 413	376	
Ralph Lauren Corp.	2	322	326	
Sonos Inc.	428	9 038	9 248	
Standard Motor Products Inc.	360	17 375	17 873	
Sturm Ruger & Co Inc.	341	25 348	23 897	
TopBuild Corp.	8	2 204	2 816	
Travel + Leisure Co.	1	49	53	
Universal Technical Institute Inc.	579	5 245	5 294	
Vacasa Inc.	1 782	2 258	1 600	
VF Corp.	1 542	47 135	38 952	
Wayfair Inc.	219	13 561	18 839	
Williams-Sonoma Inc.	206	33 389	34 112	
Wingstop Inc.	30	7 719	7 946	
Winnebago Industries Inc.	7	542	618	
		503 383	483 285	4,03
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 0,58 %)				
Celsius Holdings Inc.	3	379	592	
Elf Beauty Inc.	185	17 600	27 963	
Estee Lauder Cos Inc.	78	26 338	20 269	
Grocery Outlet Holding Corp.	2 469	92 273	100 005	
Hostess Brands Inc.	282	9 442	9 448	
Ingles Markets Inc.	11	1 314	1 203	
Inter Parfums Inc.	3	616	537	
Nature's Sunshine Products Inc.	28	387	506	
Nu Skin Enterprises Inc.	19	1 014	835	
Sprouts Farmers Market Inc.	147	6 815	7 145	
Turning Point Brands Inc.	6	351	191	
Village Super Market Inc.	34	1 020	1 027	
		157 549	169 721	1,42
Soins de santé (31 décembre 2022 : 2,40 %)				
89bio Inc.	548	11 472	13 741	
Acadia Healthcare Co Inc.	62	6 551	6 534	
ACADIA Pharmaceuticals Inc.	1 925	48 427	61 006	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Aclaris Therapeutics Inc.	92	1 005	1 262	
Adverum Biotechnologies Inc.	809	2 433	1 702	
Agios Pharmaceuticals Inc.	121	7 643	4 534	
Akebia Therapeutics Inc.	515	463	624	
Akero Therapeutics Inc.	389	20 456	24 033	
Altimmune Inc.	2 153	12 285	10 057	
Amicus Therapeutics Inc.	239	3 779	3 972	
AMN Healthcare Services Inc.	355	40 395	51 259	
Apellis Pharmaceuticals Inc.	355	30 793	42 794	
Apyx Medical Corp.	468	1 824	3 115	
Areturus Therapeutics Holdings Inc.	12	435	455	
Arvinas Inc.	142	14 033	4 664	
Assertio Holdings Inc.	184	586	1 320	
Astria Therapeutics Inc.	50	620	551	
Axogen Inc.	1 084	13 593	13 096	
Axonics Inc.	123	9 552	8 214	
Azenta Inc.	5	380	309	
BioAtla Inc.	1 469	5 041	5 832	
BioCryst Pharmaceuticals Inc.	262	3 636	2 441	
Bionano Genomics Inc.	1	7	1	
Blueprint Medicines Corp.	6	351	502	
Brookdale Senior Living Inc.	121	689	676	
Cara Therapeutics Inc.	25	365	94	
CareDx Inc.	229	6 577	2 576	
Castle Biosciences Inc.	25	746	454	
Chimerix Inc.	675	4 668	1 081	
Clearside Biomedical Inc.	291	815	431	
Clover Health Investments Corp.	709	1 011	842	
Cogent Biosciences Inc.	96	1 190	1 504	
Collegium Pharmaceutical Inc.	35	1 125	995	
CONMED Corp.	4	687	719	
Corcept Therapeutics Inc.	518	15 242	15 251	
Cullinan Oncology Inc.	593	8 488	8 443	
Cytokinetics Inc.	626	30 587	27 021	
CytomX Therapeutics Inc.	1 511	4 124	3 439	
Deciphera Pharmaceuticals Inc.	92	2 564	1 714	
Definitive Healthcare Corp.	1 736	24 345	25 269	
Elanco Animal Health Inc.	164	2 209	2 183	
Embecta Corp.	118	4 235	3 373	
Enovis Corp.	39	2 837	3 309	
Epizyme Inc., droits	3	-	4	
EQRx Inc.	439	1 219	1 080	
Esperion Therapeutics Inc.	1 389	5 039	2 555	
Eton Pharmaceuticals Inc.	100	474	462	
Exact Sciences Corp.	2	174	249	
Exelixis Inc.	477	11 742	12 062	
Glaukos Corp.	31	2 141	2 921	
GoodRx Holdings Inc.	864	7 387	6 311	
Halozyyme Therapeutics Inc.	72	4 123	3 437	
Harrow Health Inc.	53	1 532	1 335	
HealthEquity Inc.	75	5 877	6 266	
HealthStream Inc.	18	548	585	
Heron Therapeutics Inc.	77	448	118	
Hims & Hers Health Inc.	813	9 419	10 112	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Homology Medicines Inc.	50	388	59	
Ideaya Biosciences Inc.	46	1 200	1 430	
Illumina Inc.	13	3 635	3 225	
ImmunoGen Inc.	141	968	3 521	
Immunovant Inc.	267	6 466	6 702	
Inari Medical Inc.	78	6 586	6 001	
Insmid Inc.	327	9 172	9 130	
Intercept Pharmaceuticals Inc.	417	11 428	6 103	
Intra-Cellular Therapies Inc.	44	3 335	3 687	
Ionis Pharmaceuticals Inc.	583	28 526	31 653	
iRadimed Corp.	18	1 016	1 137	
iRhythm Technologies Inc.	7	1 054	966	
Ironwood Pharmaceuticals Inc.	329	5 131	4 632	
KalVista Pharmaceuticals Inc.	243	4 166	2 894	
Karuna Therapeutics Inc.	68	18 344	19 512	
Karyopharm Therapeutics Inc.	88	443	208	
KORU Medical Systems Inc.	200	1 096	913	
Krystal Biotech Inc.	4	368	621	
Lantheus Holdings Inc.	32	4 170	3 553	
Larimar Therapeutics Inc.	100	585	414	
Lineage Cell Therapeutics Inc.	233	369	435	
Madrigal Pharmaceuticals Inc.	47	16 288	14 366	
MannKind Corp.	119	866	641	
Medpace Holdings Inc.	16	4 311	5 085	
Mirati Therapeutics Inc.	289	14 799	13 817	
Myriad Genetics Inc.	95	2 991	2 914	
NanoString Technologies Inc.	7	387	38	
National HealthCare Corp.	100	7 737	8 180	
NextGen Healthcare Inc.	110	2 592	2 361	
Nkarta Inc.	1 188	5 626	3 443	
Nurix Therapeutics Inc.	64	1 047	846	
OPKO Health Inc.	1 009	3 564	2 897	
Orthofix Medical Inc.	73	1 865	1 745	
Pacira BioSciences Inc.	35	2 457	1 856	
PDL BioPharma Inc.	1 415	5 143	542	
Pediatrix Medical Group Inc.	15	448	282	
Pliant Therapeutics Inc.	410	16 950	9 831	
Point Biopharma Global Inc.	461	4 574	5 527	
Precision BioSciences Inc.	36	413	25	
Protagonist Therapeutics Inc.	152	4 838	5 555	
Puma Biotechnology Inc.	327	1 376	1 527	
Replimune Group Inc.	8	352	246	
Revance Therapeutics Inc.	194	7 154	6 497	
Rhythm Pharmaceuticals Inc.	85	2 107	1 855	
Sage Therapeutics Inc.	78	4 079	4 853	
Sarepta Therapeutics Inc.	12	1 970	1 818	
Savara Inc.	956	1 759	4 042	
Seer Inc.	549	2 871	3 102	
Shockwave Medical Inc.	12	4 137	4 532	
Tabula Rasa HealthCare Inc.	128	957	1 397	
Tactile Systems Technology Inc.	282	2 821	9 303	
Tandem Diabetes Care Inc.	245	14 780	7 956	
Teladoc Health Inc.	733	32 618	24 559	
Terns Pharmaceuticals Inc.	512	7 288	5 928	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
TransMedics Group Inc.	28	2 854	3 112	
Traverse Therapeutics Inc.	567	16 312	11 524	
Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	164	9 361	10 011	
Vanda Pharmaceuticals Inc.	140	1 507	1 221	
Varex Imaging Corp.	1 274	30 361	39 735	
Ventyx Biosciences Inc.	221	9 040	9 592	
Vericel Corp.	65	2 561	3 231	
Viking Therapeutics Inc.	142	3 860	3 046	
Viridian Therapeutics Inc.	187	6 722	5 887	
Waters Corp.	2	821	705	
Y-mAbs Therapeutics Inc.	305	2 526	2 740	
		773 923	764 055	6,38
Services financiers (31 décembre 2022 : 1,12 %)				
Aflac Inc.	4	371	369	
Allstate Corp.	535	79 839	77 193	
American Financial Group Inc.	87	15 815	13 671	
Bank OZK	158	7 321	8 396	
Bridgewater Bancshares Inc.	15	375	196	
BRP Group Inc.	108	4 181	3 541	
Charles Schwab Corp.	170	12 326	12 750	
Cincinnati Financial Corp.	175	26 002	22 536	
Crawford & Co., cat. A	29	360	426	
Crawford & Co., cat. B	108	821	1 342	
CVB Financial Corp.	150	3 374	2 636	
Eagle Bancorp Inc.	5	363	140	
eHealth Inc.	1 636	18 925	17 405	
ESSA Bancorp Inc.	100	2 174	1 978	
FNB Corp.	25	442	378	
Globe Life Inc.	407	59 727	59 037	
Granite Point Mortgage Trust Inc.	103	702	722	
Hanover Insurance Group Inc.	29	4 808	4 337	
Heritage Insurance Holdings Inc.	460	2 165	2 343	
Kinsale Capital Group Inc.	6	2 483	2 971	
Lincoln National Corp.	482	18 978	16 430	
M&T Bank Corp.	178	28 831	29 150	
Macatawa Bank Corp.	32	421	393	
Medallion Financial Corp.	147	1 248	1 539	
NerdWallet Inc.	475	10 622	5 915	
NMI Holdings Inc.	253	7 479	8 644	
Northwest Bancshares Inc.	27	450	379	
OFG Bancorp	12	402	414	
Oppenheimer Holdings Inc.	8	426	425	
Palomar Holdings Inc.	50	3 615	3 840	
Payoneer Global Inc.	1 275	10 802	8 115	
Popular Inc.	240	18 250	19 220	
Princeton Bancorp Inc.	35	1 509	1 265	
Prudential Financial Inc.	183	21 168	21 363	
Remitly Global Inc.	562	12 691	13 996	
RLI Corp.	17	3 065	3 070	
Ryan Specialty Holdings Inc.	1 110	58 405	65 934	
Sculptor Capital Management Inc.	291	7 682	3 400	
Selectquote Inc.	706	2 075	1 822	
Shore Bancshares Inc.	18	471	275	
Summit Financial Group Inc.	53	2 029	1 449	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Tiptree Inc.	150	2 904	2 979	
Toast Inc.	972	25 425	29 029	
Trupanion Inc.	51	2 712	1 328	
United Bankshares Inc.	120	4 959	4 711	
Universal Insurance Holdings Inc.	231	5 829	4 716	
US Bancorp	1 010	48 745	44 157	
W R Berkley Corp.	121	10 127	9 536	
Western New England Bancorp Inc.	69	925	533	
Western Union Co.	3 047	45 173	47 294	
Zions Bancorp NA	8	532	284	
		600 524	583 972	4,88
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 2,34 %)				
ACM Research Inc.	505	6 533	8 741	
Adeia Inc.	274	3 384	3 992	
Alarm.com Holdings Inc.	270	17 935	18 464	
Allegro MicroSystems Inc.	10	600	597	
Altair Engineering Inc.	127	12 061	12 745	
American Software Inc.	211	3 521	2 934	
Amtech Systems Inc.	29	359	367	
Arlo Technologies Inc.	186	1 917	2 685	
Avnet Inc.	340	20 157	22 698	
Bel Fuse Inc.	50	2 170	3 798	
Benchmark Electronics Inc.	12	373	410	
Braze Inc.	19	902	1 101	
Brightcove Inc., droits	1 756	10 543	9 318	
Calix Inc.	110	7 488	7 265	
Casa Systems Inc.	66	439	107	
CEVA Inc.	7	391	237	
Cirrus Logic Inc.	293	41 329	31 408	
Clear Secure Inc.	245	8 843	7 512	
Clearwater Analytics Holdings Inc.	134	2 781	2 814	
Cognex Corp.	141	9 266	10 452	
Cohu Inc.	264	13 259	14 518	
CPI Card Group Inc.	308	18 159	9 476	
CS Disco Inc.	166	1 481	1 806	
DocuSign Inc.	171	12 462	11 560	
Duolingo Inc.	277	51 214	52 393	
Expensify Inc.	385	4 033	4 065	
Extreme Networks Inc.	182	4 401	6 274	
F5 Inc.	30	5 504	5 806	
FormFactor Inc.	449	18 571	20 331	
F-Secure Oyj	1 347	6 153	4 541	
Gen Digital Inc.	39	901	957	
Gitlab Inc.	250	11 365	16 908	
Guidewire Software Inc.	291	26 406	29 296	
Infinera Corp.	826	8 422	5 279	
Informatica Inc.	1 263	27 685	30 918	
Intel Corp.	1 915	75 611	84 737	
Jamf Holding Corp.	1 125	29 430	29 058	
LiveRamp Holdings Inc.	106	3 956	4 006	
Magnachip Semiconductor Corp.	1 719	21 531	25 431	
nCino Inc.	532	16 879	21 203	
Nutanix Inc.	234	7 984	8 685	
PagerDuty Inc.	229	9 893	6 812	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
PCTEL Inc.	159	993	1 009	
PDF Solutions Inc.	80	4 582	4 774	
Pegasystems Inc.	54	3 399	3 523	
Photronics Inc.	350	7 726	11 944	
Porch Group Inc.	217	408	396	
Procore Technologies Inc.	123	9 645	10 591	
Pure Storage Inc.	1 691	57 012	82 388	
Q2 Holdings Inc.	130	5 649	5 315	
Rapid7 Inc.	204	24 262	12 223	
Richardson Electronics Ltd.	164	3 538	3 581	
Rimini Street Inc.	740	4 068	4 690	
RingCentral Inc.	327	16 850	14 162	
Samsara Inc.	401	10 421	14 703	
SecureWorks Corp.	174	3 313	1 665	
SEMrush Holdings Inc.	291	3 813	3 685	
Smartsheet Inc.	82	5 159	4 151	
Splunk Inc.	17	2 031	2 387	
Sprinklr Inc.	635	10 714	11 621	
Sprout Social Inc.	50	3 788	3 054	
Squarespace Inc.	1 570	64 406	65 524	
Super Micro Computer Inc.	98	13 704	32 322	
Tenable Holdings Inc.	84	5 718	4 841	
Varonis Systems Inc.	189	7 685	6 665	
Veeco Instruments Inc.	52	1 424	1 767	
Veritone Inc.	38	373	197	
Vertex Inc.	293	7 787	7 560	
Western Digital Corp.	72	3 493	3 614	
WM Technology Inc.	684	811	758	
Wolfspeed Inc.	167	13 080	12 284	
Zscaler Inc.	1	140	194	
		822 284	873 293	7,29
Services de communication (31 décembre 2022 : 1,16 %)				
AdTheorent Holding Co Inc.	345	642	639	
Altice USA Inc.	3	32	12	
Angi Inc.	310	3 765	1 354	
Bandwidth Inc.	36	1 840	652	
DHI Group Inc.	789	3 902	3 999	
HUUUGE Inc.	497	4 303	4 314	
Iridium Communications Inc.	202	16 056	16 604	
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	378	14 429	16 411	
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM, série C	340	15 443	14 725	
Lumen Technologies Inc.	4 199	29 142	12 557	
Madison Square Garden Sports Corp.	2	554	498	
NII Holdings Inc.	992	2 791	341	
Playstudios Inc.	205	1 134	1 332	
Roku Inc.	783	62 061	66 269	
Snap Inc.	2 064	28 294	32 337	
Spok Holdings Inc.	309	3 974	5 434	
Walt Disney Co.	895	117 780	105 734	
		306 142	283 212	2,36
Services publics (31 décembre 2022 : 0,09 %)				
AES Corp.	48	1 547	1 317	
Energy Vault Holdings Inc.	371	1 065	1 340	
Northwest Natural Holding Co.	5	336	285	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
NRG Energy Inc.	579	26 173	28 647	
ONE Gas Inc.	36	3 894	3 659	
Otter Tail Corp.	17	1 497	1 776	
RGC Resources Inc.	200	6 253	5 301	
UGI Corp.	13	607	464	
		41 372	42 789	0,36
Immobilier (31 décembre 2022 : 0,26 %)				
Outfront Media Inc.	20	502	416	
Zillow Group Inc.	413	23 927	27 467	
		24 429	27 883	0,23
Total des actions américaines – position acheteur		4 237 376	4 261 127	35,57
Actions américaines – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2022 : -1,58 %)				
Cactus Inc.	(774)	(42 150)	(43 344)	
Callon Petroleum Co.	(26)	(1 168)	(1 207)	
Centrus Energy Corp.	(16)	(695)	(688)	
Clean Energy Fuels Corp.	(1 245)	(7 116)	(8 171)	
Delek US Holdings Inc.	(4)	(115)	(127)	
Diamond Offshore Drilling Inc.	(268)	(3 744)	(5 050)	
Earthstone Energy Inc.	(561)	(10 003)	(10 608)	
Enviva Inc.	(1 379)	(21 032)	(19 799)	
Equitrans Midstream Corp.	(393)	(4 652)	(4 972)	
Gevo Inc.	(791)	(2 279)	(1 591)	
Gulfport Energy Corp.	(13)	(1 637)	(1 807)	
Liberty Energy Inc.	(1 335)	(23 089)	(23 618)	
New Fortress Energy Inc.	(133)	(4 699)	(4 713)	
NextDecade Corp.	(538)	(4 473)	(5 845)	
PBF Energy Inc.	(752)	(35 496)	(40 738)	
Permian Resources Corp.	(1 768)	(23 892)	(25 641)	
Southwestern Energy Co.	(3 094)	(19 800)	(24 606)	
Talos Energy Inc.	(620)	(11 313)	(11 379)	
Targa Resources Corp.	(380)	(37 330)	(38 266)	
Tellurian Inc.	(1 856)	(3 792)	(3 463)	
Tidewater Inc.	(74)	(4 460)	(5 429)	
Valero Energy Corp.	(38)	(5 654)	(5 898)	
Vertex Energy Inc.	(308)	(2 344)	(2 547)	
W&T Offshore Inc.	(88)	(486)	(451)	
		(271 419)	(289 958)	(2,42)
Matières premières (31 décembre 2022 : -0,33 %)				
Albemarle Corp.	(45)	(13 477)	(13 284)	
Alpha Metallurgical Resources Inc.	(4)	(853)	(870)	
Alto Ingredients Inc.	(2)	(14)	(8)	
American Vanguard Corp.	(101)	(2 976)	(2 388)	
Amyris Inc.	(1 630)	(5 205)	(2 222)	
Avery Dennison Corp.	(64)	(14 692)	(14 549)	
Avient Corp.	(30)	(1 631)	(1 624)	
Carpenter Technology Corp.	(11)	(720)	(817)	
Century Aluminum Co.	(104)	(1 258)	(1 200)	
CF Industries Holdings Inc.	(586)	(54 507)	(53 830)	
Corteva Inc.	(419)	(32 067)	(31 769)	
International Flavors & Fragrances Inc.	(250)	(26 485)	(26 329)	
Intrepid Potash Inc.	(32)	(829)	(961)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kaiser Aluminum Corp.	(12)	(1 165)	(1 138)	
Livent Corp.	(792)	(22 925)	(28 747)	
Loop Industries Inc.	(386)	(1 358)	(1 645)	
LSB Industries Inc.	(21)	(385)	(274)	
Mosaic Co.	(464)	(24 942)	(21 489)	
NewMarket Corp.	(3)	(1 243)	(1 596)	
Nucor Corp.	(5)	(1 010)	(1 085)	
Piedmont Lithium Inc.	(29)	(2 320)	(2 215)	
PureCycle Technologies Inc.	(525)	(4 986)	(7 426)	
Ranpak Holdings Corp.	(7)	(353)	(42)	
Scotts Miracle-Gro Co.	(250)	(23 909)	(20 739)	
Southern Copper Corp.	(84)	(7 973)	(7 974)	
Sylvamo Corp.	(62)	(3 933)	(3 319)	
Westrock Co.	(48)	(1 923)	(1 846)	
		(253 139)	(249 386)	(2,08)
Industries (31 décembre 2022 : -1,48 %)				
AAR Corp.	(474)	(35 160)	(36 228)	
Advanced Drainage Systems Inc.	(241)	(29 370)	(36 285)	
Ameresco Inc.	(23)	(1 488)	(1 480)	
American Airlines Group Inc.	(2 336)	(44 036)	(55 454)	
API Group Corp.	(1 001)	(29 186)	(36 108)	
Argan Inc.	(16)	(793)	(834)	
Avis Budget Group Inc.	(36)	(10 815)	(10 893)	
Blink Charging Co.	(82)	(996)	(650)	
CBIZ Inc.	(83)	(5 532)	(5 852)	
ChargePoint Holdings Inc.	(891)	(9 473)	(10 363)	
Chart Industries Inc.	(43)	(7 781)	(9 092)	
Clean Harbors Inc.	(257)	(48 252)	(55 918)	
CoStar Group Inc.	(51)	(6 087)	(6 006)	
Crane NXT Co.	(82)	(5 981)	(6 124)	
Delta Air Lines Inc.	(1 018)	(57 002)	(64 039)	
Driven Brands Holdings Inc.	(47)	(1 686)	(1 683)	
Enovix Corp.	(187)	(3 819)	(4 464)	
FedEx Corp.	(120)	(37 279)	(39 364)	
Fortive Corp.	(173)	(16 072)	(17 116)	
FuelCell Energy Inc.	(839)	(3 373)	(2 398)	
Gibraltar Industries Inc.	(52)	(3 484)	(4 329)	
Graco Inc.	(20)	(2 201)	(2 285)	
GrafTech International Ltd.	(153)	(880)	(1 020)	
Hayward Holdings Inc.	(635)	(9 710)	(10 797)	
Huntington Ingalls Industries Inc.	(1)	(281)	(301)	
Innovative Solutions and Support Inc.	(100)	(1 071)	(949)	
JELD-WEN Holding Inc.	(221)	(3 840)	(5 129)	
JetBlue Airways Corp.	(8 612)	(79 713)	(100 966)	
Kirby Corp.	(153)	(14 353)	(15 579)	
Kratos Defense & Security Solutions Inc.	(78)	(1 425)	(1 480)	
L3Harris Technologies Inc.	(19)	(4 833)	(4 922)	
Leonardo DRS Inc.	(282)	(5 297)	(6 470)	
MasTec Inc.	(336)	(42 782)	(52 451)	
Masterbrand Inc.	(4)	(44)	(62)	
MSA Safety Inc.	(3)	(521)	(691)	
Oshkosh Corp.	(75)	(8 280)	(8 593)	
Otis Worldwide Corp.	(160)	(18 446)	(18 845)	
Paycom Software Inc.	(36)	(14 728)	(15 303)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Paylocity Holding Corp.	(16)	(4 047)	(3 907)	
Performant Financial Corp.	(111)	(360)	(397)	
Plug Power Inc.	(1 593)	(25 374)	(21 901)	
Proterra Inc.	(452)	(1 044)	(718)	
REV Group Inc.	(17)	(360)	(298)	
Shoals Technologies Group Inc.	(751)	(19 500)	(25 400)	
Standex International Corp.	(3)	(548)	(562)	
Stanley Black & Decker Inc.	(29)	(3 337)	(3 596)	
Stem Inc.	(1 295)	(8 369)	(9 802)	
Sunrun Inc.	(934)	(22 307)	(22 073)	
Tennant Co.	(22)	(1 723)	(2 361)	
Textron Inc.	(1)	(47)	(89)	
TPI Composites Inc.	(7)	(388)	(96)	
TransUnion	(299)	(27 666)	(30 991)	
Trex Co Inc.	(308)	(20 621)	(26 720)	
TriNet Group Inc.	(412)	(47 979)	(51 775)	
Trinity Industries Inc.	(31)	(1 286)	(1 055)	
United Airlines Holdings Inc.	(1 144)	(71 255)	(83 062)	
Vertiv Holdings Co.	(183)	(5 113)	(5 998)	
Viad Corp.	(14)	(355)	(498)	
Virgin Galactic Holdings Inc.	(1 969)	(10 647)	(10 109)	
WW Grainger Inc.	(3)	(3 076)	(3 130)	
Xometry Inc.	(179)	(3 095)	(5 017)	
		(844 567)	(960 078)	(8,01)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -1,64 %)				
American Outdoor Brands Inc.	(59)	(741)	(678)	
America's Car-Mart Inc.	(85)	(8 825)	(11 223)	
AMMO Inc.	(1 238)	(9 694)	(3 489)	
Arhaus Inc.	(55)	(647)	(759)	
AutoZone Inc.	(5)	(16 046)	(16 497)	
Carvana Co.	(955)	(19 787)	(32 755)	
Children's Place Inc.	(36)	(870)	(1 106)	
Designer Brands Inc.	(95)	(1 209)	(1 270)	
Dick's Sporting Goods Inc.	(10)	(1 799)	(1 749)	
Escalade Inc.	(100)	(1 733)	(1 767)	
Ethan Allen Interiors Inc.	(347)	(11 295)	(12 985)	
EVgo Inc.	(128)	(651)	(678)	
Faraday Future Intelligent Electric Inc.	(3 035)	(847)	(803)	
Flexsteel Industries Inc.	(13)	(442)	(339)	
Full House Resorts Inc.	(280)	(2 647)	(2 482)	
Funko Inc.	(194)	(4 389)	(2 778)	
Gentherm Inc.	(25)	(2 424)	(1 869)	
Goodyear Tire & Rubber Co.	(251)	(4 977)	(4 544)	
GrowGeneration Corp.	(375)	(13 215)	(1 687)	
Haverty Furniture Cos Inc.	(87)	(3 153)	(3 479)	
Helen of Troy Ltd.	(2)	(321)	(286)	
Hyatt Hotels Corp.	(71)	(10 754)	(10 765)	
Kontoor Brands Inc.	(48)	(2 727)	(2 674)	
Kura Sushi USA Inc.	(10)	(858)	(1 230)	
La-Z-Boy Inc.	(28)	(1 121)	(1 061)	
Lazydays Holdings Inc.	(20)	(379)	(306)	
Life Time Group Holdings Inc.	(530)	(12 287)	(13 795)	
LL Flooring Holdings Inc.	(59)	(339)	(299)	
Lucid Group Inc.	(6 189)	(61 732)	(56 426)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Luminar Technologies Inc.	(270)	(2 167)	(2 458)	
Mullen Automotive Inc.	(653)	(4 997)	(93)	
O'Reilly Automotive Inc.	(84)	(103 402)	(106 184)	
Overstock.com Inc.	(106)	(2 846)	(4 568)	
Portillo's Inc.	(20)	(527)	(596)	
Shoe Carnival Inc.	(41)	(1 110)	(1 274)	
Sleep Number Corp.	(18)	(533)	(650)	
Sonic Automotive Inc.	(57)	(3 946)	(3 596)	
Sportsman's Warehouse Holdings Inc.	(82)	(494)	(618)	
Spruce Power Holding Corp.	(1 772)	(11 120)	(1 904)	
Stitch Fix Inc.	(105)	(736)	(535)	
Sweetgreen Inc.	(284)	(3 106)	(4 818)	
Target Hospitality Corp.	(184)	(3 141)	(3 267)	
Tempur Sealy International Inc.	(474)	(24 903)	(25 133)	
Tesla Inc.	(42)	(14 077)	(14 548)	
Under Armour Inc., cat. A	(44)	(653)	(420)	
Vista Outdoor Inc.	(52)	(1 949)	(1 904)	
Warby Parker Inc.	(110)	(1 729)	(1 702)	
Wolverine World Wide Inc.	(269)	(6 020)	(5 229)	
WW International Inc.	(250)	(2 775)	(2 223)	
XPEL Inc.	(124)	(9 633)	(13 819)	
Zumiez Inc.	(54)	(1 194)	(1 190)	
		(396 967)	(386 508)	(3,23)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -0,24 %)				
22nd Century Group Inc.	(1 316)	(1 158)	(666)	
Alico Inc.	(11)	(360)	(371)	
Andersons Inc.	(25)	(1 351)	(1 527)	
AppHarvest Inc.	(870)	(787)	(426)	
Beauty Health Co.	(75)	(815)	(831)	
BRC Inc.	(781)	(5 365)	(5 333)	
Calavo Growers Inc.	(141)	(6 653)	(5 414)	
Constellation Brands Inc.	(47)	(14 855)	(15 307)	
Dollar Tree Inc.	(189)	(33 642)	(35 888)	
Hain Celestial Group Inc.	(1 006)	(23 071)	(16 653)	
Lifecore Biomedical Inc.	(166)	(1 420)	(2 124)	
Limoneira Co.	(50)	(1 085)	(1 029)	
Mission Produce Inc.	(70)	(1 492)	(1 123)	
Pilgrim's Pride Corp.	(932)	(28 779)	(26 503)	
Rite Aid Corp.	(110)	(727)	(220)	
Tootsie Roll Industries Inc.	(100)	(6 090)	(4 686)	
US Foods Holding Corp.	(219)	(12 128)	(12 751)	
Vector Group Ltd.	(20)	(383)	(339)	
Veru Inc.	(112)	(620)	(176)	
		(140 781)	(131 367)	(1,10)
Soins de santé (31 décembre 2022 : -2,18 %)				
2seventy bio Inc.	(969)	(13 628)	(12 976)	
AdaptHealth Corp.	(477)	(8 727)	(7 682)	
ADMA Biologics Inc.	(29)	(63)	(142)	
Agenus Inc.	(2 166)	(4 226)	(4 586)	
Agilon health Inc.	(250)	(7 473)	(5 736)	
Alaunos Therapeutics Inc.	(1 162)	(2 937)	(784)	
Alector Inc.	(164)	(1 370)	(1 304)	
Allakos Inc.	(47)	(436)	(271)	
Allogene Therapeutics Inc.	(548)	(4 974)	(3 604)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
ALX Oncology Holdings Inc.	(517)	(4 031)	(5 138)	
Apollo Medical Holdings Inc.	(100)	(4 720)	(4 181)	
Arcus Biosciences Inc.	(303)	(7 507)	(8 143)	
Arcutis Biotherapeutics Inc.	(212)	(2 795)	(2 673)	
Arrowhead Pharmaceuticals Inc.	(44)	(2 407)	(2 076)	
Asensus Surgical Inc.	(956)	(1 491)	(639)	
Atossa Therapeutics Inc.	(437)	(421)	(729)	
Avidity Biosciences Inc.	(69)	(1 345)	(1 013)	
Axsome Therapeutics Inc.	(128)	(12 254)	(12 171)	
Beam Therapeutics Inc.	(939)	(40 145)	(39 674)	
BioLife Solutions Inc.	(299)	(7 799)	(8 744)	
Bio-Techne Corp.	(217)	(22 964)	(23 440)	
Bluebird Bio Inc.	(1 342)	(9 582)	(5 842)	
Bridgebio Pharma Inc.	(798)	(17 279)	(18 162)	
Butterfly Network Inc.	(234)	(872)	(712)	
Catalent Inc.	(436)	(22 073)	(25 016)	
Celldex Therapeutics Inc.	(11)	(532)	(494)	
Cerevel Therapeutics Holdings Inc.	(166)	(5 482)	(6 983)	
Certara Inc.	(1 231)	(38 059)	(29 662)	
Cigna Group	(62)	(22 093)	(23 021)	
Coherus Biosciences Inc.	(1 120)	(9 708)	(6 328)	
Denali Therapeutics Inc.	(296)	(9 800)	(11 558)	
DocGo Inc.	(1 878)	(21 729)	(23 285)	
Dynavax Technologies Corp.	(1 227)	(18 262)	(20 977)	
Eagle Pharmaceuticals Inc.	(1)	(39)	(26)	
Editas Medicine Inc.	(801)	(9 839)	(8 723)	
Enanta Pharmaceuticals Inc.	(6)	(389)	(170)	
Enhabit Inc.	(28)	(502)	(426)	
Enzo Biochem Inc.	(1 686)	(5 341)	(4 105)	
Evolent Health Inc.	(39)	(1 585)	(1 564)	
FibroGen Inc.	(101)	(334)	(361)	
Figs Inc.	(406)	(4 122)	(4 443)	
Fulgent Genetics Inc.	(129)	(9 487)	(6 321)	
GeneDx Holdings Corp.	(27)	(339)	(213)	
Geron Corp.	(2 208)	(7 585)	(9 379)	
Ginkgo Bioworks Holdings Inc.	(20 483)	(44 606)	(50 413)	
Humacyte Inc.	(189)	(999)	(715)	
IGM Biosciences Inc.	(164)	(1 948)	(2 003)	
ImmunityBio Inc.	(633)	(2 404)	(2 329)	
Inotiv Inc.	(226)	(1 255)	(1 426)	
Inovio Pharmaceuticals Inc.	(963)	(1 940)	(569)	
Intellia Therapeutics Inc.	(355)	(19 818)	(19 156)	
Invitae Corp.	(1 722)	(17 385)	(2 575)	
iTeos Therapeutics Inc.	(36)	(806)	(631)	
Keros Therapeutics Inc.	(100)	(5 778)	(5 317)	
Kura Oncology Inc.	(62)	(880)	(868)	
Kymera Therapeutics Inc.	(209)	(8 129)	(6 358)	
Maravai LifeSciences Holdings Inc.	(79)	(1 576)	(1 299)	
MiNK Therapeutics Inc.	(8)	(23)	(22)	
Moderna Inc.	(184)	(30 990)	(29 582)	
Neogen Corp.	(1 182)	(29 159)	(34 019)	
Ocugen Inc.	(2 255)	(2 204)	(1 621)	
Omeros Corp.	(91)	(346)	(655)	
Optinose Inc.	(156)	(368)	(254)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Outlook Therapeutics Inc.	(1 724)	(3 000)	(3 969)	
Pacific Biosciences of California Inc.	(1 062)	(15 085)	(18 690)	
Personalis Inc.	(30)	(365)	(75)	
ProPhase Labs Inc.	(60)	(627)	(576)	
R1 RCM Inc.	(3 277)	(55 568)	(80 004)	
Reata Pharmaceuticals Inc.	(36)	(4 482)	(4 857)	
REGENXBIO Inc.	(86)	(2 216)	(2 275)	
Relay Therapeutics Inc.	(391)	(8 574)	(6 498)	
REVOLUTION Medicines Inc.	(902)	(27 492)	(31 928)	
Rigel Pharmaceuticals Inc.	(10)	(43)	(17)	
Rocket Pharmaceuticals Inc.	(435)	(11 771)	(11 437)	
Schrodinger Inc.	(138)	(7 074)	(9 116)	
Seelos Therapeutics Inc.	(378)	(720)	(598)	
Senseonics Holdings Inc.	(346)	(756)	(349)	
Seres Therapeutics Inc.	(385)	(2 585)	(2 440)	
Societal CDMO Inc.	(159)	(355)	(231)	
Solid Biosciences Inc.	(201)	(1 822)	(1 394)	
Sotera Health Co.	(38)	(926)	(947)	
SpringWorks Therapeutics Inc.	(112)	(4 183)	(3 886)	
Standard BioTools Inc.	(345)	(807)	(881)	
Stereotaxis Inc.	(52)	(429)	(105)	
Surmodics Inc.	(25)	(1 122)	(1 036)	
Tilray Brands Inc., NASD	(3 150)	(10 993)	(6 502)	
Twist Bioscience Corp.	(552)	(13 061)	(14 945)	
Vera Therapeutics Inc.	(103)	(2 380)	(2 188)	
Verve Therapeutics Inc.	(107)	(2 144)	(2 655)	
Viatrix Inc.	(1 667)	(21 968)	(22 014)	
Vir Biotechnology Inc.	(840)	(27 212)	(27 266)	
X4 Pharmaceuticals Inc.	(1 392)	(3 040)	(3 573)	
Xencor Inc.	(700)	(26 201)	(23 129)	
Zentalis Pharmaceuticals Inc.	(282)	(10 599)	(10 527)	
Zevra Therapeutics Inc.	(209)	(1 383)	(1 410)	
Zoetis Inc.	(200)	(46 129)	(45 575)	
		(852 472)	(854 382)	(7,13)
Services financiers (31 décembre 2022 : -0,74 %)				
Affirm Holdings Inc.	(1 613)	(25 591)	(32 720)	
AG Mortgage Investment Trust Inc.	(214)	(2 062)	(1 733)	
American National Bankshares Inc.	(52)	(2 341)	(1 994)	
Annaly Capital Management Inc.	(902)	(23 753)	(23 883)	
Associated Banc-Corp	(53)	(1 134)	(1 138)	
Atlantic Union Bankshares Corp.	(67)	(3 107)	(2 301)	
Axos Financial Inc.	(129)	(6 586)	(6 732)	
Banc of California Inc.	(142)	(2 108)	(2 176)	
BankUnited Inc.	(969)	(29 711)	(27 632)	
BayCom Corp.	(33)	(822)	(728)	
Berkshire Hills Bancorp Inc.	(89)	(3 020)	(2 441)	
BOK Financial Corp.	(86)	(11 084)	(9 193)	
Brighthouse Financial Inc.	(1 167)	(66 816)	(73 119)	
BrightSpire Capital Inc.	(122)	(1 324)	(1 086)	
Cathay General Bancorp	(166)	(8 128)	(7 071)	
Central Pacific Financial Corp.	(145)	(3 580)	(3 014)	
Central Valley Community Bancorp	(50)	(1 137)	(1 022)	
Citizens & Northern Corp.	(105)	(3 401)	(2 682)	
City Holding Co.	(6)	(740)	(714)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Comerica Inc.	(3)	(381)	(168)	
Customers Bancorp Inc.	(67)	(1 701)	(2 683)	
East West Bancorp Inc.	(826)	(60 742)	(57 699)	
Equitable Holdings Inc.	(1)	(33)	(36)	
Federal Agricultural Mortgage Corp., cat. C	(2)	(355)	(380)	
Fidelity D&D Bancorp Inc.	(50)	(3 112)	(3 215)	
First Bancorp/Southern Pines NC	(159)	(6 951)	(6 259)	
First Bancshares Inc.	(23)	(807)	(786)	
First Citizens BancShares Inc.	(4)	(5 258)	(6 793)	
First Commonwealth Financial Corp.	(121)	(1 991)	(2 025)	
First Financial Northwest Inc.	(100)	(1 827)	(1 505)	
First Foundation Inc.	(142)	(1 546)	(746)	
First Guaranty Bancshares Inc.	(100)	(2 954)	(1 489)	
Flushing Financial Corp.	(36)	(727)	(585)	
Flywire Corp.	(35)	(1 111)	(1 438)	
Franklin BSP Realty Trust Inc.	(276)	(5 376)	(5 171)	
FVCBankcorp Inc.	(17)	(370)	(242)	
Glacier Bancorp Inc.	(18)	(870)	(742)	
Hancock Whitney Corp.	(199)	(9 596)	(10 106)	
Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc.	(715)	(25 571)	(23 653)	
Heartland Financial USA Inc.	(34)	(1 822)	(1 254)	
Hingham Institution For Savings The	(69)	(21 749)	(19 464)	
Hope Bancorp Inc.	(1 235)	(14 964)	(13 760)	
I3 Verticals Inc.	(33)	(1 089)	(998)	
Invesco Mortgage Capital Inc.	(123)	(2 037)	(1 867)	
Jackson Financial Inc.	(297)	(13 351)	(12 030)	
Lakeland Financial Corp.	(6)	(616)	(385)	
LendingClub Corp.	(461)	(4 456)	(5 948)	
Live Oak Bancshares Inc.	(250)	(8 649)	(8 704)	
MBIA Inc.	(160)	(2 171)	(1 829)	
Metrocity Bankshares Inc.	(167)	(4 031)	(3 953)	
Metropolitan Bank Holding Corp.	(32)	(1 641)	(1 471)	
National Bank Holdings Corp.	(139)	(6 408)	(5 341)	
NBT Bancorp Inc.	(88)	(4 899)	(3 709)	
New York Mortgage Trust Inc.	(51)	(634)	(669)	
Ocwen Financial Corp.	(18)	(678)	(714)	
Open Lending Corp.	(74)	(720)	(1 029)	
Pacific Premier Bancorp Inc.	(669)	(21 888)	(18 307)	
Park National Corp.	(53)	(9 755)	(7 176)	
Penns Woods Bancorp Inc.	(100)	(3 555)	(3 312)	
PennyMac Financial Services Inc.	(237)	(18 963)	(22 050)	
Perella Weinberg Partners	(439)	(5 464)	(4 839)	
Piper Sandler Cos	(117)	(21 738)	(20 012)	
PJT Partners Inc.	(4)	(374)	(369)	
RBB Bancorp	(94)	(1 525)	(1 485)	
Ready Capital Corp.	(43)	(620)	(642)	
Republic Bancorp Inc.	(7)	(423)	(394)	
Riverview Bancorp Inc.	(310)	(2 586)	(2 067)	
Seacoast Banking Corp. of Florida	(23)	(757)	(673)	
ServisFirst Bancshares Inc.	(105)	(8 249)	(5 685)	
Sierra Bancorp	(218)	(4 870)	(4 895)	
SLM Corp.	(189)	(3 593)	(4 082)	
SoFi Technologies Inc.	(1 440)	(10 522)	(15 892)	
Southern First Bancshares Inc.	(82)	(4 216)	(2 686)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
StepStone Group Inc.	(32)	(1 057)	(1 051)	
Synovus Financial Corp.	(585)	(22 732)	(23 416)	
Texas Capital Bancshares Inc.	(22)	(1 522)	(1 499)	
TriCo Bancshares	(79)	(6 094)	(3 471)	
Triumph Financial Inc.	(21)	(1 673)	(1 687)	
Unity Bancorp Inc.	(25)	(724)	(780)	
Valley National Bancorp.	(1 085)	(13 454)	(11 127)	
Veritex Holdings Inc	(135)	(3 322)	(3 203)	
Walker & Dunlop Inc.	(19)	(1 975)	(1 988)	
Washington Federal Inc.	(316)	(13 022)	(11 089)	
WesBanco Inc.	(9)	(387)	(305)	
Westamerica BanCorp	(5)	(364)	(253)	
Western Alliance Bancorp	(1 012)	(49 011)	(48 838)	
World Acceptance Corp.	(2)	(296)	(355)	
		(652 370)	(633 853)	(5,29)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -3,11 %)				
3D Systems Corp.	(80)	(1 047)	(1 051)	
ACV Auctions Inc.	(62)	(1 024)	(1 417)	
Aehr Test Systems	(19)	(724)	(1 037)	
Aeva Technologies Inc.	(38)	(369)	(63)	
Amkor Technology Inc.	(363)	(12 953)	(14 290)	
Applied Optoelectronics Inc.	(52)	(297)	(410)	
Arista Networks Inc.	(102)	(22 488)	(21 873)	
Aspen Technology Inc.	(25)	(6 002)	(5 545)	
Avid Technology Inc.	(20)	(666)	(675)	
BILL Holdings Inc.	(1)	(101)	(155)	
Broadcom Inc.	(8)	(8 220)	(9 183)	
C3.ai Inc.	(967)	(35 448)	(46 615)	
CCC Intelligent Solutions Holdings Inc.	(69)	(812)	(1 024)	
Ceridian HCM Holding Inc.	(300)	(28 318)	(26 655)	
Cleantech Inc.	(715)	(9 010)	(4 059)	
Clearfield Inc.	(85)	(5 725)	(5 326)	
Comtech Telecommunications Corp.	(293)	(4 801)	(3 544)	
Consensus Cloud Solutions Inc.	(7)	(353)	(287)	
CTS Corp.	(21)	(959)	(1 185)	
Digimarc Corp.	(33)	(838)	(1 286)	
Digital Turbine Inc.	(658)	(34 367)	(8 080)	
E2open Parent Holdings Inc.	(657)	(4 016)	(4 868)	
Eastman Kodak Co.	(116)	(579)	(709)	
Enphase Energy Inc.	(111)	(24 325)	(24 599)	
Entegris Inc.	(43)	(5 745)	(6 306)	
Envestnet Inc.	(283)	(22 041)	(22 225)	
Fair Isaac Corp.	(20)	(18 102)	(21 416)	
Five9 Inc.	(151)	(13 103)	(16 474)	
Genasys Inc.	(100)	(456)	(344)	
Grid Dynamics Holdings Inc.	(240)	(4 964)	(2 938)	
IonQ Inc.	(802)	(6 256)	(14 359)	
IPG Photonics Corp.	(67)	(11 130)	(12 041)	
Jabil Inc.	(188)	(21 369)	(26 850)	
Lam Research Corp.	(3)	(2 555)	(2 552)	
Marvell Technology Inc.	(152)	(11 961)	(12 024)	
Meta Materials Inc.	(3 581)	(975)	(1 020)	
Micron Technology Inc.	(173)	(15 461)	(14 447)	
MicroStrategy Inc.	(45)	(18 316)	(20 390)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
MKS Instruments Inc.	(81)	(9 946)	(11 586)	
MongoDB Inc.	(11)	(5 685)	(5 982)	
Monolithic Power Systems Inc.	(5)	(3 363)	(3 574)	
Napco Security Technologies Inc.	(39)	(562)	(1 788)	
Navitas Semiconductor Corp.	(400)	(4 131)	(5 579)	
NCR Corp.	(544)	(17 053)	(18 140)	
Palantir Technologies Inc.	(1 377)	(25 388)	(27 933)	
PAR Technology Corp.	(39)	(2 323)	(1 699)	
PFSweb Inc.	(82)	(1 265)	(490)	
Rackspace Technology Inc.	(131)	(357)	(472)	
SentinelOne Inc.	(30)	(522)	(599)	
Smith Micro Software Inc.	(73)	(283)	(107)	
SolarEdge Technologies Inc.	(83)	(31 672)	(29 550)	
SPS Commerce Inc.	(2)	(407)	(508)	
TD SYNEX Corp.	(61)	(7 368)	(7 587)	
Unity Software Inc.	(1 259)	(66 961)	(72 336)	
Universal Display Corp.	(30)	(6 162)	(5 722)	
Viasat Inc.	(194)	(9 783)	(10 592)	
Zebra Technologies Corp.	(80)	(31 153)	(31 316)	
		(580 260)	(592 882)	(4,95)
Services de communication (31 décembre 2022 : -0,72 %)				
ATN International Inc.	(100)	(5 525)	(4 843)	
Cable One Inc.	(5)	(4 660)	(4 347)	
Cardlytics Inc.	(13)	(491)	(109)	
Cineverse Corp.	(43)	(1 670)	(108)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	(1 151)	(3 754)	(2 087)	
Consolidated Communications Holdings Inc.	(101)	(515)	(512)	
Daily Journal Corp.	(1)	(479)	(383)	
DISH Network Corp.	(8)	(360)	(70)	
Entravision Communications Corp.	(152)	(917)	(883)	
EW Scripps Co.	(371)	(4 333)	(4 492)	
FuboTV Inc.	(1 575)	(4 495)	(4 335)	
Globalstar Inc.	(3 875)	(6 568)	(5 538)	
Gogo Inc.	(369)	(6 820)	(8 306)	
IAC Inc.	(357)	(26 570)	(29 667)	
Liberty Broadband Corp.	(288)	(31 859)	(30 529)	
Liberty Media Corp-Liberty Braves, série C	(103)	(5 128)	(5 400)	
Madison Square Garden Entertainment Corp.	(6)	(267)	(267)	
Magnite Inc.	(471)	(6 317)	(8 507)	
Marcus Corp.	(522)	(12 056)	(10 244)	
Omnicom Group Inc.	(3)	(365)	(378)	
Shenandoah Telecommunications Co.	(223)	(5 789)	(5 733)	
Sphere Entertainment Co.	(51)	(2 174)	(1 848)	
TechTarget Inc.	(11)	(971)	(453)	
Trade Desk Inc.	(25)	(2 069)	(2 555)	
TripAdvisor Inc.	(1 180)	(26 340)	(25 748)	
Warner Bros Discovery Inc.	(3 721)	(68 787)	(61 744)	
WideOpenWest Inc.	(26)	(364)	(290)	
Ziff Davis Inc.	(78)	(7 990)	(7 231)	
ZipRecruiter Inc.	(196)	(4 120)	(4 606)	
		(241 753)	(231 213)	(1,93)
Services publics (31 décembre 2022 : -0,87 %)				
Array Technologies Inc.	(597)	(17 598)	(17 853)	
Cadiz Inc.	(463)	(1 991)	(2 487)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
California Water Service Group	(4)	(330)	(273)	
Clearway Energy Inc., cat. C	(400)	(16 811)	(15 117)	
Middlesex Water Co.	(3)	(301)	(320)	
		(37 031)	(36 050)	(0,30)
Immobilier (31 décembre 2022 : -0,67 %)				
Alexandria Real Estate Equities Inc.	(41)	(6 306)	(6 157)	
Apartment Investment and Management Co.	(3 383)	(32 432)	(38 140)	
Armada Hoffer Properties Inc.	(286)	(4 838)	(4 420)	
Boston Properties Inc.	(77)	(5 654)	(5 868)	
CBRE Group Inc.	(862)	(87 959)	(92 061)	
City Office REIT Inc.	(193)	(2 799)	(1 423)	
Community Healthcare Trust Inc.	(58)	(2 786)	(2 534)	
Compass Inc.	(789)	(3 408)	(3 654)	
Corporate Office Properties Trust	(15)	(524)	(471)	
Cousins Properties Inc.	(67)	(1 932)	(2 021)	
Crown Castle Inc.	(111)	(16 480)	(16 735)	
EastGroup Properties Inc.	(13)	(2 910)	(2 986)	
Elme Communities	(17)	(403)	(370)	
Empire State Realty Trust Inc.	(100)	(785)	(991)	
Equity Commonwealth	(39)	(1 045)	(1 046)	
eXp World Holdings Inc.	(1 346)	(32 199)	(36 120)	
Farmland Partners Inc.	(100)	(1 744)	(1 616)	
Five Point Holdings LLC	(401)	(1 329)	(1 533)	
FRP Holdings Inc.	(11)	(808)	(838)	
Getty Realty Corp.	(126)	(6 045)	(5 639)	
Gladstone Commercial Corp.	(46)	(761)	(753)	
Gladstone Land Corp.	(240)	(5 059)	(5 167)	
Global Net Lease Inc.	(1 274)	(21 390)	(17 330)	
Highwoods Properties Inc.	(89)	(2 671)	(2 816)	
Howard Hughes Corp.	(138)	(14 211)	(14 411)	
Independence Realty Trust Inc.	(271)	(5 935)	(6 534)	
Iron Mountain Inc.	(27)	(1 988)	(2 030)	
Jones Lang LaSalle Inc.	(186)	(35 396)	(38 346)	
Kennedy-Wilson Holdings Inc.	(364)	(8 045)	(7 866)	
Macerich Co.	(1 825)	(23 602)	(27 216)	
Marcus & Millichap Inc.	(238)	(10 682)	(9 923)	
Maui Land & Pineapple Co Inc.	(100)	(1 478)	(1 884)	
Newmark Group Inc.	(82)	(726)	(675)	
Offerpad Solutions Inc.	(33)	(344)	(566)	
Office Properties Income Trust	(45)	(711)	(459)	
Opendoor Technologies Inc.	(1 127)	(2 695)	(5 995)	
Orion Office REIT Inc.	(265)	(3 133)	(2 318)	
RLJ Lodging Trust	(1 485)	(19 538)	(20 181)	
RPT Realty	(298)	(3 754)	(4 121)	
Sabra Health Care REIT Inc.	(58)	(878)	(903)	
Safehold Inc.	(10)	(1 142)	(314)	
SBA Communications Corp.	(4)	(1 394)	(1 227)	
Seritage Growth Properties	(42)	(423)	(496)	
Service Properties Trust	(67)	(870)	(770)	
SL Green Realty Corp.	(893)	(32 989)	(35 509)	
St Joe Co.	(100)	(5 609)	(6 397)	
Stratus Properties Inc.	(100)	(3 858)	(3 474)	
Summit Hotel Properties Inc.	(148)	(1 392)	(1 275)	
Sunstone Hotel Investors Inc.	(28)	(354)	(375)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Tejon Ranch Co.	(100)	(1 964)	(2 277)	
Urban Edge Properties	(1 344)	(26 126)	(27 441)	
Veris Residential Inc.	(205)	(3 985)	(4 354)	
Vornado Realty Trust	(90)	(2 019)	(2 160)	
Whitestone REIT	(62)	(736)	(796)	
WP Carey Inc.	(6)	(677)	(536)	
		(458 921)	(481 518)	(4,02)
Total des actions américaines – position vendeur		(4 729 680)	(4 847 195)	(40,46)
Actions étrangères – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 1,50 %)				
Aker Solutions ASA	2 608	7 291	12 530	
Borr Drilling Ltd.	475	3 271	4 617	
BP Castrol KK	100	927	805	
BW Energy Ltd.	135	497	430	
BW LPG Ltd.	2 727	35 551	36 107	
BW Offshore Ltd.	256	1 057	828	
Channel Infrastructure NZ Ltd.	18 872	23 925	22 490	
DHT Holdings Inc.	424	3 878	4 786	
DNO ASA	728	1 195	850	
Dorian LPG Ltd.	198	3 860	6 720	
Ecopetrol SA	2 748	36 935	37 272	
ENEOS Holdings Inc.	4 800	22 381	21 726	
Equinor ASA	217	8 225	8 365	
FLEX LNG Ltd.	307	7 760	12 407	
Frontline PLC, NYSE	3 782	81 210	72 715	
Frontline PLC, OSL	428	7 963	8 166	
Hafnia Ltd.	383	2 668	2 481	
Idemitsu Kosan Co., Ltd.	1 800	52 556	47 559	
Indo Tambangraya Megah Tbk PT	200	730	426	
Inpex Corp.	600	9 100	8 778	
Ithaca Energy PLC	377	1 446	959	
Japan Petroleum Exploration Co., Ltd.	100	3 982	3 937	
MMA Offshore Ltd.	13 383	13 373	13 556	
Nabors Industries Ltd., bons de souscription, éch. le 11 juin 2026	26	-	396	
New Hope Corp. Ltd.	432	2 072	1 845	
Nordic American Tankers Ltd.	1 291	4 367	6 269	
Oil Refineries Ltd.	22 183	9 116	8 369	
Saipem SpA	20 644	36 385	37 998	
Saras SpA	2 933	4 910	4 808	
Semirara Mining & Power Corp.	6 600	6 086	4 430	
SFL Corp. Ltd.	1 310	12 764	16 173	
Soechi Lines Tbk PT	199 100	3 232	3 128	
Subsea 7 SA	787	12 192	12 991	
Teekay Corp.	190	805	1 519	
TORM PLC	542	25 594	17 255	
United Tractors Tbk PT	2 300	4 839	4 725	
Valaris Ltd.	86	7 459	7 161	
Viva Energy Group Ltd.	125	358	331	
Whitehaven Coal Ltd.	13 869	88 788	81 970	
		548 748	537 878	4,49

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L
(auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)
Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Matières premières (31 décembre 2022 : 1,29 %)				
Air Water Inc.	700	12 816	12 776	
Akcansa Cimento AS	793	3 512	3 564	
Alkane Resources Ltd.	1 967	1 309	1 221	
Arafura Rare Earths Ltd.	10 676	4 901	2 868	
Base Resources Ltd.	6 051	1 096	906	
BlueScope Steel Ltd.	622	11 100	11 259	
Borregaard ASA	107	2 594	2 099	
Carlit Holdings Co., Ltd.	300	2 116	2 277	
Cementir Holding NV	304	3 467	3 256	
Cemex SAB de CV	1	7	9	
China BlueChemical Ltd.	4 000	1 406	1 189	
China Nonferrous Mining Corp. Ltd.	1 000	706	625	
CK-San-Etsu Co., Ltd.	100	4 356	4 001	
Constellium SE	218	4 454	4 962	
Dai Nippon Toryo Co., Ltd.	700	5 687	5 877	
Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co., Ltd.	100	1 844	1 916	
De Grey Mining Ltd.	2 573	3 567	3 048	
DRDGOLD Ltd.	3 996	49 741	56 155	
Elkem ASA	155	698	476	
Evonik Industries AG	17	429	428	
Fujikura Kasei Co., Ltd.	1 200	5 293	5 032	
Grange Resources Ltd.	1 344	342	633	
Gun-Ei Chemical Industry Co., Ltd.	200	5 045	5 308	
Harima Chemicals Group Inc.	400	3 696	3 219	
Harmony Gold Mining Co., Ltd.	9 774	55 033	54 320	
Hexpol AB	25	403	350	
Hokkan Holdings Ltd.	200	2 801	2 538	
Hokko Chemical Industry Co., Ltd.	100	885	923	
Ishihara Chemical Co., Ltd.	200	3 129	3 142	
Japan Pure Chemical Co., Ltd.	300	7 302	7 127	
Jaya Tiasa Holdings BHD	44 200	8 437	8 646	
JCU Corp.	100	3 169	3 113	
JFE Holdings Inc	400	7 352	7 507	
JSP Corp.	200	3 212	3 422	
Jupiter Mines Ltd.	4 480	952	769	
Kalekim Kimyevi Maddeler Sanayi ve Ticaret AS	2 020	5 624	5 660	
Kansai Paint Co., Ltd.	100	1 834	1 936	
Katakura & Co-op Agri Corp.	200	2 333	2 314	
Koatsu Gas Kogyo Co., Ltd.	300	2 073	2 054	
Kumiai Chemical Industry Co., Ltd.	5 800	50 304	59 472	
Kurimoto Ltd.	300	5 517	6 122	
Kuriyama Holdings Corp.	100	877	862	
Kyowa Leather Cloth Co., Ltd.	200	975	1 038	
Liontown Resources Ltd.	2 115	4 973	5 272	
Loma Negra Cia Industrial Argentina SA	65	606	585	
Macmahon Holdings Ltd.	2 589	354	353	
Mitsubishi Paper Mills Ltd.	200	705	1 033	
Mitsubishi Steel Manufacturing Co., Ltd.	100	1 212	1 262	
Moriroku Holdings Co., Ltd.	100	1 906	1 901	
Neturen Co., Ltd.	1 100	10 031	9 789	
Nihon Parkerizing Co., Ltd.	100	1 021	979	
Nippon Carbide Industries Co Inc.	200	2 479	2 571	
Norsk Hydro ASA	5 006	49 114	39 447	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Oat Agrio Co., Ltd.	300	4 269	5 622	
Ora Banda Mining Ltd.	3 415	387	376	
Orica Ltd.	2 276	31 626	29 730	
Pact Group Holdings Ltd.	462	420	269	
Perenti Ltd.	7 775	8 172	7 020	
Pilbara Minerals Ltd.	4 839	19 563	20 843	
Ramelius Resources Ltd	398	403	442	
Rasa Industries Ltd.	200	4 185	3 885	
Regis Resources Ltd.	1 746	2 985	2 814	
Resolute Mining Ltd.	4 081	1 405	1 402	
Sanyo Chemical Industries Ltd.	100	4 532	3 882	
Seiko PMC Corp.	400	2 200	2 172	
Sekisui Kasei Co., Ltd.	300	1 247	1 206	
Shikoku Kasei Holdings Corp.	400	5 542	5 511	
Silver Lake Resources Ltd.	460	468	391	
Sinopec Shanghai Petrochemical Co., Ltd.	330 000	72 315	68 538	
St Barbara Ltd.	829	493	350	
Tayca Corp.	100	1 182	1 258	
Ten Sixty Four Ltd.	1 777	1 048	884	
Tokyo Rope Manufacturing Co., Ltd.	600	6 175	6 388	
Tokyo Tekko Co., Ltd.	100	1 878	3 012	
Topy Industries Ltd.	800	15 451	16 575	
Toray Industries Inc.	100	742	733	
Tsaker New Energy Tech Co., Ltd.	2 500	587	540	
Westgold Resources Ltd.	2 571	2 714	3 261	
Yushiro Chemical Industry Co., Ltd.	300	2 873	2 980	
		557 657	557 695	4,66
Industries (31 décembre 2022 : 1,36 %)				
Advan Group Co., Ltd.	200	1 768	1 694	
Aichi Corp.	100	803	799	
Alineo Inc.	200	2 039	1 833	
Alps Logistics Co., Ltd.	100	1 284	1 477	
Anest Iwata Corp.	200	2 017	2 161	
Auckland International Airport Ltd.	3 550	26 701	24 606	
Austal Ltd.	12 164	19 045	25 393	
Belimo Holding AG	6	3 243	3 960	
Binjiang Service Group Co., Ltd.	500	1 904	1 739	
Blue Bird Tbk PT	49 000	9 162	9 298	
Bossard Holding AG	4	1 681	1 176	
Bunka Shutter Co., Ltd.	300	3 396	3 040	
Cargotec Oyj	82	5 127	5 960	
Cebu Air Inc.	4 000	3 593	3 596	
Cembre SpA	259	11 797	11 441	
Chilled & Frozen Logistics Holdings Co., Ltd.	100	1 138	1 154	
Cimpress PLC	34	2 013	2 676	
CITIC Resources Holdings Ltd.	6 000	462	400	
Corp America Airports SA	1 889	20 296	28 970	
Cosel Co., Ltd.	400	4 553	4 581	
D/S Norden A/S	40	2 751	2 640	
Daiichi Jitsugyo Co., Ltd.	100	5 419	5 209	
Daisue Construction Co., Ltd.	500	6 142	6 262	
Danieli & C Officine Meccaniche SpA, RSP	100	2 779	2 428	
Denyo Co., Ltd.	300	5 253	5 661	
Deutsche Lufthansa AG	15	139	203	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
E-Commodities Holdings Ltd.	6 000	1 423	1 064	
El Al Israel Airlines	7 104	9 703	12 468	
Embraer SA	260	3 559	5 319	
Emeco Holdings Ltd.	5 089	3 033	2 914	
Endo Lighting Corp.	100	831	1 161	
Eurogroup Laminations SpA	3	24	28	
Ferreycorp SAA	501	393	402	
Finnair Oyj	4 943	3 765	4 035	
Fiverr International Ltd.	37	1 702	1 273	
Fletcher Building Ltd.	18 848	72 613	82 816	
FLSmidth & Co A/S	153	6 203	9 795	
FNM SpA	1 461	1 017	928	
Frencken Group Ltd.	8 700	8 037	7 656	
FSE Lifestyle Services Ltd.	991	648	1 009	
Fudo Tetra Corp.	100	1 658	1 676	
Fuji Die Co., Ltd.	500	4 006	3 044	
Fukuyama Transporting Co., Ltd.	100	3 572	3 662	
Furukawa Electric Co., Ltd.	300	6 985	6 968	
Futaba Corp.	1 100	5 138	4 854	
Gecoss Corp.	1 600	13 296	12 803	
Girisim Elektrik Taahhut Ticaret Ve Sanayi AS	7	33	21	
H+H International A/S	7	355	111	
Harbin Electric Co., Ltd.	2 000	1 275	1 064	
Hirakawa Hewtech Corp.	200	2 970	2 906	
Hoegh Autoliners ASA	619	4 466	4 652	
Hokuriku Electrical Construction Co., Ltd.	200	1 497	1 725	
Ichinen Holdings Co., Ltd.	200	2 519	2 481	
International Consolidated Airlines Group SA	455	1 228	1 239	
International Container Terminal Services Inc.	160	571	782	
Investment AB Latour	8	360	210	
Inwido AB	8	72	96	
Itoki Corp.	300	2 681	2 736	
Iwaki Co., Ltd.	200	2 580	2 549	
Japan Pulp & Paper Co., Ltd.	100	4 782	4 449	
Japan Transcity Corp.	400	2 050	2 270	
Jardine Cycle & Carriage Ltd.	400	13 825	13 610	
JDC Corp.	900	5 513	4 713	
JK Holdings Co., Ltd.	300	3 054	2 689	
Kanaden Corp.	300	3 691	3 557	
KAWADA TECHNOLOGIES Inc.	200	7 784	10 602	
Keihin Co., Ltd.	200	3 270	3 318	
Keikyu Corp.	200	2 550	2 329	
Kelsian Group Ltd.	1 062	6 744	6 791	
Keppel Corp. Ltd.	1 000	6 459	6 561	
Kimura Unity Co., Ltd.	100	1 128	1 167	
Kitano Construction Corp.	100	2 764	2 783	
Kitz Corp.	500	4 678	4 967	
Komatsu Wall Industry Co., Ltd.	200	4 935	4 907	
Komori Corp.	100	1 003	860	
Kondotec Inc.	100	1 049	1 099	
Konecranes Oyj	764	34 124	40 644	
Kongsberg Gruppen ASA	608	33 953	36 661	
KPP Group Holdings Co., Ltd.	1 000	7 593	5 804	
KRS Corp.	500	4 415	4 349	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kyodo Printing Co., Ltd.	300	8 420	8 693	
Luxfer Holdings PLC	278	5 779	5 235	
Maewawa Kyuso Industries Co., Ltd.	900	9 396	9 179	
Marcopolo SA	11 900	14 755	17 007	
Matsui Construction Co., Ltd.	500	2 937	3 172	
Meiji Electric Industries Co., Ltd.	300	3 441	3 941	
Meisei Industrial Co., Ltd.	200	1 590	1 804	
Mie Kotsu Group Holdings Inc.	1 700	9 582	8 902	
Mirai Industry Co., Ltd.	300	6 426	7 580	
Mitani Sangyo Co., Ltd.	2 400	7 380	7 031	
MPC Container Ships ASA	27 093	61 955	61 270	
Munters Group AB	491	5 574	7 356	
NAC Co., Ltd.	400	3 657	3 519	
Naigai Trans Line Ltd.	100	2 344	2 318	
Nakano Corp.	500	2 053	1 781	
NEL ASA	1 735	2 769	2 698	
Nibe Industrier AB	399	6 145	5 005	
Nice Corp.	400	5 415	5 489	
Nichiden Corp.	300	5 992	6 586	
Nichireki Co., Ltd.	200	3 097	3 362	
Nihon M&A Center Holdings Inc.	300	2 913	3 017	
Nilfisk Holding A/S	251	6 724	6 112	
Nippon Concept Corp.	100	1 582	1 618	
Nippon Sharyo Ltd.	300	5 856	5 521	
Nippon Sheet Glass Co., Ltd.	100	679	615	
Nitto Kogyo Corp.	1 000	26 838	32 547	
Nitto Seiko Co., Ltd.	300	1 752	1 601	
Nittoc Construction Co., Ltd.	400	3 993	3 772	
NKT A/S	686	44 489	55 038	
NKT A/S, droits	686	-	4 655	
Nordex SE	97	1 234	1 558	
Noritsu Koki Co., Ltd.	100	2 284	2 124	
Norwegian Air Shuttle ASA	1 841	2 775	2 342	
NRW Holdings Ltd.	260	573	579	
Ochi Holdings Co., Ltd.	1 500	18 579	17 729	
Odawara Engineering Co., Ltd.	200	3 655	3 699	
Oiles Corp.	100	1 745	1 825	
Okabe Co., Ltd.	700	5 237	4 704	
Penta-Ocean Construction Co., Ltd.	600	3 867	4 241	
Per Aarsleff Holding A/S, cat. B	220	12 925	14 311	
Perak Transit Bhd	1 100	361	340	
Pfeiffer Vacuum Technology AG	209	47 576	44 957	
PIE Industrial BHD	400	419	332	
Piraeus Port Authority SA	80	2 218	2 396	
Pronexus Inc.	500	5 092	4 573	
Quick Co., Ltd.	100	1 825	2 129	
Raiznext Corp.	200	2 970	2 708	
Reece Ltd.	133	2 139	2 175	
Rejlers AB	255	5 469	4 514	
Ryanair Holdings PLC	727	90 174	106 397	
Sakai Heavy Industries Ltd.	100	4 584	4 925	
Salcef Group SpA	110	3 488	3 652	
Sanix Inc.	800	2 614	2 578	
Sanko Gosei Ltd.	400	2 382	2 362	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Sanko Metal Industrial Co., Ltd.	200	7 936	8 084	
Sankyo Tateyama Inc.	200	1 352	1 329	
Sansei Technologies Inc.	500	6 091	6 454	
Sansha Electric Manufacturing Co., Ltd.	300	3 189	3 950	
Sanyo Denki Co., Ltd.	100	6 924	7 095	
Sanyo Trading Co., Ltd.	800	10 610	10 283	
Sato Shoji Corp.	300	4 104	3 983	
Seika Corp.	500	9 358	9 013	
Seiko Electric Co., Ltd.	800	7 686	7 851	
Sensata Technologies Holding PLC	118	7 522	7 025	
Shikun & Binui Ltd.	6	28	17	
Shin Nippon Air Technologies Co., Ltd.	200	4 106	4 193	
Shinwa Co., Ltd.	100	2 952	2 147	
Sinfonia Technology Co., Ltd.	300	4 696	4 713	
Singapore Airlines Ltd.	15 400	90 759	107 661	
Singapore Technologies Engineering Ltd.	4 700	16 676	16 911	
Skellerup Holdings Ltd.	1 209	5 166	4 499	
SKF AB	1	22	23	
Soda Nikka Co., Ltd.	500	4 355	3 763	
Solar A/S	3	378	294	
Space Co., Ltd.	500	4 949	4 738	
SRG Global Ltd.	5 172	3 246	3 417	
Stolt-Nielsen Ltd.	100	3 354	3 372	
Sugimoto & Co., Ltd.	200	3 960	3 995	
SWCC Corp.	600	10 349	10 492	
Systemair AB	160	798	1 541	
Taikisha Ltd.	200	7 348	7 507	
Takamiya Co., Ltd.	200	881	980	
Takaoka Toko Co., Ltd.	400	7 889	7 851	
Takashima & Co., Ltd.	300	10 123	9 572	
Technoflex Corp.	400	4 250	3 970	
Tekken Corp.	100	1 865	1 885	
Tobishima Corp.	200	2 166	2 320	
Tokyo Energy & Systems Inc.	300	2 756	2 675	
Toli Corp.	800	2 322	2 483	
Tomoe Corp.	100	443	450	
Torishima Pump Manufacturing Co., Ltd.	300	4 759	5 210	
Toyo Engineering Corp.	200	2 321	1 077	
Toyo Machinery & Metal Co., Ltd.	1 000	6 128	6 180	
Trusco Nakayama Corp.	500	10 958	10 409	
Tsukishima Holdings Co., Ltd.	100	1 104	1 105	
Tsurumi Manufacturing Co., Ltd.	300	6 558	7 141	
Valid Solucoes e Servicos de Seguranca em Meios de	1 400	5 036	5 626	
Veidekke ASA	106	1 548	1 506	
Ventia Services Group Pty Ltd.	6 298	14 359	16 809	
Wakita & Co., Ltd.	1 400	17 160	16 573	
Wallenius Wilhelmsen ASA	1 588	11 301	14 583	
WDB Holdings Co., Ltd.	100	2 102	1 943	
Wilh Wilhelmsen Holding ASA	172	5 804	5 980	
Will Group Inc.	200	2 697	2 016	
Yahagi Construction Co., Ltd.	100	836	1 133	
YAMABIKO Corp.	200	2 624	2 851	
YAMADA Consulting Group Co., Ltd.	200	3 044	2 957	
Yamaura Corp.	200	2 239	2 131	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Yasuda Logistics Corp.	100	973	898	
Yushin Precision Equipment Co., Ltd.	500	3 297	3 278	
		1 321 257	1 416 450	11,82
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 1,02 %)				
After You PCL	2	1	1	
Aisan Industry Co., Ltd.	200	1 898	2 142	
Akebono Brake Industry Co., Ltd.	2 500	3 332	3 227	
Alpen Co., Ltd.	100	2 022	1 808	
Alpha Corp.	400	4 456	4 702	
Amiyaki Tei Co., Ltd.	100	3 233	3 337	
AOKI Holdings Inc.	500	4 228	4 015	
Arcos Dorados Holdings Inc.	1 176	10 161	15 950	
Ardent Leisure Group Ltd.	2 671	1 582	1 059	
Ashimori Industry Co., Ltd.	100	1 770	1 808	
Astra Otoparts Tbk PT	7 500	1 172	1 642	
Aucnet Inc.	1 900	30 033	29 641	
Avantia Co., Ltd.	600	4 687	4 774	
Baroque Japan Ltd.	400	3 162	3 175	
Bermaz Auto Bhd	22 700	14 813	14 351	
Bijou Brigitte AG	100	6 521	7 117	
Bloomberry Resorts Corp.	2 400	358	639	
Bookoff Group Holdings Ltd.	1 200	15 286	13 524	
Bronco Billy Co., Ltd.	300	7 691	7 666	
Brunello Cucinelli SpA	4	465	465	
Bygghmax Group AB	33	353	117	
Café de Coral Holdings Ltd.	2 000	3 577	3 391	
Capri Holdings Ltd.	421	25 819	19 994	
Carnival Corp.	3 394	45 572	84 567	
Central Automotive Products Ltd.	200	5 434	5 814	
Cettire Ltd.	1 957	3 504	5 361	
China Harmony Auto Holding Ltd.	2 000	333	290	
China ZhengTong Auto Services Holdings Ltd.	4 500	438	403	
Chiyoda Co., Ltd.	100	834	816	
Clas Ohlson AB	50	881	496	
Cleanup Corp.	300	2 091	2 027	
Colowide Co., Ltd.	600	12 203	11 195	
Consortio ARA SAB de CV	3 516	1 057	1 058	
Continental AG	4	288	399	
Corona Corp.	100	956	829	
Corporate Travel Management Ltd.	137	2 301	2 159	
Crystal International Group Ltd.	4 500	1 854	1 831	
Daido Metal Co., Ltd.	900	4 121	4 046	
Dainichi Co., Ltd.	100	711	664	
Delek Automotive Systems Ltd.	141	1 926	1 426	
Despegar.com Corp.	142	1 084	1 325	
Eagle Industry Co., Ltd.	200	2 429	3 197	
EAT&HOLDINGS Co., Ltd.	100	2 302	1 986	
Edvantage Group Holdings Ltd.	4 145	1 312	1 589	
Emak SpA	947	1 562	1 425	
Ferrari NV	40	15 651	17 295	
First Juken Co., Ltd.	300	3 066	3 024	
F-Tech Inc.	300	2 399	2 549	
Fuji Corp. Ltd.	2 000	12 648	12 378	
Fujikura Composites Inc.	1 700	14 689	15 221	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Fujio Food Group Inc.	200	2 875	2 688	
FuKoKu Co., Ltd.	200	2 360	2 558	
Furukawa Battery Co., Ltd.	900	8 861	8 586	
Furyu Corp.	400	4 386	4 819	
Futaba Industrial Co., Ltd.	600	2 668	2 895	
G8 Education Ltd.	339	356	311	
Gajah Tunggal Tbk PT	98 200	7 451	7 020	
Genki Sushi Co., Ltd.	300	9 638	9 242	
Genting Singapore Ltd.	1 500	1 747	1 379	
Geo Holdings Corp.	3 600	57 600	60 215	
Geox SpA	216	373	270	
Gestamp Automocion SA	1 058	6 227	6 583	
Giordano International Ltd.	20 000	8 091	8 274	
Goodyear Lastikleri TAS	9 323	10 995	10 600	
Greens Co., Ltd.	300	3 764	3 680	
H & M Hennes & Mauritz AB	18	250	408	
Hagihara Industries Inc.	400	5 090	5 211	
Hard Off Corp. Co., Ltd.	100	1 336	1 315	
Hi-Lex Corp.	400	4 900	4 398	
H-One Co., Ltd.	600	4 196	4 098	
Ichikoh Industries Ltd.	400	2 032	1 992	
IJTT Co., Ltd.	100	607	535	
Imasen Electric Industrial	1 100	6 986	6 204	
IMMSI SpA	700	359	496	
Indomobil Sukses Internasional Tbk PT	8 900	1 450	1 697	
International Housewares Retail Co., Ltd.	2 000	956	986	
JANOME Corp.	700	3 930	3 948	
Joban Kosan Co., Ltd.	200	2 586	2 261	
Johnson Electric Holdings Ltd.	1 500	2 237	2 538	
JVCKenwood Corp.	300	1 068	1 357	
KeyHolder Inc.	200	2 161	1 857	
Komatsu Materie Co., Ltd.	100	1 107	618	
Konaka Co., Ltd.	300	1 024	1 060	
Kura Sushi Inc.	400	13 266	11 169	
Lastminute.com NV	36	1 208	1 507	
Lottery Corp. Ltd.	2 712	12 695	12 254	
Map Aktif Adiperkasa PT	1 400	703	840	
Matsuoka Corp.	200	2 102	2 150	
Matsuyafoods Holdings Co., Ltd.	300	12 814	11 330	
MBM Resources BHD	1 500	1 681	1 501	
Meiko Network Japan Co., Ltd.	100	655	597	
Meiwa Estate Co., Ltd.	1 900	16 610	17 882	
Mikuni Corp.	1 700	5 947	7 019	
Mitchells & Butlers PLC	29	135	100	
Mitra Pinasthika Mustika Tbk PT	164 800	15 709	15 491	
Morito Co., Ltd.	600	6 406	5 817	
MOS Food Services Inc.	500	15 750	14 786	
MrMax Holdings Ltd.	200	1 220	1 155	
NextEd Group Ltd.	4 746	6 685	6 312	
Nichirin Co., Ltd.	100	2 373	2 552	
Nihon Tokushu Toryo Co., Ltd.	600	5 789	5 872	
Nissan Motor Co., Ltd.	2 700	13 805	14 540	
Nissan Tokyo Sales Holdings Co., Ltd.	1 500	4 814	5 246	
Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	827	16 197	23 823	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
OVS SpA	3 246	9 393	11 903	
Padini Holdings Bhd	6 000	6 915	6 600	
Pirelli & C SpA	319	2 297	2 083	
Playtech PLC	114	843	1 132	
PRADA SpA	300	2 848	2 659	
Premium Water Holdings Inc.	200	4 890	4 739	
Propel Funeral Partners Ltd.	526	2 096	1 941	
Rakuten Group Inc.	2 000	8 937	9 137	
Rhythm Co., Ltd.	100	1 517	1 515	
Right On Co., Ltd.	400	2 320	2 161	
Roland Corp.	100	3 956	3 781	
Sanden Corp.	200	452	363	
Sankyo Seiko Co., Ltd.	100	557	515	
Sanlorenzo SpA	7	348	398	
Sanoh Industrial Co., Ltd.	500	4 005	3 928	
Sanyo Shokai Ltd.	100	1 656	1 751	
Seiko Group Corp.	100	2 884	2 379	
Sekisui House Ltd.	200	5 182	5 320	
Selamat Sempurna Tbk PT	41 400	6 519	6 394	
Shidax Corp.	900	6 531	5 727	
Shikibo Ltd.	600	6 395	5 537	
Shimajima Co., Ltd.	700	7 183	7 133	
SISB PCL	8 000	9 301	11 271	
SKYCITY Entertainment Group Ltd.	15 267	30 547	28 219	
SNT Corp.	1 400	3 241	3 230	
Sogefi SpA	1 559	2 641	2 746	
Sprix Inc.	200	1 793	1 461	
SRS Holdings Co., Ltd.	800	7 994	6 951	
SSI Group Inc.	46 000	2 833	3 308	
Stella International Holdings Ltd.	10 500	14 783	13 120	
Step Co., Ltd.	500	9 349	8 258	
Suncall Corp.	100	580	482	
Super Retail Group Ltd.	784	8 946	7 893	
T RAD Co., Ltd.	400	6 760	6 753	
Tachikawa Corp.	100	1 252	1 166	
Taiho Kogyo Co., Ltd.	300	2 352	2 560	
Take And Give Needs Co., Ltd.	300	4 057	3 200	
TBK Co., Ltd.	800	2 989	2 930	
Texwinca Holdings Ltd.	4 000	965	804	
T-Gaia Corp.	300	5 229	4 757	
Toa Corp. (Hyogo)	500	4 256	4 221	
Topre Corp.	100	1 288	1 452	
Treasure Factory Co., Ltd.	500	8 607	7 686	
TSI Holdings Co., Ltd.	200	1 254	1 441	
Tsutsumi Jewelry Co., Ltd.	300	6 766	6 454	
Union Auction PCL	16 600	6 880	5 855	
Unipres Corp.	1 000	9 376	10 583	
United Arrows Ltd.	100	2 347	2 275	
Unitika Ltd.	2 600	5 612	5 570	
Van de Velde NV	275	14 918	13 101	
Vulcabras Azaleia SA	1 200	4 834	5 695	
Webjet Ltd.	6 993	44 635	42 563	
Xebio Holdings Co., Ltd.	2 100	21 641	20 898	
Xinhua Winshare Publishing and Media Co., Ltd.	1 000	927	968	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Yachiyo Industry Co., Ltd.	600	3 980	6 416	
Yakiniku Sakai Holdings Inc.	500	339	325	
Yatas Yatak ve Yorgan Sanayi ve Ticaret AS	914	2 075	1 470	
Yossix Holdings Co., Ltd.	300	6 646	6 803	
		964 214	999 938	8,35
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 0,34 %)				
111 Inc.	509	1 979	1 657	
A2 Milk Co., Ltd.	1 661	8 657	7 204	
Adecoagro SA	905	10 054	11 209	
Aeon Co M Bhd	21 300	8 104	7 911	
Belc Co., Ltd.	100	5 368	5 868	
BRF SA, CAAE	837	1 595	2 104	
DingDong Cayman Ltd.	52	368	213	
First Resources Ltd.	10 300	15 124	13 999	
GrainCorp Ltd.	113	826	779	
Grupo Herdez SAB de CV	1 100	4 052	3 771	
Hanjaya Mandala Sampoerna Tbk PT	4 100	449	342	
Herbalife Ltd.	696	14 948	12 194	
Lucas Bols NV	100	1 395	1 509	
Mayora Indah Tbk PT	11 300	2 736	2 603	
Metcash Ltd.	3 513	11 910	11 635	
Nichimo Co., Ltd.	100	3 249	3 644	
Nihon Chouzai Co., Ltd.	500	5 874	5 388	
Nitto Fuji Flour Milling Co., Ltd.	100	4 704	4 285	
Okuwa Co., Ltd.	200	1 699	1 531	
Ontex Group NV	1 843	18 413	18 305	
Orkla ASA	2 709	26 417	25 797	
Power Root Bhd	3 300	2 023	1 937	
Ridley Corp. Ltd.	9 221	18 854	16 244	
Rock Field Co., Ltd.	300	4 489	4 098	
Sappe PCL	9 500	22 261	28 808	
Scandinavian Tobacco Group A/S	500	13 291	11 003	
Sheng Siong Group Ltd.	6 300	11 365	10 102	
ST Corp.	400	5 752	5 522	
Transaction Co., Ltd.	100	1 460	1 749	
Uni-President China Holdings Ltd.	14 000	20 312	15 602	
Valor Holdings Co., Ltd.	200	3 779	3 653	
Weilong Delicious Global Holdings Ltd.	70	131	93	
YAKUODO Holdings Co., Ltd.	200	5 034	4 642	
Yamaya Corp.	200	5 118	4 979	
		261 790	250 380	2,09
Soins de santé (31 décembre 2022 : 1,11 %)				
Affimed NV	59	353	47	
Alkermes PLC	406	14 062	16 815	
Ambu A/S	1 234	23 367	26 713	
Arjo AB	44	588	211	
ASKA Pharmaceutical Holdings Co., Ltd..	100	1 240	1 319	
Austar Lifesciences Ltd	2 000	461	659	
Basilea Pharmaceutica AG	100	7 424	6 249	
BoneSupport Holding AB	1 441	14 860	22 526	
Bumrungrad Hospital PCL	1 000	9 396	8 435	
Capitol Health Ltd.	3 655	877	869	
Carna Biosciences Inc.	100	761	656	
Daiken Medical Co., Ltd.	600	2 943	2 878	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Daito Pharmaceutical Co., Ltd.	200	4 466	4 189	
Eisai Co., Ltd.	600	45 503	53 415	
El.En. SpA	325	5 907	5 156	
Elektro AB	1 024	10 885	10 455	
Estia Health Ltd.	3 505	8 755	9 138	
FINDEX Inc.	500	3 438	2 957	
France Bed Holdings Co., Ltd.	300	2 742	3 172	
Fuji Pharma Co., Ltd.	200	2 128	2 129	
Grifols SA, CAAE	3 475	33 000	42 120	
HEALIOS KK	2 000	6 326	4 999	
Immutep Ltd.	10 202	2 304	2 831	
Immutep Ltd., droits	1 342	-	65	
Jazz Pharmaceuticals PLC	140	28 284	22 966	
JMS Co., Ltd.	500	2 713	2 710	
Kiniksa Pharmaceuticals Ltd.	45	835	838	
Koa Shoji Holdings Co., Ltd.	600	3 977	3 790	
Koninklijke Philips NV, NYSE	1 429	33 694	41 017	
KPJ Healthcare Bhd	27 300	9 469	8 668	
Linical Co., Ltd.	500	3 892	3 740	
LivaNova PLC	256	15 050	17 422	
Medistim ASA	100	3 579	3 446	
Modern Dental Group Ltd.	1 000	489	510	
Monash IVF Group Ltd.	790	758	797	
Neuren Pharmaceuticals Ltd.	1 343	11 407	14 491	
Nipro Corp.	300	3 076	2 800	
Novo Nordisk A/S	455	98 820	96 987	
Nykode Therapeutics ASA	100	347	324	
Odontoprev SA	1 100	3 416	3 787	
Olympus Corp.	100	2 062	2 075	
Opthea Ltd.	584	358	283	
Pharming Group NV	1 427	2 101	2 213	
PhotoCure ASA	100	1 493	577	
Praram 9 Hospital PCL	2 000	1 465	1 321	
Pro Medicus Ltd.	517	30 251	29 891	
Prothena Corp. PLC	101	7 838	9 125	
Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros SA	9 200	11 592	12 214	
Ramsay Health Care Ltd.	560	31 549	27 765	
ReproCELL Inc.	700	1 716	1 980	
Roivant Sciences Ltd.	68	652	907	
SanBio Co., Ltd.	5 600	39 825	31 377	
Seed Co., Ltd.	1 300	6 920	6 951	
Seikagaku Corp.	500	3 554	3 447	
Sigma Healthcare Ltd.	5 381	4 107	3 981	
Sisram Medical Ltd.	2 400	5 103	3 785	
Software Service Inc.	100	9 041	9 842	
Solasto Corp.	200	1 344	1 216	
Sonic Healthcare Ltd.	259	7 981	8 115	
St-Care Holding Corp.	1 200	9 003	8 558	
StemRIM Inc.	1 300	14 841	11 009	
Summerset Group Holdings Ltd.	2 512	18 496	19 529	
Telex Pharmaceuticals Ltd.	4 173	34 398	41 241	
Vital KSK Holdings Inc.	100	910	814	
Xvivo Perfusion AB	13	400	483	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ypsomed Holding AG	2	503	799	
		669 095	691 794	5,78
Services financiers (31 décembre 2022 : 1,30 %)				
ABG Sundal Collier Holding ASA	1 308	1 113	842	
AEON Credit Service M Bhd	400	1 394	1 277	
AIA Group Ltd.	1 000	14 056	13 356	
Akatsuki Corp.	1 300	4 392	4 332	
Akita Bank Ltd.	100	1 465	1 530	
Anicom Holdings Inc.	100	596	574	
AUB Group Ltd.	53	1 032	1 372	
Avanza Bank Holding AB	15	585	403	
Axis Capital Holdings Ltd.	76	5 677	5 413	
B2Holding ASA	4 061	4 210	3 330	
Bairong Inc.	500	1 082	783	
Banca Generali SpA	25	1 200	1 137	
Banca IFIS SpA	386	7 473	8 169	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	9 193	30 230	30 551	
Banco BBVA Argentina SA	3 289	17 768	26 679	
Banco BPM SpA	10 376	55 482	63 662	
Bank BTPN Syariah Tbk PT	70 500	16 264	12 880	
Bank of Iwate Ltd.	900	17 060	16 858	
Bank of Saga Ltd.	300	4 506	4 562	
Banque Cantonale Vaudoise	93	11 961	12 999	
Berner Kantonalbank AG	2	684	686	
BPER Banca	395	1 014	1 586	
Bright Smart Securities & Commodities Group Ltd.	22 000	6 083	5 981	
Cembra Money Bank AG	373	39 421	40 936	
Chiba Bank Ltd.	4 400	38 411	35 203	
Chiba Kogyo Bank Ltd.	200	741	1 141	
Concordia Financial Group Ltd.	500	2 489	2 575	
Credito Emiliano SpA	1 631	16 546	16 788	
CSU Digital SA	200	687	721	
Dah Sing Banking Group Ltd.	2 800	3 072	2 756	
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	2 000	6 741	6 612	
DoValue SpA	32	354	196	
Ehime Bank Ltd.	1 100	8 385	8 107	
Enstar Group Ltd.	45	14 017	14 543	
Entrust Inc.	300	2 497	2 582	
EQT Holdings Ltd.	934	22 475	21 324	
FinecoBank Banca Fineco SpA	129	2 336	2 293	
Fukuoka Financial Group Inc.	600	15 312	16 331	
Gjensidige Forsikring ASA	12	374	255	
Great Eastern Holdings Ltd.	300	5 179	5 180	
Helia Group Ltd.	7 033	18 827	21 434	
Hellenic Exchanges - Athens Stock Exchange SA	467	3 398	3 472	
Hokuhoku Financial Group Inc.	100	967	1 052	
Hong Leong Finance Ltd.	11 800	30 246	28 844	
Humm Group Ltd.	275	426	113	
Intesa Sanpaolo SpA	1 390	4 162	4 816	
ISX Financial EU Ltd.	92	-	-	
James River Group Holdings Ltd.	264	7 161	6 379	
Japan Post Holdings Co., Ltd.	3 700	35 670	35 111	
Keiyo Bank Ltd.	500	2 856	2 435	
Kita-Nippon Bank Ltd.	200	3 857	3 728	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kyushu Leasing Service Co., Ltd.	400	3 266	3 380	
Luzerner Kantonalbank AG	10	1 214	1 090	
Luzerner Kantonalbank AG, droits	10	-	4	
Matsui Securities Co., Ltd.	100	827	727	
Medibank Pvt Ltd.	2 637	8 275	8 176	
Mizrahi Tefahot Bank Ltd.	7	361	308	
Mortgage Service Japan Ltd.	100	756	515	
Musashino Bank Ltd.	700	13 739	13 932	
MyState Ltd.	184	594	514	
Navigator Global Investments Ltd.	886	932	1 038	
Netwealth Group Ltd.	594	7 195	7 241	
Nib holdings Ltd.	1 903	14 218	14 164	
NZX Ltd.	2 268	2 197	2 133	
OFX Group Ltd.	11 868	16 902	20 698	
Ogaki Kyoritsu Bank Ltd.	100	1 914	1 686	
Orient Corp.	400	4 141	4 131	
Pacific Current Group Ltd.	291	1 857	1 899	
Panin Financial Tbk PT	160 000	6 013	4 011	
Procrea Holdings Inc.	100	2 086	1 864	
RCE Capital Bhd	600	341	376	
Resona Holdings Inc.	3 500	22 614	22 119	
Resurs Holding AB	2 701	7 962	6 631	
San ju San Financial Group Inc.	700	10 075	10 119	
SBI Global Asset Management Co., Ltd.	700	3 353	3 281	
Shikoku Bank Ltd.	100	912	783	
Shimizu Bank Ltd.	500	6 678	6 674	
Shizuoka Financial Group Inc.	600	5 889	5 707	
SpareBank 1 Nord Norge	462	5 445	5 541	
St Galler Kantonalbank AG	2	1 468	1 435	
Steadfast Group Ltd.	3 343	16 619	17 667	
Sydbank AS	315	19 425	19 251	
Tamburi Investment Partners SpA	205	2 311	2 732	
Tochigi Bank Ltd.	1 400	3 375	3 204	
Tokyo Century Corp.	100	4 516	4 739	
TOMONY Holdings Inc.	700	2 333	2 339	
Towa Bank Ltd.	1 500	7 272	7 306	
Traders Holdings Co., Ltd.	2 400	12 667	12 480	
United Overseas Bank Ltd.	300	8 255	8 213	
Yamagata Bank Ltd.	200	1 930	1 910	
Zenkoku Hosho Co., Ltd.	100	4 725	4 576	
		726 586	738 483	6,16
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 1,17 %)				
Aichi Tokei Denki Co., Ltd.	300	4 364	4 145	
Aisan Technology Co., Ltd.	100	2 049	2 054	
Alps Alpine Co., Ltd.	700	8 670	8 056	
Amano Corp.	1 100	28 372	30 494	
Ambarella Inc.	40	4 250	4 429	
AOI Electronics Co., Ltd.	100	1 878	1 687	
Arad Ltd.	502	10 586	10 328	
Arisawa Manufacturing Co., Ltd.	200	2 506	2 032	
ASMP Ltd.	200	2 632	2 605	
Axell Corp.	300	3 043	4 510	
Bouvet ASA	1 116	9 115	8 946	
BrainPad Inc.	100	661	890	
Broadleaf Co., Ltd.	100	438	421	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Business Engineering Corp.	100	2 964	3 085	
CAC Holdings Corp.	200	3 206	3 144	
Cal-Comp Electronics Thailand PCL, CAE sans droit de vote	7 000	545	502	
Camtek Ltd.	159	5 707	7 257	
Canon Electronics Inc.	400	7 539	7 386	
CMK Corp.	300	1 382	1 527	
CyberArk Software Ltd.	151	31 073	31 236	
Daishinku Corp.	700	5 197	4 166	
Daitron Co., Ltd.	100	1 526	2 774	
Data#3 Ltd.	159	1 077	1 008	
Datalogic SpA	1 317	14 757	13 214	
Datasonic Group Bhd	47 800	6 380	6 030	
Densan System Holdings Co., Ltd.	100	3 347	3 012	
Ebase Co., Ltd.	300	2 124	2 087	
Elastic NV	116	8 823	9 842	
ESPEC Corp.	300	6 548	6 268	
FTGroup Co., Ltd.	200	1 996	1 976	
Furuno Electric Co., Ltd.	100	973	972	
GL Sciences Inc.	100	2 426	2 211	
Globetronics Technology BHD	26 500	9 520	9 466	
Gloset Co., Ltd.	1 800	6 955	6 757	
Hochiki Corp.	400	7 318	6 540	
Hokuriku Electric Industry Co., Ltd.	100	1 251	1 141	
ID Holdings Corp.	300	3 207	3 529	
Indeks Bilgisayar Sistemleri Muhendislik Sanayi ve Ticaret	21 023	23 670	19 453	
Ines Corp.	300	4 174	4 120	
I-Net Corp.	100	1 500	1 510	
Infomedia Ltd.	2 486	3 457	3 504	
Innotech Corp.	300	4 579	4 469	
Intelligent Wave Inc.	200	1 490	1 403	
Inter Action Corp.	400	5 266	5 087	
Ionos SE	7	187	132	
I-PEX Inc.	200	2 721	2 455	
ISB Corp.	100	1 450	1 533	
Kitron ASA	1 717	7 848	9 236	
Koa Corp.	100	1 781	1 645	
Kyoden Co., Ltd.	100	498	421	
Kyosan Electric Manufacturing Co., Ltd.	200	882	917	
Kyowa Electronic Instruments Co., Ltd.	700	3 661	2 320	
Lagercrantz Group AB	77	1 271	1 311	
LG Display Co., Ltd., CAAE	28	359	225	
LINK Mobility Group Holding ASA	5 879	7 055	8 205	
Maxeon Solar Technologies Ltd.	151	5 482	5 627	
Meiko Electronics Co., Ltd.	100	2 695	2 467	
Melexis NV	4	622	519	
MIMAKI Engineering Co., Ltd.	200	1 396	1 728	
Mimasu Semiconductor Industry Co., Ltd.	100	2 498	2 847	
Miroku Jyoho Service Co., Ltd.	100	1 460	1 436	
Mitachi Co., Ltd.	700	9 322	9 049	
NEOJAPAN Inc.	100	910	990	
Netbay PCL	1	1	1	
Nova Ltd.	330	36 362	49 327	
NSW Inc.	100	2 344	2 229	
Oizumi Corp.	100	582	453	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Optex Group Co., Ltd.	100	2 064	1 849	
PAX Global Technology Ltd.	1 000	1 182	1 003	
PC Partner Group Ltd.	2 000	1 892	1 459	
PCI Holdings Inc.	300	3 175	3 164	
Praemium Ltd.	14 238	9 741	8 465	
Radware Ltd.	63	2 523	1 616	
RPMGlobal Holdings Ltd.	270	355	351	
RYODEN Corp.	100	1 478	2 014	
SAES Getters SpA	261	10 521	10 682	
Sanshin Electronics Co., Ltd.	400	7 941	7 848	
Sapiens International Corp. NV, NASD	139	3 849	4 893	
SB Technology Corp.	200	4 110	4 777	
Shindengen Electric Manufacturing Co., Ltd.	200	5 971	5 960	
Shinko Shoji Co., Ltd.	300	3 231	3 224	
Solxyz Co., Ltd.	400	1 698	1 652	
Southern Cross Payments Ltd.	3 745	3 967	1 765	
Startia Holdings Inc.	300	3 657	3 831	
Sun-Wa Technos Corp.	200	2 875	4 365	
Suzuki Co., Ltd.	600	6 380	5 175	
System Information Co., Ltd.	500	3 602	3 506	
System Research Co., Ltd.	100	2 254	2 468	
Systema Corp.	1 500	4 373	4 010	
TAKEBISHI Corp.	300	4 773	4 760	
TeamViewer SE	1 134	25 620	24 082	
Technology One Ltd.	7 836	101 461	108 018	
Technoprobe SpA	765	7 953	7 996	
Tecnos Japan Inc.	400	2 358	2 498	
Teikoku Tsushin Kogyo Co., Ltd.	200	2 999	3 076	
Tobii AB	489	4 009	1 000	
Tomen Devices Corp.	100	5 318	4 614	
Tongda Group Holdings Ltd.	90 000	1 561	1 444	
Tsuzuki Denki Co., Ltd.	100	1 752	1 822	
U-blox Holding AG	23	3 830	3 337	
Uchi Technologies Bhd	16 700	16 337	16 334	
UMC Electronics Co., Ltd.	100	483	531	
UMS Holdings Ltd.	13 400	13 934	13 888	
UNITED Inc.	300	2 455	2 428	
Vaisala Oyj	100	5 758	6 085	
Venture Corp. Ltd.	800	11 733	11 506	
VINX Corp.	200	2 660	2 558	
Vista Group International Ltd.	4 871	5 822	6 831	
Wasion Holdings Ltd.	18 000	10 716	9 696	
WiseTech Global Ltd.	588	36 566	41 335	
WithSecure Oyj	1 882	3 993	3 182	
Wix.com Ltd.	173	19 070	17 911	
Xero Ltd.	724	61 942	75 843	
		789 870	815 198	6,80
Services de communication (31 décembre 2022 : 0,13 %)				
Amuse Inc.	300	5 510	4 958	
Arnoldo Mondadori Editore SpA	3 390	9 655	9 812	
Ateam Inc.	1 900	12 030	11 811	
Avex Inc.	700	10 915	9 671	
Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd.	3 335	6 395	5 382	
Broadmedia Corp.	300	4 085	3 958	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Cairo Communication SpA	511	1 294	1 219	
Carsales.com Ltd.	366	7 687	7 679	
Chorus Ltd.	1 503	10 347	10 265	
CITIC Telecom International Holdings Ltd.	11 000	6 222	5 572	
Crazy Sports Group Ltd.	12 000	545	344	
EVT Ltd.	1 074	12 179	11 106	
G5 Entertainment AB	31	1 138	758	
IMAGICA Group Inc.	500	3 118	3 108	
I-mobile Co., Ltd.	800	9 483	8 972	
Indosat Tbk PT	13 500	7 831	10 277	
Inkeverse Group Ltd.	7	2	1	
Karnov Group AB	375	2 591	2 260	
Liberty Global PLC, série C	114	3 040	2 681	
Macquarie Technology Group Ltd.	276	14 992	16 609	
Marvelous Inc.	400	2 937	2 461	
MFE-MediaForEurope NV, cat. B	175	258	177	
Nexon Co., Ltd.	200	5 597	5 030	
OCK Group Bhd	4 900	627	556	
oOh!media Ltd.	249	354	259	
Oricon Inc.	400	3 820	3 523	
Paradox Interactive AB	360	12 575	12 005	
Perion Network Ltd.	297	15 591	12 264	
Pico Far East Holdings Ltd.	40 000	9 944	9 253	
Sanoma Oyj	900	10 927	8 627	
Schibsted ASA	707	17 576	16 438	
Schibsted ASA, cat. B	43	1 078	944	
SK Telecom Co., Ltd.	2 099	57 551	54 189	
SKY Network Television Ltd.	737	1 441	1 458	
SmarTone Telecommunications Holdings Ltd.	3 500	2 888	2 860	
Spark New Zealand Ltd.	1 135	4 670	4 683	
Telenor ASA	245	3 287	3 292	
Toei Co., Ltd.	100	17 836	16 781	
Tuas Ltd.	2 070	3 444	3 811	
TX Group AG	8	1 458	1 266	
Wantedly Inc.	200	3 846	4 264	
Wowow Inc.	1 000	12 945	10 464	
Zenrin Co., Ltd.	200	1 729	1 686	
		<hr/>	<hr/>	
		321 438	302 734	2,53
Services publics (31 décembre 2022 : 1,06 %)				
ACEA SpA	92	1 826	1 591	
Cia Energetica de Minas Gerais, CAAE	118	357	411	
Energa SA	343	799	938	
Hiroshima Gas Co., Ltd.	300	1 007	1 038	
Kenon Holdings Ltd.	284	14 927	8 760	
Keppel Infrastructure Trust	41 900	20 985	20 894	
Manila Water Co Inc.	4 400	1 930	1 949	
Okinawa Electric Power Co Inc.	1 000	10 961	10 510	
Pertamina Geothermal Energy PT	1 444	113	112	
Sembcorp Industries Ltd.	7 200	37 415	40 479	
Toell Co., Ltd.	100	849	695	
YTL Corp. Bhd	2 000	536	590	
YTL Power International Bhd	2 400	635	885	
		<hr/>	<hr/>	
		92 340	88 852	0,74

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Immobilier (31 décembre 2022 : 0,27 %)				
Airport Facilities Co., Ltd.	800	4 588	4 021	
Alam Sutera Realty Tbk PT	26 700	434	424	
Bumi Serpong Damai Tbk PT	60 800	5 801	5 876	
Concentradora Fibra Danhos SA de CV	1 900	3 384	3 158	
Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV	6 000	25 893	25 706	
Garda Property Group	306	399	350	
Grandy House Corp.	500	2 926	2 660	
Intershop Holding AG	10	9 919	8 830	
IOI Properties Group Bhd	8 300	2 967	2 518	
Katitas Co., Ltd.	100	2 633	2 269	
Keppel DC REIT	15 600	32 680	32 946	
Lendlease Corp. Ltd.	681	4 516	4 649	
Lifestyle Communities Ltd.	189	2 615	2 607	
Lotus's Retail Growth Freehold And Leasehold Property Fund	800	373	382	
Mah Sing Group Bhd	6 500	1 195	1 133	
Matrix Concepts Holdings Bhd	8 100	3 417	3 238	
Mugen Estate Co., Ltd.	100	562	640	
Nisshin Group Holdings Co., Ltd.	400	2 439	1 890	
OSK Holdings Bhd	26 000	7 742	7 813	
Peet Ltd.	1 312	1 379	1 427	
Reit 1 Ltd.	5	42	29	
Rural Funds Group	436	980	678	
Sankyo Frontier Co., Ltd.	100	3 750	3 401	
Selvaag Bolig ASA	1 618	8 648	6 455	
Summarecon Agung Tbk PT	40 000	2 525	2 330	
Swire Pacific Ltd.	3 500	35 938	35 489	
Swire Properties Ltd.	3 200	11 196	10 407	
Swiss Prime Site AG	9	1 047	1 034	
TOC Co., Ltd.	300	1 920	1 730	
		181 908	174 090	1,45
Total des actions étrangères – position acheteur		6 434 903	6 573 492	54,87
Actions étrangères – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2022 : -1,05 %)				
Akastor ASA	(3 646)	(5 820)	(4 981)	
Aker BP ASA	(1 054)	(32 930)	(32 779)	
Cooper Energy Ltd.	(9 662)	(3 114)	(1 277)	
CropEnergies AG	(318)	(5 486)	(4 600)	
D'Amico International Shipping SA	(1)	(1)	(5)	
Diversified Energy Co PLC	(385)	(588)	(573)	
Eni SpA, MIL	(2 317)	(43 487)	(44 093)	
Eni SpA, NYSE	(1 505)	(57 982)	(57 335)	
Galp Energia SGPS SA	(36)	(574)	(557)	
John Wood Group PLC	(282)	(637)	(642)	
Paladin Energy Ltd.	(13 735)	(7 780)	(8 832)	
PGS ASA	(1 521)	(1 011)	(1 119)	
Reliance Industries Ltd., CIAE	(26)	(2 258)	(2 143)	
Scorpio Tankers Inc.	(5)	(325)	(312)	
Shell PLC, CAAE	(149)	(12 107)	(11 905)	
Tenaris SA	(253)	(9 475)	(10 027)	
TGS ASA	(557)	(12 071)	(10 987)	
Weatherford International PLC	(71)	(5 640)	(6 240)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
		(201 286)	(198 407)	(1,66)
Matières premières (31 décembre 2022 : -1,15 %)				
AngloGold Ashanti Ltd.	(2 027)	(60 840)	(56 568)	
BASF SE	(11)	(762)	(706)	
Bellevue Gold Ltd.	(5 451)	(6 464)	(6 098)	
BEWi ASA	(100)	(528)	(498)	
BHP Group Ltd., ASX	(73)	(3 001)	(2 893)	
BHP Group Ltd., NYSE	(219)	(18 141)	(17 292)	
Bowen Coking Coal Ltd.	(4 821)	(651)	(679)	
Buzzi SpA	(193)	(5 888)	(6 392)	
Calix Ltd.	(1 634)	(5 918)	(6 002)	
Capricorn Metals Ltd.	(110)	(409)	(390)	
Champion Iron Ltd., ASX	(89)	(485)	(477)	
Champion Iron Ltd., TSE	(400)	(2 532)	(2 132)	
Cia de Minas Buenaventura SAA	(2 284)	(22 339)	(22 214)	
Cia Siderurgica Nacional SA	(13 868)	(47 527)	(47 529)	
Core Lithium Ltd.	(23 022)	(21 298)	(18 250)	
Fortescue Metals Group Ltd.	(724)	(13 933)	(14 144)	
Gold Fields Ltd.	(473)	(9 594)	(8 656)	
Hokuetsu Corp.	(100)	(698)	(793)	
Iberpapel Gestion SA	(100)	(2 368)	(2 187)	
Israel Corp. Ltd.	(2)	(707)	(693)	
Lynas Rare Earths Ltd.	(54)	(366)	(326)	
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	(700)	(7 982)	(7 581)	
Red 5 Ltd.	(4 604)	(787)	(771)	
Sandfire Resources Ltd.	(99)	(516)	(514)	
Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	(2 200)	(92 182)	(96 034)	
Sibanye Stillwater Ltd.	(96)	(895)	(793)	
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	(628)	(59 623)	(60 347)	
SOL SpA	(29)	(678)	(1 107)	
Syrah Resources Ltd.	(1 601)	(1 283)	(1 276)	
Tata Steel Ltd.	(14)	(354)	(247)	
Tietto Minerals Ltd.	(3 352)	(1 379)	(1 379)	
Trident Royalties PLC	(428)	(376)	(328)	
UPM-Kymmene Oyj	(84)	(3 622)	(3 307)	
		(394 126)	(388 603)	(3,24)
Industries (31 décembre 2022 : -2,55 %)				
2020 Bulkiers Ltd.	(299)	(3 882)	(3 767)	
Aalberts NV	(62)	(3 798)	(3 449)	
Adecco Group AG	(1)	(73)	(43)	
AerCap Holdings NV	(7)	(489)	(588)	
Aéroports de Paris	(5)	(925)	(949)	
Allegion PLC	(38)	(5 846)	(6 035)	
ALS Ltd.	(896)	(10 657)	(8 808)	
AutoStore Holdings Ltd.	(120)	(353)	(348)	
Benefit One Inc.	(1 000)	(16 484)	(13 412)	
Clarivate PLC	(4 899)	(59 025)	(61 779)	
Daikin Industries Ltd.	(300)	(82 205)	(80 378)	
Elco Ltd.	(185)	(12 714)	(8 378)	
Enav SpA	(1 259)	(6 543)	(7 099)	
Eolus Vind AB	(15)	(368)	(131)	
Fila SpA	(50)	(484)	(567)	
Fluidra SA	(955)	(16 914)	(24 582)	
Genco Shipping & Trading Ltd.	(18)	(373)	(334)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Grafton Group PLC	(22)	(444)	(289)	
Hankyu Hanshin Holdings Inc.	(800)	(34 358)	(34 826)	
Hexagon Composites ASA	(157)	(582)	(528)	
Hirata Corp.	(100)	(6 254)	(7 819)	
Japan Airport Terminal Co., Ltd.	(200)	(13 555)	(11 902)	
Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	(900)	(30 411)	(28 995)	
Keisei Electric Railway Co., Ltd.	(200)	(9 470)	(10 906)	
Kornit Digital Ltd.	(82)	(3 109)	(3 187)	
Leonardo SpA	(629)	(9 760)	(9 439)	
Makita Corp.	(200)	(7 763)	(7 390)	
Marubeni Corp.	(2 900)	(66 602)	(64 782)	
Mitsui & Co., Ltd.	(900)	(44 545)	(44 585)	
NEL ASA, droits	(2 880)	-	-	
Odakyu Electric Railway Co., Ltd.	(500)	(10 419)	(8 814)	
OHB SE	(50)	(2 522)	(2 306)	
Prosegur Cia de Seguridad SA	(50)	(292)	(118)	
Raksul Inc.	(300)	(4 330)	(3 689)	
Sato Holdings Corp.	(100)	(2 220)	(1 783)	
Shapir Engineering and Industry Ltd.	(542)	(5 360)	(4 934)	
Shima Seiki Manufacturing Ltd.	(100)	(1 842)	(1 695)	
Tadano Ltd.	(100)	(1 034)	(1 048)	
THK Co., Ltd.	(1 900)	(58 842)	(51 228)	
Tinexta SpA	(96)	(3 051)	(2 334)	
VAT Group AG	(2)	(967)	(1 095)	
Vestas Wind Systems A/S	(497)	(18 024)	(17 486)	
Vow ASA	(73)	(344)	(117)	
		(557 233)	(541 942)	(4,52)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -1,22 %)				
AB Dynamics PLC	(11)	(347)	(348)	
Aptiv PLC	(90)	(11 816)	(12 158)	
Azorim-Investment Development & Construction Co., Ltd.	(609)	(2 831)	(2 443)	
Baby Bunting Group Ltd.	(1 214)	(2 369)	(1 470)	
BHG Group AB	(647)	(1 135)	(1 190)	
Bike24 Holding AG	(100)	(426)	(448)	
Chargeurs SA	(182)	(3 296)	(2 911)	
De' Longhi SpA	(97)	(2 501)	(2 803)	
Demae-Can Co., Ltd.	(400)	(1 637)	(1 476)	
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	(901)	(41 435)	(36 848)	
ES-Con Japan Ltd.	(300)	(2 648)	(2 263)	
Farfetch Ltd.	(1 501)	(10 871)	(11 997)	
GreenTree Hospitality Group Ltd.	(66)	(351)	(452)	
Harvey Norman Holdings Ltd.	(75)	(367)	(230)	
Harvia Oyj	(200)	(6 472)	(6 670)	
Hella GmbH & Co KGaA	(29)	(2 542)	(3 019)	
Henry Boot PLC	(100)	(373)	(353)	
IDP Education Ltd.	(946)	(19 314)	(18 415)	
Istyle Inc.	(100)	(511)	(505)	
JM AB	(114)	(5 420)	(2 007)	
Just Eat Takeaway.com NV	(113)	(3 306)	(2 290)	
KMD Brands Ltd.	(2)	(2)	(2)	
Leifheit AG	(54)	(1 069)	(1 508)	
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	(22)	(28 237)	(27 409)	
Mercari Inc.	(100)	(3 141)	(3 075)	
Minor International PCL, CAE sans droit de vote	(45)	(50)	(58)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Moncler SpA	(6)	(557)	(549)	
Moonpig Group PLC	(1 098)	(2 424)	(2 664)	
Musti Group Oyj	(51)	(1 641)	(1 317)	
Nissan Shatai Co., Ltd.	(200)	(1 667)	(1 536)	
Oriental Land Co., Ltd.	(500)	(25 588)	(25 639)	
PointsBet Holdings Ltd.	(2 478)	(2 596)	(3 907)	
Tadiran Group Ltd.	(13)	(1 607)	(1 304)	
Verkkokauppa.com Oyj	(24)	(139)	(90)	
Wesfarmers Ltd.	(1 320)	(59 656)	(57 367)	
		(248 342)	(236 721)	(1,98)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -1,06 %)				
Acomo NV	(33)	(937)	(1 043)	
Agrana Beteiligungs AG	(25)	(657)	(626)	
Ajinomoto Co Inc.	(300)	(15 935)	(15 721)	
Aker BioMarine ASA	(100)	(514)	(421)	
Anora Group Oyj	(100)	(1 064)	(710)	
Atlantic Sapphire ASA	(172)	(2 132)	(139)	
Bega Cheese Ltd.	(1 628)	(5 156)	(4 087)	
BrasilAgro - Co Brasileira de Propriedades Agricolas	(609)	(5 045)	(4 174)	
Bunge Ltd.	(127)	(15 777)	(15 856)	
Carlsberg AS	(62)	(13 044)	(13 109)	
Chubu Shiryō Co., Ltd.	(200)	(2 174)	(1 932)	
Cia Brasileira de Distribuicao	(410)	(1 569)	(2 089)	
Cia Cervecerias Unidas SA	(585)	(12 031)	(12 564)	
Coca-Cola Europacific Partners PLC	(48)	(2 915)	(4 092)	
Costa Group Holdings Ltd.	(671)	(1 683)	(1 608)	
Cranswick PLC	(92)	(4 301)	(5 024)	
Diageo PLC	(88)	(19 740)	(20 201)	
DocMorris AG	(44)	(9 411)	(2 539)	
Ebro Foods SA	(42)	(934)	(980)	
ForFarmers NV	(77)	(375)	(306)	
Grieg Seafood ASA	(342)	(3 610)	(2 834)	
HelloFresh SE	(6)	(164)	(196)	
Humble Group AB	(611)	(1 500)	(490)	
Italian Wine Brands SpA	(100)	(3 746)	(3 068)	
Japan Tobacco Inc.	(900)	(26 109)	(25 980)	
J-Oil Mills Inc.	(400)	(6 245)	(5 859)	
Kaneko Seeds Co., Ltd.	(100)	(1 704)	(1 334)	
Key Coffee Inc.	(600)	(12 167)	(11 349)	
Kobe Bussan Co., Ltd.	(1 100)	(43 346)	(37 523)	
MARR SpA	(65)	(1 141)	(1 319)	
Rohto Pharmaceutical Co., Ltd.	(300)	(6 137)	(8 902)	
Salmar ASA	(783)	(42 472)	(41 865)	
Schouw & Co A/S	(146)	(15 014)	(15 258)	
Select Harvests Ltd.	(69)	(429)	(252)	
Unilever PLC	(137)	(9 362)	(9 450)	
United Malt Grp Ltd.	(7 951)	(26 831)	(30 815)	
Yoshimura Food Holdings KK	(1 200)	(12 910)	(9 844)	
Yukiguni Maitake Co., Ltd	(500)	(4 840)	(4 463)	
		(333 121)	(318 022)	(2,65)
Soins de santé (31 décembre 2022 : -0,81 %)				
ArcticZymes Technologies ASA	(135)	(650)	(667)	
Argenx SE	(19)	(10 138)	(9 798)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
AstraZeneca PLC, CAAE	(122)	(11 952)	(11 554)	
Atrys Health SA	(123)	(1 785)	(923)	
Bavarian Nordic A/S	(426)	(16 806)	(16 023)	
Bayer AG	(293)	(23 046)	(21 433)	
BeiGene Ltd.	(1)	(254)	(236)	
BioMérieux	(6)	(881)	(833)	
Boiron SA	(50)	(3 032)	(2 830)	
Carasent ASA	(148)	(354)	(290)	
Chemometec A/S	(117)	(9 879)	(10 571)	
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	(2 900)	(113 694)	(108 483)	
Coloplast A/S	(140)	(24 149)	(23 159)	
Compugen Ltd.	(191)	(809)	(288)	
CSL Ltd.	(16)	(4 014)	(3 909)	
Demant A/S	(117)	(6 186)	(6 545)	
DiaSorin SpA	(110)	(15 635)	(15 150)	
Galapagos NV	(15)	(874)	(809)	
Galapagos NV, CAAE	(19)	(966)	(1 022)	
Genmab A/S	(115)	(60 986)	(57 526)	
GN Store Nord AS	(176)	(6 185)	(5 808)	
Hoya Corp.	(200)	(33 985)	(31 265)	
hVIVO PLC	(1 549)	(357)	(380)	
I-Mab	(681)	(3 104)	(2 694)	
JMDC Inc.	(200)	(12 945)	(10 444)	
Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA	(4)	(353)	(245)	
Legend Biotech Corp.	(561)	(52 813)	(51 244)	
Lonza Group AG	(11)	(9 479)	(8 678)	
Merus NV	(33)	(966)	(1 150)	
Molecular Partners AG	(114)	(2 464)	(914)	
Oncopeptides AB	(484)	(640)	(515)	
PolyNovo Ltd.	(812)	(2 171)	(1 105)	
ProQR Therapeutics NV	(95)	(269)	(204)	
Ryman Healthcare Ltd.	(8 802)	(42 768)	(46 952)	
Sanofi	(404)	(28 606)	(28 814)	
Scancell Holdings PLC	(1 620)	(381)	(361)	
Sysmex Corp.	(200)	(18 347)	(17 948)	
Teva Pharmaceutical Industries Ltd., CAAÉ	(902)	(9 018)	(8 988)	
UniQure NV	(171)	(4 692)	(2 593)	
Vetoquinol SA	(100)	(10 465)	(13 195)	
Xbrane Biopharma AB	(100)	(1 085)	(946)	
		(547 183)	(526 492)	(4,41)
Services financiers (31 décembre 2022 : -2,42 %)				
Aegon NV, NYSE	(807)	(3 229)	(5 414)	
Assicurazioni Generali SpA	(44)	(1 154)	(1 183)	
Baloise Holding AG	(2)	(416)	(389)	
Banco Macro SA	(469)	(7 585)	(16 378)	
Banco Santander Chile	(862)	(19 334)	(21 501)	
Banco Santander SA, CAAÉ	(11 108)	(51 143)	(54 532)	
Bancolombia SA	(2 021)	(66 146)	(71 350)	
Bank of Ireland Group PLC	(44)	(577)	(555)	
Clal Insurance Enterprises Holdings Ltd.	(197)	(4 444)	(4 045)	
Commercial International Bank Egypt SAE	(1 744)	(3 025)	(2 631)	
Commonwealth Bank of Australia	(870)	(81 038)	(76 838)	
Daiwa Securities Group Inc.	(500)	(3 302)	(3 389)	
Futu Holdings Ltd.	(73)	(3 844)	(3 839)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
GAM Holding AG	(17)	(38)	(14)	
Grupo Aval Acciones y Valores SA	(233)	(729)	(715)	
Grupo Financiero Galicia SA	(2 057)	(26 110)	(46 817)	
Grupo Supervielle SA	(588)	(1 096)	(2 420)	
Gruppo MutuiOnline SpA	(19)	(642)	(846)	
Harel Insurance Investments & Financial Services Ltd.	(170)	(2 222)	(1 748)	
HDFC Bank Ltd.	(702)	(63 327)	(64 745)	
HSBC Holdings PLC, CAAÉ	(5)	(211)	(262)	
Illimity Bank SpA	(434)	(5 246)	(3 979)	
Julius Baer Group Ltd.	(34)	(3 160)	(2 833)	
Legal & General Group PLC	(1 371)	(5 345)	(5 243)	
MA Financial Group Ltd.	(7 907)	(36 233)	(35 380)	
Migdal Insurance & Financial Holdings Ltd.	(710)	(1 011)	(1 138)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	(12 000)	(107 409)	(117 003)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc., CAAÉ	(69)	(685)	(673)	
Nexi SpA	(5 085)	(73 232)	(52 723)	
Prudential PLC	(264)	(5 127)	(4 923)	
Prudential PLC, NYSE	(491)	(18 408)	(18 400)	
Solvar Ltd.	(454)	(705)	(618)	
St James's Place PLC	(5)	(94)	(91)	
Standard Chartered PLC	(104)	(1 091)	(1 195)	
Tryg A/S	(137)	(4 006)	(3 922)	
UBS Group AG	(838)	(23 532)	(22 428)	
Westpac Banking Corp.	(3 372)	(66 095)	(63 382)	
		(690 991)	(713 542)	(5,96)
Technologies de l'information (31 décembre 2022: -1,58 %)				
Adtran Networks SE	(16)	(395)	(457)	
Advantest Corp.	(300)	(51 120)	(52 596)	
Amper SA	(2 958)	(783)	(433)	
Appier Group Inc.	(400)	(6 157)	(6 405)	
Asteria Corp.	(500)	(3 075)	(3 584)	
BrainChip Holdings Ltd.	(1 438)	(725)	(462)	
Bravura Solutions Ltd.	(196)	(373)	(81)	
Canaan Inc.	(159)	(542)	(448)	
Citizen Watch Co., Ltd.	(100)	(776)	(793)	
Cognyte Software Ltd.	(70)	(2 509)	(564)	
Crayon Group Holding ASA	(75)	(1 547)	(973)	
Digital Garage Inc.	(600)	(26 810)	(21 066)	
FUJIFILM Holdings Corp.	(200)	(15 730)	(15 639)	
Innoviz Technologies Ltd.	(193)	(638)	(725)	
Kapsch TrafficCom AG	(21)	(421)	(347)	
Keyence Corp.	(200)	(132 598)	(124 236)	
Money Forward Inc.	(1 100)	(56 529)	(57 191)	
Netcompany Group A/S	(235)	(17 271)	(12 867)	
Optim Corp.	(400)	(4 961)	(3 721)	
Pexip Holding ASA	(298)	(1 548)	(718)	
Renesas Electronics Corp.	(3 000)	(71 601)	(74 198)	
Ricoh Co., Ltd.	(200)	(2 255)	(2 238)	
Sansan Inc.	(900)	(15 228)	(13 843)	
Secunet Security Networks AG	(1)	(821)	(314)	
Shimadzu Corp.	(200)	(8 764)	(8 108)	
Shinko Electric Industries Co., Ltd.	(100)	(5 145)	(5 358)	
Sinch AB	(539)	(2 624)	(1 608)	
SMART Global Holdings Inc.	(18)	(393)	(691)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Softwareone Holding AG	(98)	(1 618)	(2 570)	
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	(84)	(11 237)	(11 217)	
Tamura Corp.	(200)	(1 362)	(1 221)	
Towa Corp.	(200)	(4 606)	(4 689)	
		(450 162)	(429 361)	(3,58)
Services de communication (31 décembre 2022: -1,38 %)				
Adevinta ASA	(1 871)	(22 106)	(16 269)	
America Movil SAB de CV	(167)	(4 786)	(4 782)	
CyberAgent Inc.	(400)	(4 160)	(3 838)	
Domain Holdings Australia Ltd.	(884)	(2 624)	(2 951)	
Future PLC	(44)	(776)	(500)	
Grupo Televisa SAB	(33)	(438)	(224)	
Gurunavi Inc.	(600)	(2 207)	(1 917)	
Herzog Inc.	(400)	(5 578)	(8 038)	
Japan Communications Inc.	(400)	(911)	(886)	
Kahoot! ASA	(1 491)	(7 644)	(5 392)	
Liberty Latin America Ltd.	(49)	(519)	(559)	
Métropole Télévision SA	(160)	(3 091)	(2 998)	
MFE-MediaForEurope NV, cat. A	(5 558)	(2 784)	(4 100)	
MFE-MediaForEurope NV, cat. B	(308)	(369)	(312)	
Mobile TeleSystems PJSC	(911)	(8 419)	-	
MTI Ltd.	(100)	(504)	(547)	
Nippon BS Broadcasting Corp.	(200)	(1 830)	(1 692)	
Remedy Entertainment Oyj	(27)	(644)	(963)	
Southern Cross Media Group Ltd.	(1 688)	(1 529)	(1 286)	
Telecom Argentina SA	(1 965)	(13 201)	(15 835)	
Vector Inc.	(300)	(4 588)	(3 678)	
Vodafone Group PLC	(1 046)	(16 465)	(13 080)	
Z Holdings Corp.	(800)	(2 977)	(2 537)	
		(108 150)	(92 384)	(0,77)
Services publics (31 décembre 2022 : -0,38 %)				
Ascopiave SpA	(796)	(2 802)	(2 706)	
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC	(633)	(23 964)	(19 634)	
Elmera Group ASA	(125)	(363)	(330)	
Empresa Distribuidora Y Comercializadora Norte	(299)	(3 315)	(6 101)	
Fortum Oyj	(713)	(14 374)	(12 625)	
Genesis Energy Ltd.	(810)	(1 846)	(1 793)	
Greenvolt-Energias Renovaveis SA	(1 076)	(10 135)	(9 499)	
Grenergy Renovables SA	(9)	(377)	(366)	
Hera SpA	(172)	(835)	(676)	
Italgas SpA	(1 134)	(8 892)	(8 881)	
Meridian Energy Ltd.	(1 923)	(8 390)	(8 730)	
Naturgy Energy Group SA	(23)	(769)	(905)	
OPC Energy Ltd.	(100)	(848)	(871)	
Orsted AS	(241)	(27 458)	(30 129)	
RWE AG	(78)	(4 746)	(4 490)	
Scatec ASA	(407)	(7 792)	(3 534)	
Solaria Energia y Medio Ambiente SA	(32)	(671)	(649)	
		(117 577)	(111 919)	(0,93)
Immobilier (31 décembre 2022 : -1,11 %)				
Abacus Property Group	(14 931)	(37 759)	(35 377)	
Abacus Property Group, droits, éch. le 27 juillet 2023	(2 666)	-	(3 006)	
Africa Israel Residences Ltd.	(109)	(5 976)	(6 926)	
Alony Hetz Properties & Investments Ltd.	(56)	(785)	(576)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Altisource Portfolio Solutions SA	(29)	(473)	(219)	
Amot Investments Ltd.	(74)	(737)	(513)	
Ananda Development PCL, CAÉ sans droit de vote	(31 600)	(1 789)	(1 038)	
Arena REIT	(1 533)	(5 209)	(5 077)	
Atenor	(16)	(1 374)	(605)	
Atrium Ljungberg AB	(31)	(560)	(709)	
Big Shopping Centers Ltd.	(12)	(1 433)	(1 426)	
Blue Square Real Estate Ltd.	(100)	(7 712)	(7 656)	
BWP Trust	(1 844)	(6 642)	(5 896)	
Cedar Woods Properties Ltd.	(473)	(2 019)	(2 096)	
Centuria Industrial REIT	(14 384)	(44 736)	(39 276)	
Charter Hall Group	(6 636)	(68 293)	(62 601)	
Charter Hall Long Wale REIT	(533)	(2 059)	(1 883)	
Charter Hall Social Infrastructure REIT	(2 413)	(7 575)	(6 249)	
Cresud SACIF y A	(88)	(747)	(900)	
Daiwa House Industry Co., Ltd.	(100)	(3 541)	(3 472)	
Daiwa Securities Living Investments Corp.	(1)	(1 215)	(1 047)	
Deutsche Wohnen SE	(113)	(6 022)	(3 445)	
Dexus Industria REIT	(1 084)	(2 651)	(2 463)	
Empiric Student Property PLC	(2 509)	(3 657)	(3 554)	
Entra ASA	(120)	(1 853)	(1 442)	
ESR-LOGOS REIT, droits	(297)	-	(3)	
Fukuoka REIT Corp.	(6)	(9 973)	(9 113)	
Golderest Co., Ltd.	(100)	(1 694)	(1 642)	
Growthpoint Properties Australia Ltd.	(478)	(1 315)	(1 175)	
Hamborner REIT AG	(125)	(1 413)	(1 153)	
Immobil SA	(83)	(8 723)	(4 170)	
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp.	(3)	(4 476)	(4 164)	
Ingenia Communities Group	(2 399)	(9 394)	(8 410)	
Invincible Investment Corp.	(2)	(1 093)	(1 047)	
IRSA Inversiones y Representaciones SA, bons de souscription, éch. le 5 mars 2026	(290)	-	(161)	
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	(100)	(2 681)	(2 619)	
Miyakoshi Holdings Inc.	(400)	(3 408)	(3 116)	
Mobimo Holding AG	(5)	(1 610)	(1 782)	
National Storage REIT	(164)	(359)	(339)	
Pandox AB	(766)	(10 997)	(11 786)	
Peach Property Group AG	(48)	(858)	(943)	
Picton Property Income Ltd.	(332)	(418)	(391)	
Platzer Fastigheter Holding AB	(100)	(1 031)	(979)	
Precinct Properties Group	(649)	(681)	(679)	
Property & Building Corp. Ltd.	(100)	(6 231)	(5 720)	
Stendorren Fastigheter AB	(115)	(2 856)	(2 291)	
Stride Property Group	(1 684)	(1 879)	(1 911)	
Takara Leben Real Estate Investment Corp.	(2)	(2 178)	(1 769)	
Vital Healthcare Property Trust	(1 855)	(3 589)	(3 519)	
Wallenstam AB	(106)	(504)	(474)	
Wereldhave Belgium Comm VA	(50)	(3 534)	(3 349)	
YH Dimri Construction & Development Ltd.	(50)	(4 368)	(4 099)	
		<u>(300 080)</u>	<u>(274 256)</u>	(2,29)
Total des actions étrangères – position vendeur		<u>(3 948 251)</u>	<u>(3 831 649)</u>	(31,99)
Commissions de courtage intégrées (note 3)		<u>(7 324)</u>		

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Total des placements		2 345 317	2 573 524	21,49
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			191 404	1,60
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			(19 754)	(0,16)
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			583 640	4,87
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			(372 540)	(3,11)
Autres actifs, moins les passifs			9 022 379	75,31
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			11 978 653	100,00

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Contrats de change à terme (Annexe 1) (non audité)

Au 30 juin 2023

Contrepartie*	Code de devise	Montant vendu	Code de devise	Montant acheté	Date d'échéance	Plus-value
						(moins-value) latente
						\$
Banque Royale du Canada	AUD	(365 000)	USD	247 023	20 septembre 2023	4 564
Banque Royale du Canada	CNY	(603 000)	USD	84 928	20 septembre 2023	1 458
Banque Royale du Canada	HKD	(927 000)	USD	118 650	20 septembre 2023	171
Banque Royale du Canada	ILS	(576 000)	USD	160 332	20 septembre 2023	6 041
Banque Royale du Canada	JPY	(193 509 000)	USD	1 407 311	20 septembre 2023	66 453
Banque Royale du Canada	JPY	(17 944 000)	USD	128 622	20 septembre 2023	3 711
Banque Royale du Canada	JPY	(22 555 000)	USD	158 985	20 septembre 2023	1 155
Banque Royale du Canada	SEK	(968 000)	USD	91 399	20 septembre 2023	1 858
Banque Royale du Canada	SEK	(1 368 000)	USD	127 158	20 septembre 2023	2
Banque Royale du Canada	SGD	(262 000)	USD	195 689	20 septembre 2023	1 934
Banque Royale du Canada	SGD	(78 000)	USD	57 843	20 septembre 2023	33
Banque Royale du Canada	USD	(7 895 717)	CAD	10 538 000	20 septembre 2023	102 286
Banque Royale du Canada	USD	(54 087)	CHF	48 000	20 septembre 2023	52
Banque Royale du Canada	ZAR	(1 526 000)	USD	81 389	20 septembre 2023	1 686
						191 404
Banque Royale du Canada	CAD	(23 886)	USD	18 051	5 juillet 2023	(2)
Banque Royale du Canada	CHF	(113 000)	USD	125 552	20 septembre 2023	(2 444)
Banque Royale du Canada	DKK	(1 310 000)	USD	190 113	20 septembre 2023	(3 695)
Banque Royale du Canada	EUR	(263 000)	USD	284 185	20 septembre 2023	(5 160)
Banque Royale du Canada	NOK	(3 134 000)	USD	290 559	20 septembre 2023	(3 675)
Banque Royale du Canada	NZD	(220 000)	USD	134 453	20 septembre 2023	(371)
Banque Royale du Canada	USD	(58 212)	AUD	87 000	20 septembre 2023	(217)
Banque Royale du Canada	USD	(255 798)	CAD	337 000	20 septembre 2023	(1 037)
Banque Royale du Canada	USD	(230 861)	GBP	180 000	20 septembre 2023	(2 576)
Banque Royale du Canada	USD	(91 534)	SEK	980 000	20 septembre 2023	(577)
						(19 754)
						171 650

* Toutes les contreparties ont une notation de AA ou mieux.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
Contreparties : La Banque de Nouvelle-Écosse, notation AA				
Swaps d'actions – position acheteur				
Dollar australien – taux de swap des acceptations bancaires (BBSW) à 1 mois				
5 340	31 juill. 2023	Firefinch Ltd, swap sur rendement total	941	114
4 171	31 juill. 2023	Ten Sixty Four Ltd, swap sur rendement total	2 094	(7)
				<u>107</u>
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
176	31 juill. 2023	4Imprint Group Plc, swap sur rendement total	14 197	508
181	31 juill. 2023	888 Holdings Plc, swap sur rendement total	298	85
164	31 juill. 2023	Aj Bell Plc, swap sur rendement total	886	2
4 935	31 juill. 2023	Alfa Financial Software Hold, swap sur rendement total	16 189	2 321
489	31 juill. 2023	Ashmore Group Plc, swap sur rendement total	1 711	(138)
61	31 juill. 2023	Asos Plc, swap sur rendement total	393	36
3 427	31 juill. 2023	Aston Martin Lagonda Global, swap sur rendement total	20 467	2 708
927	31 juill. 2023	Auto Trader Group Plc, swap sur rendement total	9 519	(347)
7 081	31 juill. 2023	Babcock Intl Group Plc, swap sur rendement total	33 665	(3 183)
699	31 juill. 2023	Bakkavor Group Plc, swap sur rendement total	1 117	55
1 492	31 juill. 2023	Bank Of Cyprus Holdings Plc, swap sur rendement total	6 589	1 002
231	31 juill. 2023	Bank Of Georgia Group Plc, swap sur rendement total	12 043	285
100	31 juill. 2023	Bellway Plc, swap sur rendement total	3 420	(419)
327	31 juill. 2023	Bodycote Plc, swap sur rendement total	3 526	4
1 411	31 juill. 2023	Boku Inc, swap sur rendement total	3 240	(155)
918	31 juill. 2023	Braemar Shipping Services Pl, swap sur rendement total	3 598	(811)
100	31 juill. 2023	Breedon Group Plc, swap sur rendement total	548	(26)
100	31 juill. 2023	Brooks Macdonald Group Plc, swap sur rendement total	3 634	470
2 254	31 juill. 2023	Brown (N) Group Plc, swap sur rendement total	885	(180)
582	31 juill. 2023	Bt Group Plc, swap sur rendement total	1 198	(11)
16 938	31 juill. 2023	Capita Plc, swap sur rendement total	7 819	(1 715)
4 447	31 juill. 2023	Card Factory Plc, swap sur rendement total	6 733	194
587	31 juill. 2023	Centamin Plc, swap sur rendement total	900	(91)
620	31 juill. 2023	Central Asia Metals Plc, swap sur rendement total	1 880	(64)
1 858	31 juill. 2023	Chemring Group Plc, swap sur rendement total	8 846	820
276	31 juill. 2023	Convatec Group Plc, swap sur rendement total	953	1
3 443	31 juill. 2023	Currys Plc, swap sur rendement total	3 032	98
85	31 juill. 2023	Cvs Group Plc, swap sur rendement total	2 830	(178)
560	31 juill. 2023	Darktrace Plc, swap sur rendement total	2 904	218
139	31 juill. 2023	Diploma Plc, swap sur rendement total	6 978	(153)
170	31 juill. 2023	Discoverie Group Plc, swap sur rendement total	2 425	126
1 203	31 juill. 2023	Easyjet Plc, swap sur rendement total	9 767	(19)
325	31 juill. 2023	Eckoh Plc, swap sur rendement total	205	13
248	31 juill. 2023	Equals Group Plc, swap sur rendement total	388	(22)
9	31 juill. 2023	Ferguson Plc, swap sur rendement total	1 888	107
654	31 juill. 2023	Finsbury Food Group Plc, swap sur rendement total	1 029	13
1 923	31 juill. 2023	Firstgroup Plc, swap sur rendement total	4 720	580
846	31 juill. 2023	Foxtons Group Plc, swap sur rendement total	537	(2)
909	31 juill. 2023	Frontier Developments Plc, swap sur rendement total	9 022	782
1 048	31 juill. 2023	Galliford Try Plc, swap sur rendement total	3 431	242
175	31 juill. 2023	Genel Energy Plc, swap sur rendement total	304	(25)
431	31 juill. 2023	Genus Plc, swap sur rendement total	15 705	(1 278)
204	31 juill. 2023	Greggs Plc, swap sur rendement total	8 765	(450)
632	31 juill. 2023	H&T Group Plc, swap sur rendement total	4 625	229
541	31 juill. 2023	Halfords Group Plc, swap sur rendement total	1 962	100
24 137	31 juill. 2023	Hammerson Plc, swap sur rendement total	10 111	5
4 367	31 juill. 2023	Hargreaves Lansdown Plc, swap sur rendement total	59 919	788
5 341	31 juill. 2023	Hays Plc, swap sur rendement total	9 183	(499)
2 251	31 juill. 2023	Hiscox Ltd, swap sur rendement total	41 315	(3 263)
339	31 juill. 2023	Hostelworld Group Plc, swap sur rendement total	724	30
1 000	31 juill. 2023	Hunting Plc, swap sur rendement total	3 355	(311)
125	31 juill. 2023	Ibstock Plc, swap sur rendement total	294	(40)
1 696	31 juill. 2023	Idox Plc, swap sur rendement total	1 929	(2)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
721	31 juill. 2023	Inchcape Plc, swap sur rendement total	9 431	142
2 186	31 juill. 2023	Informa Plc, swap sur rendement total	26 949	1 217
59	31 juill. 2023	Integrafin Holdings Plc, swap sur rendement total	235	(16)
317	31 juill. 2023	International Personal Finan, swap sur rendement total	600	6
341	31 juill. 2023	Investec Plc, swap sur rendement total	2 529	157
967	31 juill. 2023	Iomart Group Plc, swap sur rendement total	2 811	214
422	31 juill. 2023	Jupiter Fund Management, swap sur rendement total	764	(17)
337	31 juill. 2023	Kainos Group Plc, swap sur rendement total	6 985	(312)
138	31 juill. 2023	Keller Group Plc, swap sur rendement total	1 625	43
3 983	31 juill. 2023	Kenmare Resources Plc, swap sur rendement total	29 952	(75)
205	31 juill. 2023	Keywords Studios Plc, swap sur rendement total	6 242	(1 439)
6 376	31 juill. 2023	Kier Group Plc, swap sur rendement total	8 056	(291)
172	31 juill. 2023	Kin And Carta Plc, swap sur rendement total	182	2
211	31 juill. 2023	Lancashire Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 052	(158)
9	31 juill. 2023	Liontrust Asset Management, swap sur rendement total	116	(1)
370	31 juill. 2023	Lookers Plc, swap sur rendement total	744	239
123	31 juill. 2023	M&C Saatchi Plc, swap sur rendement total	318	(35)
3 023	31 juill. 2023	Man Group Plc/Jersey, swap sur rendement total	11 112	(103)
2 519	31 juill. 2023	Marks & Spencer Group Plc, swap sur rendement total	8 166	202
1 187	31 juill. 2023	Marston'S Plc, swap sur rendement total	587	(46)
2 686	31 juill. 2023	Me Group International Plc, swap sur rendement total	7 393	1 113
3 382	31 juill. 2023	Mitchells & Butlers Plc, swap sur rendement total	11 618	(67)
7 263	31 juill. 2023	Mitie Group Plc, swap sur rendement total	12 048	1 127
70	31 juill. 2023	Mj Gleeson Plc, swap sur rendement total	440	(60)
585	31 juill. 2023	Mobico Group Plc, swap sur rendement total	957	(73)
2 207	31 juill. 2023	Moneysupermarket.Com, swap sur rendement total	10 054	690
882	31 juill. 2023	Morgan Advanced Materials Pl, swap sur rendement total	4 172	(136)
179	31 juill. 2023	Morgan Sindall Group Plc, swap sur rendement total	5 511	13
130	31 juill. 2023	Natwest Group Plc, swap sur rendement total	527	15
1 455	31 juill. 2023	Ncc Group Plc, swap sur rendement total	2 367	134
4 269	31 juill. 2023	Netcall Plc, swap sur rendement total	7 325	(919)
457	31 juill. 2023	Ninety One Plc, swap sur rendement total	1 292	30
121	31 juill. 2023	Norcros Plc, swap sur rendement total	358	7
1 153	31 juill. 2023	Onesavings Bank Plc, swap sur rendement total	9 311	(230)
206	31 juill. 2023	Oxford Instruments Plc, swap sur rendement total	9 461	(159)
340	31 juill. 2023	Oxford Metrics Plc, swap sur rendement total	669	132
413	31 juill. 2023	Oxford Nanopore Technologies, swap sur rendement total	1 481	(405)
956	31 juill. 2023	Paragon Banking Group Plc, swap sur rendement total	8 540	293
1 765	31 juill. 2023	Playtech Plc, swap sur rendement total	17 519	(392)
23	31 juill. 2023	Polar Capital Holdings Plc, swap sur rendement total	200	2
2 519	31 juill. 2023	Rank Group Plc, swap sur rendement total	3 746	(375)
58	31 juill. 2023	Reach Plc, swap sur rendement total	65	(6)
39	31 juill. 2023	Redrow Plc, swap sur rendement total	289	(30)
94	31 juill. 2023	Renew Holdings Plc, swap sur rendement total	1 186	49
707	31 juill. 2023	Renishaw Plc, swap sur rendement total	46 410	(1 904)
44 174	31 juill. 2023	Rolls-Royce Holdings Plc, swap sur rendement total	112 252	4 962
61	31 juill. 2023	Rotork Plc, swap sur rendement total	313	(1)
280	31 juill. 2023	Sainsbury (J) Plc, swap sur rendement total	1 310	40
426	31 juill. 2023	Sanderson Design Group Plc, swap sur rendement total	846	(43)
433	31 juill. 2023	Schroders Plc, swap sur rendement total	3 185	(144)
1 413	31 juill. 2023	Senior Plc, swap sur rendement total	4 169	176
4 883	31 juill. 2023	Serco Group Plc, swap sur rendement total	12 790	1 009
1 660	31 juill. 2023	Severfield Plc, swap sur rendement total	1 899	137
254	31 juill. 2023	Sig Plc, swap sur rendement total	148	(23)
410	31 juill. 2023	Sirius Real Estate Ltd, swap sur rendement total	589	15
1 180	31 juill. 2023	Somero Enterprises Inc, actions ord., swap sur rendement total	5 519	(920)
11 569	31 juill. 2023	Speedy Hire Plc, swap sur rendement total	7 026	970
59	31 juill. 2023	Spire Healthcare Group Plc, swap sur rendement total	211	(11)
386	31 juill. 2023	Spirent Communications Plc, swap sur rendement total	1 062	(105)
181	31 juill. 2023	Sthree Plc, swap sur rendement total	1 040	(100)
4 014	31 juill. 2023	Taylor Wimpey Plc, swap sur rendement total	6 939	(806)
1 423	31 juill. 2023	Tbc Bank Group Plc, swap sur rendement total	59 130	3 706
630	31 juill. 2023	Team17 Group Plc, swap sur rendement total	3 815	(56)
787	31 juill. 2023	Telecom Plus Plc, swap sur rendement total	22 375	1 698
136	31 juill. 2023	Ten Entertainment Group Plc, swap sur rendement total	641	4
1 812	31 juill. 2023	Tesco Plc, swap sur rendement total	7 572	(180)
2 958	31 juill. 2023	Trustpilot Group Plc, swap sur rendement total	3 379	(647)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
359	31 juill. 2023	Tt Electronics Plc, swap sur rendement total	952	(30)
10 640	31 juill. 2023	Tullow Oil Plc, swap sur rendement total	5 055	481
464	31 juill. 2023	Tyman Plc, swap sur rendement total	2 002	(95)
100	31 juill. 2023	Videndum Plc, swap sur rendement total	1 164	19
337	31 juill. 2023	Volex Plc, swap sur rendement total	1 607	104
434	31 juill. 2023	Volusion Group Plc, swap sur rendement total	2 761	(494)
809	31 juill. 2023	Warpaint London Plc, swap sur rendement total	3 770	353
622	31 juill. 2023	Wetherspoon (J.D.) Plc, swap sur rendement total	7 037	(612)
48	31 juill. 2023	Wincanton Plc, swap sur rendement total	203	2
50	31 juill. 2023	Wizz Air Holdings Plc, swap sur rendement total	2 301	(57)
610	31 juill. 2023	Wynnstay Group Plc, swap sur rendement total	4 849	367
217	31 juill. 2023	Xp Power Ltd, swap sur rendement total	7 250	(395)
				<u>6 342</u>
Euro – taux à court terme (€STR)				
211	31 juill. 2023	2G Energy Ag, swap sur rendement total	8 499	(116)
186	31 juill. 2023	Aedas Homes Sau, swap sur rendement total	4 833	298
36 120	31 juill. 2023	Air France-Klm, swap sur rendement total	89 846	1 848
675	31 juill. 2023	Aixtron Se, swap sur rendement total	30 296	1 882
110	31 juill. 2023	Akwel, swap sur rendement total	2 141	(98)
130	31 juill. 2023	Alma Media Corp, swap sur rendement total	1 730	75
2 908	31 juill. 2023	Alstom, swap sur rendement total	114 694	6 325
36	31 juill. 2023	Alten Sa, swap sur rendement total	7 500	(222)
58	31 juill. 2023	Amg Advanced Metallurgical, swap sur rendement total	3 976	39
83	31 juill. 2023	Andritz Ag, swap sur rendement total	6 117	90
31	31 juill. 2023	Anheuser-Busch Inbev Sa/Nv, swap sur rendement total	2 320	80
367	31 juill. 2023	Applus Services Sa, swap sur rendement total	5 227	354
30	31 juill. 2023	Argan, swap sur rendement total	2 945	(102)
12 075	31 juill. 2023	Aroundtown Sa, swap sur rendement total	18 426	797
87	31 juill. 2023	Ascencio, swap sur rendement total	5 526	(620)
80	31 juill. 2023	Asml Holding Nv, swap sur rendement total	76 572	(1 089)
127	31 juill. 2023	Aspo Oyj, swap sur rendement total	1 280	(7)
150	31 juill. 2023	Assystem, swap sur rendement total	10 264	580
23	31 juill. 2023	Atoss Software Ag, swap sur rendement total	6 890	68
56	31 juill. 2023	Axa Sa, swap sur rendement total	2 185	30
147	31 juill. 2023	Axway Software Sa, swap sur rendement total	4 414	(75)
91 585	31 juill. 2023	Banco Comercial Portugues-R, swap sur rendement total	29 035	1 710
33 506	31 juill. 2023	Banco De Sabadell Sa, swap sur rendement total	50 984	6 176
5 808	31 juill. 2023	Bankinter Sa, swap sur rendement total	47 206	2 287
476	31 juill. 2023	Barco N.V., swap sur rendement total	15 695	(997)
495	31 juill. 2023	Bawag Group Ag, swap sur rendement total	30 171	937
530	31 juill. 2023	Be Semiconductor Industries, swap sur rendement total	75 979	(3 212)
28	31 juill. 2023	Bechtle Ag, swap sur rendement total	1 468	(45)
97	31 juill. 2023	Befesa Sa, swap sur rendement total	5 076	173
1 682	31 juill. 2023	Beneteau, swap sur rendement total	37 589	(716)
238	31 juill. 2023	Bertrandt Ag, swap sur rendement total	16 836	286
117	31 juill. 2023	Bijou Brigitte Modi Access, swap sur rendement total	8 327	(801)
1 089	31 juill. 2023	Bouygues Sa, swap sur rendement total	48 359	1 078
52	31 juill. 2023	Brenntag Ag, swap sur rendement total	5 360	(119)
21 277	31 juill. 2023	Caixabank Sa, swap sur rendement total	116 325	10 751
26	31 juill. 2023	Cargotec Oyj, actions, B, swap sur rendement total	1 890	14
69	31 juill. 2023	Carrefour Sa, swap sur rendement total	1 729	96
501	31 juill. 2023	Ceconomy Ag, swap sur rendement total	1 664	94
146	31 juill. 2023	Cie Automotive Sa, swap sur rendement total	5 902	249
422	31 juill. 2023	Cliq Digital Ag, swap sur rendement total	15 170	479
176	31 juill. 2023	Coface Sa, swap sur rendement total	3 207	(93)
2 738	31 juill. 2023	Commerzbank Ag, swap sur rendement total	40 120	2 773
407	31 juill. 2023	Compagnie Des Alpes, swap sur rendement total	8 132	(315)
117	31 juill. 2023	Continental Ag, swap sur rendement total	11 672	1 124
67	31 juill. 2023	Covestro Ag, swap sur rendement total	4 602	783
24	31 juill. 2023	Covivio, swap sur rendement total	1 496	(82)
213	31 juill. 2023	Dassault Aviation Sa, swap sur rendement total	56 396	7 441
684	31 juill. 2023	Deceuninck Nv, swap sur rendement total	2 251	(164)
1 221	31 juill. 2023	Deutsche Bank Ag, actions nominatives, swap sur rendement total	16 954	208
2 097	31 juill. 2023	Deutsche Lufthansa, actions ord., swap sur rendement total	28 394	584
93	31 juill. 2023	D'Ieteren Sa/Nv, swap sur rendement total	21 737	(32)
299	31 juill. 2023	Duerr Ag, swap sur rendement total	12 794	921
17	31 juill. 2023	Eckert & Ziegler Strahlen Un, swap sur rendement total	893	(97)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
328	31 juill. 2023	Edreams Odigeo SI, swap sur rendement total	3 102	638
285	31 juill. 2023	Elecnor Sa, swap sur rendement total	5 349	423
291	31 juill. 2023	Elior Group, swap sur rendement total	1 102	(79)
21	31 juill. 2023	Elis Sa, swap sur rendement total	540	(40)
11	31 juill. 2023	Elmos Semiconductor Ag, swap sur rendement total	1 194	150
386	31 juill. 2023	Elringklinger Ag, swap sur rendement total	4 597	(81)
372	31 juill. 2023	Ence Energia Y Celulosa Sa, swap sur rendement total	1 550	(6)
319	31 juill. 2023	Energia Innovacion Y Desarro, swap sur rendement total	13 705	(36)
216	31 juill. 2023	Ercros Sa, swap sur rendement total	995	(37)
63	31 juill. 2023	Esi Group, swap sur rendement total	13 461	3 269
128	31 juill. 2023	Esker Sa, swap sur rendement total	25 612	(1 015)
11	31 juill. 2023	Eurofins Scientific, swap sur rendement total	924	11
310	31 juill. 2023	Evonik Industries Ag, swap sur rendement total	7 801	(482)
237	31 juill. 2023	Evotec Se, swap sur rendement total	7 052	117
136	31 juill. 2023	Evs Broadcast Equipment S.A., swap sur rendement total	4 202	(90)
221	31 juill. 2023	Facc Ag, swap sur rendement total	1 946	(31)
694	31 juill. 2023	Flatex Ag, swap sur rendement total	9 101	245
288	31 juill. 2023	Fomento De Construc Y Contra, swap sur rendement total	4 914	1 116
16	31 juill. 2023	Forvia, swap sur rendement total	498	15
1 004	31 juill. 2023	F-Secure Corp, swap sur rendement total	3 384	(472)
497	31 juill. 2023	Fugro Nv-Cva, swap sur rendement total	10 232	551
6	31 juill. 2023	Gesco Ag, swap sur rendement total	214	-
5 414	31 juill. 2023	Gestamp Automocion Sa, swap sur rendement total	33 687	470
445	31 juill. 2023	Global Fashion Group Sa, swap sur rendement total	391	60
11	31 juill. 2023	Grand City Properties, swap sur rendement total	114	4
265	31 juill. 2023	Grifols Sa, swap sur rendement total	4 491	332
100	31 juill. 2023	Groupe Guillin, swap sur rendement total	3 905	236
200	31 juill. 2023	Grupo Catalana Occidente Sa, swap sur rendement total	8 128	(266)
3 067	31 juill. 2023	Heidelberger Druckmaschinen, swap sur rendement total	6 336	(1 007)
180	31 juill. 2023	Infineon Technologies Ag, swap sur rendement total	9 819	484
4 074	31 juill. 2023	Intl Consolidated Airline-Di, swap sur rendement total	11 098	470
26	31 juill. 2023	Ion Beam Applications, swap sur rendement total	581	17
4	31 juill. 2023	Ipsen, swap sur rendement total	636	10
200	31 juill. 2023	Jacquet Metal Service Sa, swap sur rendement total	5 486	190
1 294	31 juill. 2023	Jeronimo Martins, swap sur rendement total	47 151	4 843
40	31 juill. 2023	K+S Ag- actions ord., swap sur rendement total	921	19
101	31 juill. 2023	Kbc Ancora, swap sur rendement total	6 107	120
132	31 juill. 2023	Kbc Group Nv, swap sur rendement total	12 181	487
155	31 juill. 2023	Kering, swap sur rendement total	113 137	1 133
204	31 juill. 2023	Kion Group Ag, swap sur rendement total	10 856	1 297
100	31 juill. 2023	Kloeckner & Co Se, swap sur rendement total	1 288	3
100	31 juill. 2023	Koenig & Bauer Ag, swap sur rendement total	2 743	228
115	31 juill. 2023	Konecranes Oyj, swap sur rendement total	6 118	286
1 289	31 juill. 2023	Koninklijke Bam Groep Nv, swap sur rendement total	3 283	(262)
2 337	31 juill. 2023	Koninklijke Philips Nv, swap sur rendement total	66 829	7 074
25	31 juill. 2023	Ksb Se & Co Kga-Vorzug, swap sur rendement total	18 335	713
17	31 juill. 2023	Lanxess Ag, swap sur rendement total	677	23
123	31 juill. 2023	Legrand Sa, swap sur rendement total	16 123	488
123	31 juill. 2023	Linea Directa Aseguradora Sa, swap sur rendement total	146	(1)
245	31 juill. 2023	Lisi, swap sur rendement total	9 302	463
192	31 juill. 2023	Lpkf Laser & Electronics, swap sur rendement total	2 321	(77)
615	31 juill. 2023	Maurel Et Prom, swap sur rendement total	3 468	194
22	31 juill. 2023	Melexis Nv, swap sur rendement total	2 855	135
718	31 juill. 2023	Melia Hotels International, swap sur rendement total	6 582	417
100	31 juill. 2023	Mensch Und Maschine Software, swap sur rendement total	7 882	595
62	31 juill. 2023	Mercedes-Benz Group Ag, swap sur rendement total	6 594	(89)
3 875	31 juill. 2023	Metso Oyj, swap sur rendement total	61 788	4 383
196	31 juill. 2023	Michelin (Cgde), swap sur rendement total	7 657	168
646	31 juill. 2023	Mlp Se, swap sur rendement total	5 596	892
11 323	31 juill. 2023	Mota Engil Sgps Sa, swap sur rendement total	36 698	5 247
9	31 juill. 2023	Nemetschek Se, swap sur rendement total	892	(33)
11	31 juill. 2023	Neopost Sa, swap sur rendement total	300	19
24	31 juill. 2023	Nexans Sa, swap sur rendement total	2 749	239
403	31 juill. 2023	Nextensa, swap sur rendement total	25 715	129
991	31 juill. 2023	Nh Hotel Group Sa, swap sur rendement total	6 302	(184)
100	31 juill. 2023	Noho Partners Oyj, swap sur rendement total	1 322	58
666	31 juill. 2023	Nordex Se, swap sur rendement total	10 696	(186)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
885	31 juill. 2023	Northern Data Ag, swap sur rendement total	28 747	4 264
100	31 juill. 2023	Nsi Nv, swap sur rendement total	2 952	66
859	31 juill. 2023	Obrascon Huarte Lain S.A., swap sur rendement total	579	7
2 280	31 juill. 2023	Ontex Group Nv, swap sur rendement total	22 646	(838)
3 183	31 juill. 2023	Origin Enterprises Plc, swap sur rendement total	15 325	(817)
4 190	31 juill. 2023	Outokumpu Oyj, swap sur rendement total	29 652	(1 460)
295	31 juill. 2023	Palfinger Ag, swap sur rendement total	11 882	(208)
1	31 juill. 2023	Pfeiffer Vacuum Technology, swap sur rendement total	215	(3)
3 659	31 juill. 2023	Pharming Group Nv, swap sur rendement total	5 673	(358)
3 492	31 juill. 2023	Pierre & Vacances, swap sur rendement total	8 137	(438)
1 265	31 juill. 2023	Postnl Nv, swap sur rendement total	2 914	260
1 944	31 juill. 2023	Pva Tepla Ag, swap sur rendement total	53 379	303
954	31 juill. 2023	Raiffeisen Bank Internationa, swap sur rendement total	19 998	1 077
639	31 juill. 2023	Red Electrica Corporacion Sa, swap sur rendement total	14 864	208
389	31 juill. 2023	Rothschild & Co, swap sur rendement total	26 142	3
330	31 juill. 2023	Rovio Entertainment Oy, swap sur rendement total	4 350	(49)
1 513	31 juill. 2023	Saf-Holland Sa, swap sur rendement total	27 959	1 967
529	31 juill. 2023	Salzgitter Ag, swap sur rendement total	25 309	(1 609)
46	31 juill. 2023	Sanoma Oyj, swap sur rendement total	441	(20)
137	31 juill. 2023	Scanfil Oyj, swap sur rendement total	1 998	64
464	31 juill. 2023	Schaeffler Ag, actions priv., swap sur rendement total	3 781	(44)
9	31 juill. 2023	Schneider Electric Se, swap sur rendement total	2 163	70
260	31 juill. 2023	Semapa-Sociedade De Investim, swap sur rendement total	4 887	(118)
100	31 juill. 2023	Sgl Carbon Se, swap sur rendement total	1 215	(10)
2 691	31 juill. 2023	Siemens Energy Ag	62 858	(22 865)
46	31 juill. 2023	Siltronic Ag, swap sur rendement total	4 649	(600)
285	31 juill. 2023	Sma Solar Technology Ag, swap sur rendement total	46 041	4 579
316	31 juill. 2023	Smep Sa, swap sur rendement total	3 640	255
90	31 juill. 2023	Société Générale Sa, swap sur rendement total	3 092	236
15	31 juill. 2023	Sopra Steria Group, swap sur rendement total	3 959	133
4 787	31 juill. 2023	Stellantis Nv, swap sur rendement total	111 126	11 036
2	31 juill. 2023	Sto Se & Co. Kga, actions priv., swap sur rendement total	443	(53)
143	31 juill. 2023	Suess Microtec Se, swap sur rendement total	5 027	(95)
100	31 juill. 2023	Sword Group, swap sur rendement total	5 919	178
21	31 juill. 2023	Talanx Ag, swap sur rendement total	1 593	45
1 103	31 juill. 2023	Teamviewer Ag, swap sur rendement total	23 424	91
94	31 juill. 2023	Thermador Groupe, swap sur rendement total	11 182	(1 310)
1 568	31 juill. 2023	Thyssenkrupp Ag, swap sur rendement total	16 226	890
873	31 juill. 2023	Tomtom, swap sur rendement total	8 973	(47)
154	31 juill. 2023	Trigano Sa, swap sur rendement total	29 191	292
1 147	31 juill. 2023	Tubacex Sa, swap sur rendement total	4 496	328
426	31 juill. 2023	Ubisoft Entertainment, swap sur rendement total	15 916	(445)
205	31 juill. 2023	Ucb Sa, swap sur rendement total	24 031	(31)
8 031	31 juill. 2023	Unicaja Banco Sa, swap sur rendement total	11 165	800
163	31 juill. 2023	United Internet Ag, actions ord., swap sur rendement total	3 036	(124)
100	31 juill. 2023	Usu Software Ag, swap sur rendement total	3 320	(254)
100	31 juill. 2023	Vaisala Oyj, actions, A, swap sur rendement total	6 085	(137)
2 345	31 juill. 2023	Valeo Sa, swap sur rendement total	66 455	3 863
1 066	31 juill. 2023	Valmet Oyj, swap sur rendement total	39 212	(2 874)
165	31 juill. 2023	Vienna Insurance Group Ag, swap sur rendement total	5 705	(76)
310	31 juill. 2023	Vitesco Technologies Group A, swap sur rendement total	33 767	6 078
818	31 juill. 2023	Voestalpine Ag, swap sur rendement total	38 852	894
616	31 juill. 2023	Volkswagen Ag, actions priv., swap sur rendement total	109 330	3 118
32	31 juill. 2023	Wacker Chemie Ag, swap sur rendement total	5 809	89
2 002	31 juill. 2023	Wartsila Oyj Abp, swap sur rendement total	29 813	(853)
1 367	31 juill. 2023	Wienerberger Ag, swap sur rendement total	55 337	2 975
1 913	31 juill. 2023	Withsecure Oyj, swap sur rendement total	3 234	(562)
25	31 juill. 2023	Worldline Sa, swap sur rendement total	1 209	32
363	31 juill. 2023	X-Fab Silicon Foundries Se, swap sur rendement total	5 199	763
70	31 juill. 2023	Zumtobel Group Ag, swap sur rendement total	747	23
				<u>84 304</u>
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
2 000	31 juill. 2023	China Evergrande New Energy, swap sur rendement total	1 081	(4)
6 500	31 juill. 2023	Shimao Property Holdings Ltd, swap sur rendement total	4 851	3 515
				<u>3 511</u>
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
33	31 juill. 2023	Absa Group Ltd, swap sur rendement total	388	21

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	31 juill. 2023	Adcock Ingram Holdings Ltd, swap sur rendement total	394	34
2 262	31 juill. 2023	Advtech Ltd, swap sur rendement total	2 915	151
2 163	31 juill. 2023	Afrimat Ltd, swap sur rendement total	9 265	1 232
1 260	31 juill. 2023	Allied Electronics Cor, actions, A, swap sur rendement total	688	76
5 372	31 juill. 2023	Arcelormittal South Africa, swap sur rendement total	1 343	30
22 751	31 juill. 2023	Arrowhead Properties Ltd-B, swap sur rendement total	4 653	(233)
1 559	31 juill. 2023	Aspen Pharmacare Holdings Lt, swap sur rendement total	20 052	1 151
864	31 juill. 2023	Barloworld Ltd, swap sur rendement total	5 174	106
442	31 juill. 2023	Bid Corp Ltd, swap sur rendement total	12 796	(271)
362	31 juill. 2023	Bidvest Group Ltd, swap sur rendement total	6 634	410
313	31 juill. 2023	Cashbuild Ltd, swap sur rendement total	3 683	92
690	31 juill. 2023	Coronation Fund Managers Ltd, swap sur rendement total	1 580	46
618	31 juill. 2023	Datatec Ltd, swap sur rendement total	1 688	19
682	31 juill. 2023	Discovery Ltd, swap sur rendement total	6 967	588
474	31 juill. 2023	Emira Property Fund Ltd, swap sur rendement total	292	2
1 475	31 juill. 2023	Firststrand Ltd, swap sur rendement total	7 077	508
2 114	31 juill. 2023	Grindrod Ltd, swap sur rendement total	1 417	70
724	31 juill. 2023	Harmony Gold Mining Co Ltd, swap sur rendement total	4 019	(683)
214	31 juill. 2023	Hosken Cons Investments Ltd, swap sur rendement total	3 362	254
245	31 juill. 2023	Hudaco Industries Ltd, swap sur rendement total	2 677	84
3 108	31 juill. 2023	Investec Property Fund Ltd, swap sur rendement total	1 618	(36)
1 834	31 juill. 2023	Jse Ltd, swap sur rendement total	11 690	(99)
1 581	31 juill. 2023	Lewis Group Ltd, swap sur rendement total	4 398	(2)
11 808	31 juill. 2023	Merafe Resources Ltd, swap sur rendement total	926	(47)
712	31 juill. 2023	Multichoice Group Ltd, swap sur rendement total	4 762	(176)
17 961	31 juill. 2023	Outsurance Group Ltd, swap sur rendement total	42 763	2 708
451	31 juill. 2023	Raubex Group Ltd, swap sur rendement total	822	44
151	31 juill. 2023	Sappi Limited, swap sur rendement total	413	(47)
2 477	31 juill. 2023	Southern Sun Ltd, swap sur rendement total	708	(77)
2 893	31 juill. 2023	Sun International Ltd, swap sur rendement total	6 949	(617)
7 317	31 juill. 2023	Super Group Ltd, swap sur rendement total	16 467	666
1 071	31 juill. 2023	Tiger Brands Ltd, swap sur rendement total	12 545	1 181
10 454	31 juill. 2023	Tsogo Sun Gaming Ltd, swap sur rendement total	9 358	363
				<u>7 548</u>
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
58	31 juill. 2023	Addlife Ab-B, swap sur rendement total	865	4
223	31 juill. 2023	Addnode Group Ab, swap sur rendement total	2 281	(999)
155	31 juill. 2023	Addtech Ab, actions, B, swap sur rendement total	4 459	223
200	31 juill. 2023	Alimak Group Ab, swap sur rendement total	2 063	167
3 405	31 juill. 2023	Alleima Ab, swap sur rendement total	20 465	1 147
25	31 juill. 2023	Alligo Ab-B, swap sur rendement total	337	(30)
2 054	31 juill. 2023	Ambea Ab, swap sur rendement total	8 827	65
200	31 juill. 2023	Aq Group Ab, swap sur rendement total	10 523	(738)
108	31 juill. 2023	Arise Ab, swap sur rendement total	591	(34)
930	31 juill. 2023	Arjo Ab, actions, B, swap sur rendement total	4 452	(377)
3 250	31 juill. 2023	Attendo Ab, swap sur rendement total	12 582	(511)
22	31 juill. 2023	Avanza Bank Holding Ab, swap sur rendement total	592	(12)
121	31 juill. 2023	Beijer Alma Ab, swap sur rendement total	3 343	(221)
52	31 juill. 2023	Beijer Ref Ab, swap sur rendement total	877	18
286	31 juill. 2023	Bergman & Beving Aktiebolag, swap sur rendement total	6 047	298
254	31 juill. 2023	Better Collective A/S, swap sur rendement total	6 939	65
96	31 juill. 2023	Biotage Ab, swap sur rendement total	1 578	(86)
26	31 juill. 2023	Boliden Ab, swap sur rendement total	992	9
333	31 juill. 2023	Bonesupport Holding Ab, swap sur rendement total	5 205	375
182	31 juill. 2023	Bufab Ab, swap sur rendement total	8 223	256
432	31 juill. 2023	Bulten Ab, swap sur rendement total	5 261	130
30	31 juill. 2023	Byggmax Group Ab, swap sur rendement total	106	(5)
973	31 juill. 2023	Calliditas Therapeutics-B, swap sur rendement total	10 335	(770)
23	31 juill. 2023	Camurus Ab, swap sur rendement total	785	(3)
494	31 juill. 2023	Clas Ohlson Ab, actions, B, swap sur rendement total	4 896	398
75	31 juill. 2023	Elanders Ab, actions, B, swap sur rendement total	1 095	(13)
2 017	31 juill. 2023	Electrolux Ab, série B, swap sur rendement total	36 373	967
696	31 juill. 2023	Elekta Ab, actions, B, swap sur rendement total	7 106	295
388	31 juill. 2023	Fagerhult Ab, swap sur rendement total	3 251	139
4 125	31 juill. 2023	Hennes & Mauritz Ab, actions, B, swap sur rendement total	93 580	24 849
30	31 juill. 2023	Hexpol Ab, swap sur rendement total	420	14

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
139	31 juill. 2023	Intrum Ab, swap sur rendement total	1 192	(135)
50	31 juill. 2023	Inwido Ab, swap sur rendement total	601	6
349	31 juill. 2023	Kambi Group Plc, swap sur rendement total	8 483	(490)
941	31 juill. 2023	Kamov Group Ab, swap sur rendement total	5 672	(135)
1 122	31 juill. 2023	Kindred Group Plc, swap sur rendement total	15 787	(1 243)
472	31 juill. 2023	Lagercrantz Group Ab, actions, B, swap sur rendement total	8 038	416
46	31 juill. 2023	Lindab International Ab, swap sur rendement total	864	(94)
397	31 juill. 2023	Modern Times Group, actions, B, swap sur rendement total	3 344	(17)
322	31 juill. 2023	Munters Group Ab, swap sur rendement total	4 824	(375)
166	31 juill. 2023	Myronic Ab, swap sur rendement total	5 430	495
85	31 juill. 2023	Ncab Group Ab, swap sur rendement total	875	3
229	31 juill. 2023	New Wave Group Ab - actions, B, swap sur rendement total	2 661	69
2 152	31 juill. 2023	Nibe Industrier Ab, actions, B, swap sur rendement total	26 996	(320)
510	31 juill. 2023	Nordic Waterproofing Hold Ab, swap sur rendement total	8 610	(271)
225	31 juill. 2023	Np3 Fastigheter Ab, swap sur rendement total	4 490	(314)
10	31 juill. 2023	Paradox Interactive Ab, swap sur rendement total	333	8
290	31 juill. 2023	Proact It Group Ab, swap sur rendement total	2 810	45
141	31 juill. 2023	Sensys Gatso Group Ab, swap sur rendement total	1 339	62
36	31 juill. 2023	Skanska Ab, actions, B, swap sur rendement total	667	22
831	31 juill. 2023	Skf Ab, actions, B, swap sur rendement total	19 098	1 390
957	31 juill. 2023	Ssab Ab, actions, B, swap sur rendement total	8 758	854
227	31 juill. 2023	Surgical Science Sweden Ab, swap sur rendement total	6 708	274
38	31 juill. 2023	Thule Group Ab/The, swap sur rendement total	1 476	175
936	31 juill. 2023	Tobii Ab, swap sur rendement total	1 915	(302)
58	31 juill. 2023	Vitec Software Group Ab, actions, B, swap sur rendement total	3 851	(20)
				<u>25 723</u>
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
54	31 juill. 2023	Ams Ag, swap sur rendement total	515	(22)
65	31 juill. 2023	Apg Sga Sa, swap sur rendement total	17 978	269
76	31 juill. 2023	Ascom Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	1 228	144
190	31 juill. 2023	Banque Cantonale Vaudois, actions ord., swap sur rendement total	26 557	760
8	31 juill. 2023	Bell Food Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	3 011	(140)
37	31 juill. 2023	Berner Kantonalbank Ag, actions ord., swap sur rendement total	12 696	(179)
8	31 juill. 2023	Bossard Holding Ag, actions ord. A, swap sur rendement total	2 352	(134)
1	31 juill. 2023	Bucher Industries Ag, actions ord., swap sur rendement total	584	19
41	31 juill. 2023	Burckhardt Compression Holdi, swap sur rendement total	31 837	(1 599)
18	31 juill. 2023	Burkhalter Holding Ag, swap sur rendement total	2 449	(4)
81	31 juill. 2023	Calida Holding, actions ord., swap sur rendement total	4 085	(702)
182	31 juill. 2023	Cembra Money Bank Ag, swap sur rendement total	19 974	1 637
1	31 juill. 2023	Ems-Chemie Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	1 001	(11)
104	31 juill. 2023	Feintool Intl Holding, actions ord., swap sur rendement total	3 300	(235)
1	31 juill. 2023	Forbo Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	1 899	(11)
34	31 juill. 2023	Hiag Immobilien Ag, swap sur rendement total	3 822	(108)
193	31 juill. 2023	Implenia Ag, actions ord., swap sur rendement total	12 403	(726)
1	31 juill. 2023	Intershop Holding Ag, swap sur rendement total	883	(20)
116	31 juill. 2023	Investis Holding Sa, swap sur rendement total	15 750	(859)
1	31 juill. 2023	Kardex Ag, actions ord., swap sur rendement total	297	10
102	31 juill. 2023	Lastminute.Com Nv, swap sur rendement total	4 269	311
5	31 juill. 2023	Luzerner Kantonalbank Ag, actions ord., swap sur rendement total	545	20
118	31 juill. 2023	Meier Tobler Group Ag, swap sur rendement total	9 215	707
156	31 juill. 2023	Montana Aerospace Ag, swap sur rendement total	3 332	66
13	31 juill. 2023	Orior Ag, swap sur rendement total	1 471	(5)
241	31 juill. 2023	Psp Swiss Property Ag, actions ord., swap sur rendement total	35 610	686
70	31 juill. 2023	Sig Combibloc Group Ag, swap sur rendement total	2 555	(39)
2	31 juill. 2023	St Galler Kantonalbank A, actions ord., swap sur rendement total	1 435	42
23	31 juill. 2023	Swiss Prime Site, actions ord., swap sur rendement total	2 642	9
48	31 juill. 2023	Thurgauer Kantonalbank, certificat, swap sur rendement total	8 555	(254)
13	31 juill. 2023	Tx Group Ag, swap sur rendement total	2 057	(26)
53	31 juill. 2023	U-Blox Holding Ag, swap sur rendement total	7 690	(1 505)
6	31 juill. 2023	Valiant Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	827	-
296	31 juill. 2023	Varia Us Properties Ag, swap sur rendement total	16 330	73
				<u>(1 826)</u>
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
1 248	31 juill. 2023	111 Inc, swap sur rendement total	4 062	(72)
126	31 juill. 2023	Abercrombie & Fitch Co, cat. A, swap sur rendement total	6 282	1 112
18	31 juill. 2023	Acadia Healthcare Co Inc, swap sur rendement total	1 897	207
26	31 juill. 2023	Acuity Brands Inc, swap sur rendement total	5 611	397

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
2 066	31 juill. 2023	Adecoagro Sa, swap sur rendement total	25 589	829
77	31 juill. 2023	Adeia Inc, swap sur rendement total	1 122	55
198	31 juill. 2023	Adt Inc, swap sur rendement total	1 589	92
676	31 juill. 2023	Advanced Micro Devices, swap sur rendement total	101 894	(3 010)
160	31 juill. 2023	Aes Corp, swap sur rendement total	4 389	183
211	31 juill. 2023	Alcoa Corp, swap sur rendement total	9 473	(16)
8 925	31 juill. 2023	Alfa S.A.B.-A, swap sur rendement total	7 348	4
1 794	31 juill. 2023	Alignment Healthcare Inc, swap sur rendement total	13 650	(347)
25	31 juill. 2023	Allstate Corp, swap sur rendement total	3 637	34
718	31 juill. 2023	Alphabet Inc, cat. A, swap sur rendement total	113 726	(4 366)
246	31 juill. 2023	Alphatec Holdings Inc, swap sur rendement total	5 853	392
4	31 juill. 2023	Altair Engineering Inc-A, swap sur rendement total	401	12
11	31 juill. 2023	Ambarella Inc, swap sur rendement total	1 218	159
87	31 juill. 2023	American Equity Invst Life HI, swap sur rendement total	5 999	710
49	31 juill. 2023	Amn Healthcare Services Inc, swap sur rendement total	7 075	876
31	31 juill. 2023	Angiodynamics Inc, swap sur rendement total	428	38
416	31 juill. 2023	Anheuser-Busch Inbev, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	31 223	1 222
50	31 juill. 2023	Antarchile Sa, swap sur rendement total	594	23
269	31 juill. 2023	Anywhere Real Estate Inc, swap sur rendement total	2 378	209
119	31 juill. 2023	Apple Inc, swap sur rendement total	30 544	1 154
345	31 juill. 2023	Applovin Corp, cat. A, swap sur rendement total	11 746	1 248
317	31 juill. 2023	Arcos Dorados Holdings Inc-A, swap sur rendement total	4 300	741
31	31 juill. 2023	Arcosa Inc, swap sur rendement total	3 108	130
13	31 juill. 2023	Arcturus Therapeutics Holdin, swap sur rendement total	493	71
242	31 juill. 2023	Arlo Technologies Inc, swap sur rendement total	3 494	385
7	31 juill. 2023	Asbury Automotive Group, swap sur rendement total	2 227	108
19	31 juill. 2023	Asml Holding Nv-Ny, actions ord., swap sur rendement total	18 221	(30)
284	31 juill. 2023	Atlassian Corp Plc, cat. A, swap sur rendement total	63 064	(5 128)
3 100	31 juill. 2023	Auren Energia Sa, On, swap sur rendement total	12 279	732
12	31 juill. 2023	Autodesk Inc, swap sur rendement total	3 249	11
71	31 juill. 2023	Autonation Inc, swap sur rendement total	15 465	2 629
130	31 juill. 2023	Avnet Inc, swap sur rendement total	8 679	1 108
12	31 juill. 2023	Axcelis Technologies Inc, swap sur rendement total	2 911	390
10	31 juill. 2023	Axis Capital Holdings Ltd, swap sur rendement total	718	28
284	31 juill. 2023	Axogen Inc, swap sur rendement total	3 431	224
84	31 juill. 2023	Axon Enterprise Inc, swap sur rendement total	21 688	117
1 200	31 juill. 2023	Azul Sa, swap sur rendement total	7 251	1 963
147	31 juill. 2023	Babcock & Wilcox Enterpr, swap sur rendement total	1 148	210
15	31 juill. 2023	Badger Meter Inc, swap sur rendement total	2 929	56
471	31 juill. 2023	Baker Hughes A Ge Co, swap sur rendement total	19 701	2 642
2 600	31 juill. 2023	Banco Abc Brasil Sa, swap sur rendement total	13 705	2 370
100	31 juill. 2023	Banco Estado Rio Gran, actions priv., B, swap sur rendement total	415	89
76	31 juill. 2023	Bank Ozk, swap sur rendement total	4 039	535
600	31 juill. 2023	Bb Seguridade Participacoes, swap sur rendement total	5 103	257
393	31 juill. 2023	Bbva Argentina Sa, CAAÉ, swap sur rendement total	3 188	901
14	31 juill. 2023	Beacon Roofing Supply Inc, swap sur rendement total	1 537	325
9	31 juill. 2023	Berkshire Hathaway Inc, cat. B, swap sur rendement total	4 061	49
60	31 juill. 2023	Biocryst Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	559	(100)
139	31 juill. 2023	Bj'S Restaurants Inc, swap sur rendement total	5 849	311
7	31 juill. 2023	Boston Beer Company Inc-A, swap sur rendement total	2 857	(255)
49	31 juill. 2023	Bowlero Corp, swap sur rendement total	755	10
110	31 juill. 2023	Box Inc, cat. A, swap sur rendement total	4 276	108
13	31 juill. 2023	Braze Inc-A, swap sur rendement total	753	46
47	31 juill. 2023	Brunswick Corp, swap sur rendement total	5 388	354
72	31 juill. 2023	C.H. Robinson Worldwide Inc, swap sur rendement total	9 047	(17)
148	31 juill. 2023	Calix Inc, swap sur rendement total	9 774	607
243	31 juill. 2023	Cal-Maine Foods Inc, swap sur rendement total	14 470	(727)
4 100	31 juill. 2023	Camil Alimentos Sa, swap sur rendement total	8 001	466
36	31 juill. 2023	Capri Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 710	31
465	31 juill. 2023	Carmax Inc, swap sur rendement total	51 502	6 688
1 615	31 juill. 2023	Carnival Corp, swap sur rendement total	40 241	15 954
40	31 juill. 2023	Carter'S Inc, swap sur rendement total	3 843	99
44	31 juill. 2023	Cellebrite Di Ltd, swap sur rendement total	419	82
1 680	31 juill. 2023	Celsia Sa Esp, swap sur rendement total	1 428	73
415	31 juill. 2023	Celsius Holdings Inc, swap sur rendement total	81 928	12 563
5 659	31 juill. 2023	Cementos Argos Sa	6 103	391
10	31 juill. 2023	Check Point Software Tech, swap sur rendement total	1 662	(81)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
282	31 juill. 2023	Chegg Inc, swap sur rendement total	3 314	(55)
144	31 juill. 2023	Chevron Corp, swap sur rendement total	29 983	1 130
877	31 juill. 2023	Chewy Inc, cat. A, swap sur rendement total	45 805	10 787
807	31 juill. 2023	China Automotive Systems Inc, swap sur rendement total	5 254	233
859	31 juill. 2023	Chromadex Corp, swap sur rendement total	1 785	166
100	31 juill. 2023	Cia Energetica Do Ceara, actions priv., A, swap sur rendement total	1 589	237
5 900	31 juill. 2023	Cia Saneamento Minas Gerais, swap sur rendement total	35 045	3 541
186 983	31 juill. 2023	Cia Sud Americana De Vapores, swap sur rendement total	16 791	(1 473)
7 900	31 juill. 2023	Cielo Sa, swap sur rendement total	10 023	367
23	31 juill. 2023	Cincinnati Financial Corp, swap sur rendement total	2 985	33
33	31 juill. 2023	Cirrus Logic Inc, swap sur rendement total	3 537	131
30	31 juill. 2023	Clear Secure Inc, cat. A, swap sur rendement total	920	(65)
448	31 juill. 2023	Clover Health Investments Co, swap sur rendement total	532	28
88	31 juill. 2023	Cognex Corp, swap sur rendement total	6 523	96
770	31 juill. 2023	Coinbase Global Inc, cat. A, swap sur rendement total	72 902	11 015
9 639	31 juill. 2023	Colbun Sa, swap sur rendement total	2 021	(11)
10	31 juill. 2023	Comfort Systems Usa Inc, swap sur rendement total	2 173	205
6	31 juill. 2023	Community Bank System Inc, swap sur rendement total	376	(18)
3 500	31 juill. 2023	Concentradora Fibra Danhos S, swap sur rendement total	5 828	(9)
468	31 juill. 2023	Concrete Pumping Holdings In, swap sur rendement total	4 973	658
25	31 juill. 2023	Conmed Corp, swap sur rendement total	4 502	335
71	31 juill. 2023	Conocophillips, swap sur rendement total	9 791	416
84	31 juill. 2023	Consolidated Edison Inc, swap sur rendement total	10 048	(98)
1 100	31 juill. 2023	Construtora Tenda Sa, swap sur rendement total	3 497	1 086
500	31 juill. 2023	Controladora Axtel S.A.B.-A, swap sur rendement total	9	9
61	31 juill. 2023	Corcept Therapeutics Inc, swap sur rendement total	1 796	(108)
132	31 juill. 2023	Corecivic Inc, swap sur rendement total	1 644	132
1 062	31 juill. 2023	Corp America Airports Sa, swap sur rendement total	16 287	1 907
1 900	31 juill. 2023	Corp Inmobiliaria Vesta Sab, swap sur rendement total	8 156	140
37	31 juill. 2023	Corsair Gaming Inc, swap sur rendement total	869	(132)
65	31 juill. 2023	Couchbase Inc, swap sur rendement total	1 361	(128)
43	31 juill. 2023	Crawford & Company, cat. A, swap sur rendement total	631	66
31	31 juill. 2023	Credo Technology Group Holdi, swap sur rendement total	711	(25)
5 500	31 juill. 2023	Cruzeiro Do Sul Educacional, swap sur rendement total	5 853	1 010
42	31 juill. 2023	Csg Systems Intl Inc, swap sur rendement total	2 931	172
800	31 juill. 2023	Csu Cardsystem S A Com Npv, swap sur rendement total	2 943	193
713	31 juill. 2023	Cvb Financial Corp, swap sur rendement total	12 529	1 119
95	31 juill. 2023	Cyberark Software Ltd/Israel, swap sur rendement total	19 652	195
28	31 juill. 2023	Dave & Buster'S Entertainmen, swap sur rendement total	1 651	379
24	31 juill. 2023	Digitalocean Holdings Inc, swap sur rendement total	1 275	30
6	31 juill. 2023	Diodes Inc, swap sur rendement total	734	41
267	31 juill. 2023	DocuSign Inc, swap sur rendement total	18 050	(1 954)
47	31 juill. 2023	Duckhorn Portfolio Inc/The, swap sur rendement total	807	(42)
37	31 juill. 2023	Duolingo, swap sur rendement total	6 998	(354)
10	31 juill. 2023	Dxp Enterprises Inc, swap sur rendement total	482	52
1 900	31 juill. 2023	Ecorodovias Infra E Log Sa, swap sur rendement total	3 414	229
243	31 juill. 2023	Ehealth Inc, swap sur rendement total	2 585	244
261	31 juill. 2023	Elanco Animal Health Inc, swap sur rendement total	3 474	639
23	31 juill. 2023	Elastic Nv, swap sur rendement total	1 951	(267)
51	31 juill. 2023	Elf Beauty Inc, swap sur rendement total	7 709	661
46	31 juill. 2023	Embraer Sa- CAAE parrainé, swap sur rendement total	941	54
2 146	31 juill. 2023	Emeren Group Ltd, swap sur rendement total	10 762	(305)
20	31 juill. 2023	Encore Wire Corp, swap sur rendement total	4 921	344
31	31 juill. 2023	Enstar Group Ltd, swap sur rendement total	10 019	317
42	31 juill. 2023	Eog Resources Inc, swap sur rendement total	6 360	365
12	31 juill. 2023	Eplus Inc, swap sur rendement total	894	106
100	31 juill. 2023	Essa Bancorp Inc, swap sur rendement total	1 978	28
364	31 juill. 2023	Estee Lauder Companies, cat. A, swap sur rendement total	94 589	5 318
100	31 juill. 2023	Eternit Sa, swap sur rendement total	308	24
63	31 juill. 2023	Etsy Inc, swap sur rendement total	7 053	265
700	31 juill. 2023	Eucatex Sa Industria, actions priv., swap sur rendement total	2 177	301
115	31 juill. 2023	Evolv Technologies Holdings, swap sur rendement total	913	2
250	31 juill. 2023	Exact Sciences Corp, swap sur rendement total	31 063	3 623
34	31 juill. 2023	Extreme Networks Inc, swap sur rendement total	1 172	238
110	31 juill. 2023	Exxon Mobil Corp, swap sur rendement total	15 611	678
74	31 juill. 2023	Ezcorp Inc, cat. A, swap sur rendement total	821	(28)
24	31 juill. 2023	Fidelity National Financial, swap sur rendement total	1 143	13

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	31 juill. 2023	Fiesta Restaurant Group, swap sur rendement total	1 051	95
18	31 juill. 2023	First American Financial, swap sur rendement total	1 358	(1)
1 227	31 juill. 2023	First Horizon Corp, swap sur rendement total	18 542	1 628
88	31 juill. 2023	Fiverr International Ltd, swap sur rendement total	3 029	(107)
165	31 juill. 2023	Fleury Sa, swap sur rendement total	732	69
124	31 juill. 2023	Fnb Corp, swap sur rendement total	1 877	(95)
30	31 juill. 2023	Foot Locker Inc, swap sur rendement total	1 076	66
6	31 juill. 2023	Franklin Electric Co Inc, swap sur rendement total	817	87
395	31 juill. 2023	Frontier Communications Pare, swap sur rendement total	9 743	1 898
25	31 juill. 2023	Frontline Ltd, swap sur rendement total	481	11
78	31 juill. 2023	Futurefuel Corp, swap sur rendement total	913	34
393	31 juill. 2023	Gap Inc/The, swap sur rendement total	4 644	456
4	31 juill. 2023	Generac Holdings Inc, swap sur rendement total	789	207
77	31 juill. 2023	Genesis Healthcare Inc, swap sur rendement total	1 890	96
19 100	31 juill. 2023	Gentara Sab De Cv, swap sur rendement total	27 093	(190)
346	31 juill. 2023	Gitlab Inc, cat. A, swap sur rendement total	23 400	3 212
17	31 juill. 2023	Glaukos Corp, swap sur rendement total	1 602	314
14	31 juill. 2023	Globe Life Inc, swap sur rendement total	2 031	109
9	31 juill. 2023	Gms Inc, swap sur rendement total	824	(11)
600	31 juill. 2023	Gps Participacoes E Empreend, swap sur rendement total	2 801	464
100	31 juill. 2023	Graham Corp, swap sur rendement total	1 757	284
9	31 juill. 2023	Green Brick Partners Inc, swap sur rendement total	676	104
3	31 juill. 2023	Group 1 Automotive Inc, swap sur rendement total	1 025	133
1 400	31 juill. 2023	Grupo Comercial Chedraui Sa, swap sur rendement total	10 574	935
1 743	31 juill. 2023	Grupo Energia Bogota Sa Esp, swap sur rendement total	1 069	148
1 700	31 juill. 2023	Grupo Herdez Sab, série *, swap sur rendement total	5 839	196
46	31 juill. 2023	Grupo Nutresa Sa, swap sur rendement total	765	(31)
1 955	31 juill. 2023	Grupo Security Sa, swap sur rendement total	655	4
11	31 juill. 2023	Guidewire Software Inc, swap sur rendement total	1 107	(107)
13	31 juill. 2023	H&R Block Inc, swap sur rendement total	553	38
10	31 juill. 2023	Haemonetics Corp/Mass, swap sur rendement total	1 127	5
275	31 juill. 2023	Halozyme Therapeutics Inc, swap sur rendement total	13 126	1 268
162	31 juill. 2023	Hanesbrands Inc, swap sur rendement total	973	89
165	31 juill. 2023	Harley-Davidson Inc, swap sur rendement total	7 688	849
56	31 juill. 2023	Harmony Gold Mng, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	311	(40)
28	31 juill. 2023	Heartland Express Inc, swap sur rendement total	609	28
236	31 juill. 2023	Herbalife Nutrition Ltd, swap sur rendement total	4 135	259
114	31 juill. 2023	Heritage Financial Corp, swap sur rendement total	2 439	(209)
831	31 juill. 2023	Heritage Insurance Holdings, swap sur rendement total	4 234	(613)
64	31 juill. 2023	Hess Corp, swap sur rendement total	11 513	674
4	31 juill. 2023	Hexcel Corp, swap sur rendement total	402	35
11 100	31 juill. 2023	Hidrovias Do Brasil Sa, swap sur rendement total	9 757	831
148	31 juill. 2023	Horace Mann Educators, swap sur rendement total	5 809	(101)
8 600	31 juill. 2023	Hoteles City Express Sab De, swap sur rendement total	4 767	(221)
38	31 juill. 2023	Humana Inc, swap sur rendement total	22 528	(24)
1 700	31 juill. 2023	Hypera Sa, swap sur rendement total	21 620	3 066
4	31 juill. 2023	Illumina Inc, swap sur rendement total	992	(57)
1 364	31 juill. 2023	Immunogen Inc, swap sur rendement total	34 059	9 340
120	31 juill. 2023	Immunovant Inc, swap sur rendement total	3 012	(336)
23	31 juill. 2023	Inari Medical Inc, swap sur rendement total	1 769	(76)
72	31 juill. 2023	Inmode Ltd, swap sur rendement total	3 558	90
58	31 juill. 2023	Innoviva Inc, swap sur rendement total	977	(35)
9	31 juill. 2023	Insight Enterprises Inc, swap sur rendement total	1 743	34
3	31 juill. 2023	Installed Building Products, swap sur rendement total	556	140
14	31 juill. 2023	Integer Holdings Corp, swap sur rendement total	1 642	40
633	31 juill. 2023	Intel Corp, swap sur rendement total	28 010	1 559
668	31 juill. 2023	Intevac Inc, swap sur rendement total	3 315	(1 075)
1 338	31 juill. 2023	Inversiones La Construcccion, swap sur rendement total	12 832	599
11	31 juill. 2023	Irhythm Technologies Inc, swap sur rendement total	1 518	(150)
32	31 juill. 2023	Itron Inc, swap sur rendement total	3 053	111
2	31 juill. 2023	Jacobs Engineering Group Inc, swap sur rendement total	315	20
500	31 juill. 2023	Jalles Machado Sa, swap sur rendement total	1 039	27
49	31 juill. 2023	Jazz Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	8 038	(330)
153	31 juill. 2023	Jinkosolar Holding Co, CAAÉ, swap sur rendement total	8 985	439
1 415	31 juill. 2023	Kandi Technologies Group Inc, swap sur rendement total	7 415	772
13	31 juill. 2023	Keysight Technologies In, swap sur rendement total	2 881	82
44	31 juill. 2023	Kiniksa Pharmaceuticals-A, swap sur rendement total	820	10

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
9	31 juill. 2023	Krystal Biotech Inc, swap sur rendement total	1 398	(9)
179	31 juill. 2023	Landsea Homes Corp, swap sur rendement total	2 212	482
176	31 juill. 2023	Lantheus Holdings Inc, swap sur rendement total	19 544	(705)
1 706 866	31 juill. 2023	Latam Airlines Group Sa, swap sur rendement total	21 357	1 150
59	31 juill. 2023	Lattice Semiconductor Corp, swap sur rendement total	7 500	1 118
71	31 juill. 2023	Lemonade Inc, swap sur rendement total	1 583	(79)
133	31 juill. 2023	Lexicon Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	403	(32)
35	31 juill. 2023	Liberty Global Plc-C, swap sur rendement total	823	29
3	31 juill. 2023	Lithia Motors Inc, cat. A, swap sur rendement total	1 207	276
26	31 juill. 2023	Live Nation Entertainment In, swap sur rendement total	3 135	177
310	31 juill. 2023	Liveone Inc, swap sur rendement total	722	261
112	31 juill. 2023	Loews Corp, swap sur rendement total	8 800	464
384	31 juill. 2023	Loma Negra Cia Ind, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	3 691	553
214	31 juill. 2023	Lumen Technologies Inc, swap sur rendement total	640	77
100	31 juill. 2023	M Dias Branco Sa, swap sur rendement total	1 177	158
1 900	31 juill. 2023	Macquarie Mexico Real Estate, swap sur rendement total	4 425	141
1	31 juill. 2023	Madison Square Garden Sports, swap sur rendement total	249	14
21	31 juill. 2023	Madrigal Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	6 419	(1 348)
1 000	31 juill. 2023	Mahle-Metal Leve Sa, swap sur rendement total	12 864	1 344
62 400	31 juill. 2023	Marcopolo Sa, actions priv., swap sur rendement total	89 863	11 292
97 583	31 juill. 2023	Masisa Sa, swap sur rendement total	3 826	190
6	31 juill. 2023	Materion Corp, swap sur rendement total	907	71
82	31 juill. 2023	Maxeon Solar Technologie, swap sur rendement total	3 056	28
145	31 juill. 2023	Medallion Financial Corp, swap sur rendement total	1 518	292
5	31 juill. 2023	Medpace Holdings Inc, swap sur rendement total	1 589	210
108	31 juill. 2023	Meta Platforms Inc, cat. A, swap sur rendement total	41 013	362
4 600	31 juill. 2023	Metalurgica Gerdau Sa, swap sur rendement total	15 029	1 584
11	31 juill. 2023	Methode Electronics Inc, swap sur rendement total	488	(65)
211	31 juill. 2023	Metlife Inc, swap sur rendement total	15 784	1 886
225	31 juill. 2023	Microsoft Corp, swap sur rendement total	101 389	2 558
43	31 juill. 2023	Millerknoll Inc, swap sur rendement total	852	77
1 500	31 juill. 2023	Mills Estruturas E Servicos, swap sur rendement total	4 704	(210)
59	31 juill. 2023	Mimedx Group Inc, swap sur rendement total	516	57
17	31 juill. 2023	Miniso Group Holding Ltd, CAAÉ, swap sur rendement total	382	31
5	31 juill. 2023	Molina Healthcare Inc, swap sur rendement total	1 993	174
15	31 juill. 2023	Moonlake Immunotherapeutics, swap sur rendement total	1 012	(28)
456	31 juill. 2023	Motorcar Parts Of America In, swap sur rendement total	4 670	1 332
2 400	31 juill. 2023	Multiplan Empreendimentos, swap sur rendement total	18 356	915
148	31 juill. 2023	N-Able Inc, swap sur rendement total	2 822	30
8	31 juill. 2023	National Beverage Corp, swap sur rendement total	512	(13)
20	31 juill. 2023	National Vision Holdings Inc, swap sur rendement total	643	(34)
53	31 juill. 2023	Neino Inc, swap sur rendement total	2 112	71
923	31 juill. 2023	Newell Brands Inc, swap sur rendement total	10 626	426
126	31 juill. 2023	NI Industries, swap sur rendement total	922	(9)
51	31 juill. 2023	Northwest Natural Holding Co, swap sur rendement total	2 905	(78)
2 919	31 juill. 2023	Norwegian Cruise Line Holdin, swap sur rendement total	84 088	26 096
91	31 juill. 2023	Nov Inc, swap sur rendement total	1 931	51
44	31 juill. 2023	Novartis Ag, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	5 875	(94)
118	31 juill. 2023	Novocure Ltd, swap sur rendement total	6 480	(563)
29	31 juill. 2023	Novo-Nordisk A/S- CAAE parrainé, swap sur rendement total	6 210	85
1 072	31 juill. 2023	Nrg Energy Inc, swap sur rendement total	53 039	4 873
420	31 juill. 2023	Nutanix Inc-A, swap sur rendement total	15 589	(944)
80	31 juill. 2023	Nvidia Corp, swap sur rendement total	44 781	786
32	31 juill. 2023	Nxp Semiconductors Nv, swap sur rendement total	8 710	1 023
5 400	31 juill. 2023	Odontoprev Sa, swap sur rendement total	18 790	3 091
1	31 juill. 2023	Old Dominion Freight Line, swap sur rendement total	489	59
34	31 juill. 2023	Old Republic Intl Corp, swap sur rendement total	1 132	10
15	31 juill. 2023	Olin Corp, swap sur rendement total	1 020	73
14	31 juill. 2023	One Gas Inc, swap sur rendement total	1 423	(83)
34	31 juill. 2023	Owens & Minor Inc, swap sur rendement total	857	(11)
167	31 juill. 2023	Pagerduty Inc, swap sur rendement total	4 968	(1 023)
797	31 juill. 2023	Paramount Global, cat. B, swap sur rendement total	16 832	695
99	31 juill. 2023	Patterson Cos Inc, swap sur rendement total	4 357	906
973	31 juill. 2023	Paypal Holdings Inc, swap sur rendement total	85 916	4 484
1 375	31 juill. 2023	Peloton Interactive Inc-A, swap sur rendement total	13 992	615
1	31 juill. 2023	Penumbra Inc, swap sur rendement total	455	41
22	31 juill. 2023	Petmed Express Inc, swap sur rendement total	401	(32)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
68	31 juill. 2023	Photronics Inc, swap sur rendement total	2 321	402
4	31 juill. 2023	Pioneer Natural Resources Co, swap sur rendement total	1 097	36
793	31 juill. 2023	Pixelworks Inc, swap sur rendement total	1 815	(55)
79	31 juill. 2023	Point Biopharma Global Inc, swap sur rendement total	947	(26)
56	31 juill. 2023	Polaris Inc, swap sur rendement total	8 961	943
5	31 juill. 2023	Popular Inc, swap sur rendement total	404	24
800	31 juill. 2023	Porto Seguro Sa, swap sur rendement total	6 218	1 207
23	31 juill. 2023	Ppg Industries Inc, swap sur rendement total	4 513	119
19	31 juill. 2023	Prestige Consumer Healthcare, swap sur rendement total	1 494	49
60	31 juill. 2023	Procore Technologies Inc, swap sur rendement total	5 166	341
3 500	31 juill. 2023	Profarma Distribuidora, swap sur rendement total	3 812	593
232	31 juill. 2023	Protagonist Therapeutics Inc, swap sur rendement total	8 479	43
59	31 juill. 2023	Prothena Corp Plc, swap sur rendement total	5 331	122
85	31 juill. 2023	Prudential Financial Inc, swap sur rendement total	9 923	1 021
201	31 juill. 2023	Pulmonx Corp, swap sur rendement total	3 487	59
329	31 juill. 2023	Pure Storage Inc, cat. A, swap sur rendement total	16 030	3 416
123	31 juill. 2023	Radiant Logistics Inc, swap sur rendement total	1 094	72
2 500	31 juill. 2023	Randon Participacoes Sa, actions priv., swap sur rendement total	8 410	1 379
24	31 juill. 2023	Rapid7 Inc, swap sur rendement total	1 438	(98)
400	31 juill. 2023	Regional Sab De Cv, swap sur rendement total	3 835	(280)
2	31 juill. 2023	Reliance Steel & Aluminum, swap sur rendement total	719	95
89	31 juill. 2023	Ringcentral Inc, cat. A, swap sur rendement total	3 855	(309)
10	31 juill. 2023	Rli Corp, swap sur rendement total	1 806	156
79	31 juill. 2023	Roivant Sciences Ltd, swap sur rendement total	1 054	100
381	31 juill. 2023	Roku Inc, swap sur rendement total	32 246	2 641
7	31 juill. 2023	Royal Caribbean Cruises Ltd, swap sur rendement total	961	151
55	31 juill. 2023	Rpm International Inc, swap sur rendement total	6 530	619
64	31 juill. 2023	Ryanair Holdings Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	9 366	404
186	31 juill. 2023	Samsara Inc-cat. A, swap sur rendement total	6 820	2 005
168	31 juill. 2023	Sapiens International Corp, swap sur rendement total	5 913	102
29	31 juill. 2023	Sarepta Therapeutics Inc, swap sur rendement total	4 395	(370)
440	31 juill. 2023	Schwab (Charles) Corp, swap sur rendement total	33 001	2 195
25	31 juill. 2023	Seagate Technology, swap sur rendement total	2 070	91
124	31 juill. 2023	Sempra Energy, swap sur rendement total	23 889	68
4	31 juill. 2023	Shockwave Medical Inc, swap sur rendement total	1 511	46
62	31 juill. 2023	Shutterstock Inc, swap sur rendement total	3 993	(129)
228	31 juill. 2023	Sk Telecom Co Ltd, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	5 886	(483)
44	31 juill. 2023	Sm Energy Co, swap sur rendement total	1 842	301
82	31 juill. 2023	Smartrent Inc, swap sur rendement total	416	23
26	31 juill. 2023	Smartsheet Inc, cat. A, swap sur rendement total	1 316	(183)
2 867	31 juill. 2023	Smu Sa, swap sur rendement total	667	23
928	31 juill. 2023	Snap Inc-A, swap sur rendement total	14 539	1 963
5 698	31 juill. 2023	Sonda Sa, swap sur rendement total	3 667	(179)
622	31 juill. 2023	Sonos Inc, swap sur rendement total	13 441	957
454	31 juill. 2023	Spire Global Inc, swap sur rendement total	309	(138)
196	31 juill. 2023	Spirit Aerosystems Hold, cat. A, swap sur rendement total	7 571	644
63	31 juill. 2023	Splunk Inc, swap sur rendement total	8 844	532
168	31 juill. 2023	Spok Holdings Inc, swap sur rendement total	2 954	317
185	31 juill. 2023	Sprout Social Inc, cat. A, swap sur rendement total	11 300	647
592	31 juill. 2023	Sprouts Farmers Market Inc, swap sur rendement total	28 773	1 940
8	31 juill. 2023	Spx Technologies Inc, swap sur rendement total	899	51
100	31 juill. 2023	Standard Motor Prods, swap sur rendement total	4 965	272
56	31 juill. 2023	Steelcase Inc, cat. A, swap sur rendement total	571	88
59	31 juill. 2023	Steven Madden Ltd, swap sur rendement total	2 552	103
253	31 juill. 2023	Sunpower Corp, swap sur rendement total	3 281	(281)
67	31 juill. 2023	Super Micro Computer Inc, swap sur rendement total	22 098	2 021
36	31 juill. 2023	Supernus Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	1 432	(151)
100	31 juill. 2023	Tango Therapeutics Inc, swap sur rendement total	439	78
374	31 juill. 2023	Target Corp, swap sur rendement total	65 277	371
1 300	31 juill. 2023	Taurus Armas, swap sur rendement total	5 415	270
602	31 juill. 2023	Teekay Corp, swap sur rendement total	4 811	150
72	31 juill. 2023	Teekay Tankers Ltd, cat. A, swap sur rendement total	3 642	46
5	31 juill. 2023	Teledyne Technologies Inc, swap sur rendement total	2 720	69
69	31 juill. 2023	Tenable Holdings Inc, swap sur rendement total	3 976	164
47	31 juill. 2023	Terex Corp, swap sur rendement total	3 721	825
265	31 juill. 2023	Terns Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	3 068	(696)
158	31 juill. 2023	Textainer Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	8 233	(95)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
780	31 juill. 2023	Tg Therapeutics Inc, swap sur rendement total	25 638	(146)
90	31 juill. 2023	Third Coast Bancshares Inc, swap sur rendement total	1 890	(187)
25	31 juill. 2023	Timkensteel Corp, swap sur rendement total	714	60
76	31 juill. 2023	Titan International Inc, swap sur rendement total	1 155	82
1 055	31 juill. 2023	Toast Inc, cat. A, swap sur rendement total	31 508	2 065
200	31 juill. 2023	Totvs Sa, swap sur rendement total	1 657	146
8	31 juill. 2023	Travelers Cos Inc/The, swap sur rendement total	1 838	28
94	31 juill. 2023	Trupanion Inc, swap sur rendement total	2 448	(358)
130	31 juill. 2023	Trustmark Corp, swap sur rendement total	3 633	26
36	31 juill. 2023	Turtle Beach Corp, swap sur rendement total	555	11
361	31 juill. 2023	Ugi Corp, swap sur rendement total	13 063	(357)
31	31 juill. 2023	Ultragenyx Pharmaceutical In, swap sur rendement total	1 892	(140)
214	31 juill. 2023	United Bankshares Inc, swap sur rendement total	8 504	(133)
40	31 juill. 2023	United Natural Foods Inc, swap sur rendement total	1 035	(32)
8	31 juill. 2023	Unitedhealth Group Inc, swap sur rendement total	5 088	39
30	31 juill. 2023	Urban Outfitters Inc, swap sur rendement total	1 315	60
688	31 juill. 2023	Us Bancorp, swap sur rendement total	30 516	3 107
1 559	31 juill. 2023	Vacasa Inc, cat. A, swap sur rendement total	1 400	(187)
6	31 juill. 2023	Vail Resorts Inc, swap sur rendement total	2 015	47
22	31 juill. 2023	Valaris Plc, swap sur rendement total	1 832	145
5 900	31 juill. 2023	Valid Solucoes Sa, swap sur rendement total	23 892	1 972
26	31 juill. 2023	Varex Imaging Corp, swap sur rendement total	811	50
18	31 juill. 2023	Varonis Systems Inc, swap sur rendement total	635	3
193	31 juill. 2023	Ventyx Biosciences Inc, swap sur rendement total	8 377	(415)
3	31 juill. 2023	Veritiv Corp, swap sur rendement total	499	78
96	31 juill. 2023	Vf Corp, swap sur rendement total	2 425	228
613	31 juill. 2023	Viking Therapeutics Inc, swap sur rendement total	13 149	(2 400)
33	31 juill. 2023	Village Super Market, cat. A, swap sur rendement total	996	86
5	31 juill. 2023	Visa Inc-actions, cat. A, swap sur rendement total	1 571	12
225	31 juill. 2023	Vishay Intertechnology Inc, swap sur rendement total	8 753	792
25	31 juill. 2023	Vita Coco Co Inc/The, swap sur rendement total	889	-
700	31 juill. 2023	Vulcabras Azaleia Sa, swap sur rendement total	3 347	211
114	31 juill. 2023	Walmart Inc, swap sur rendement total	23 711	288
69	31 juill. 2023	Walt Disney Co/The, swap sur rendement total	8 152	89
32	31 juill. 2023	Waters Corp, swap sur rendement total	11 286	592
6	31 juill. 2023	Watsco Inc, swap sur rendement total	3 029	443
74	31 juill. 2023	Wayfair Inc, cat. A, swap sur rendement total	6 366	2 317
184	31 juill. 2023	Weave Communications Inc, swap sur rendement total	2 705	793
76	31 juill. 2023	Western Digital Corp, swap sur rendement total	3 815	(230)
23	31 juill. 2023	Williams-Sonoma Inc, swap sur rendement total	3 809	334
51	31 juill. 2023	Willis Lease Finance Corp, swap sur rendement total	2 641	(319)
9 500	31 juill. 2023	Wilson Sons Holdings Brasil, swap sur rendement total	35 450	8 428
52	31 juill. 2023	Wingstop Inc, swap sur rendement total	13 773	6
74	31 juill. 2023	Winnebago Industries, swap sur rendement total	6 530	410
73	31 juill. 2023	Wix.Com Ltd, swap sur rendement total	7 558	166
4 000	31 juill. 2023	Wiz Co, swap sur rendement total	6 966	860
887	31 juill. 2023	Wolfspeed Inc, swap sur rendement total	65 247	8 347
3	31 juill. 2023	Woodward Inc, swap sur rendement total	472	52
477	31 juill. 2023	Wf Berkley Corp, swap sur rendement total	37 594	2 131
300	31 juill. 2023	Yduqs Part, swap sur rendement total	1 644	428
535	31 juill. 2023	Yext Inc, swap sur rendement total	8 007	(1 483)
200	31 juill. 2023	Zamp Sa, swap sur rendement total	252	53
1 153	31 juill. 2023	Zillow Group Inc-C, swap sur rendement total	76 682	6 711
218	31 juill. 2023	Zimvie Inc, swap sur rendement total	3 240	349
226	31 juill. 2023	Zoom Video Communications-A, swap sur rendement total	20 300	20
14	31 juill. 2023	Zscaler Inc, swap sur rendement total	2 710	(20)
28	31 juill. 2023	Zuora Inc, cat. A, swap sur rendement total	406	4
				<u>247 994</u>
				<u>373 703</u>
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position acheteur		

Swaps d'actions – position vendeur

Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)

(541)	31 juill. 2023	4D Pharma Plc, swap sur rendement total	(152)	-
(25)	31 juill. 2023	Admiral Group Plc, swap sur rendement total	(876)	108
(25)	31 juill. 2023	Bae Systems Plc, swap sur rendement total	(390)	8
(884)	31 juill. 2023	Batm Advanced Communications, swap sur rendement total	(392)	(37)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(412)	31 juill. 2023	Bhp Group Ltd-Di, swap sur rendement total	(16 219)	813
(647)	31 juill. 2023	Big Yellow Group Plc, swap sur rendement total	(11 679)	319
(3 257)	31 juill. 2023	Boohoo Group Plc, swap sur rendement total	(1 857)	295
(100)	31 juill. 2023	Boot (Henry) Plc, swap sur rendement total	(353)	42
(15)	31 juill. 2023	Bunzl Plc, swap sur rendement total	(768)	10
(548)	31 juill. 2023	Cairn Homes Plc, swap sur rendement total	(919)	(78)
(100)	31 juill. 2023	Chesnara Plc, swap sur rendement total	(455)	17
(257)	31 juill. 2023	Croda International Plc, swap sur rendement total	(24 324)	286
(1 622)	31 juill. 2023	De La Rue Plc, swap sur rendement total	(1 310)	(248)
(435)	31 juill. 2023	Diageo Plc, swap sur rendement total	(24 728)	(297)
(4 062)	31 juill. 2023	Diversified Energy Co Plc, swap sur rendement total	(6 041)	(205)
(198)	31 juill. 2023	Energean Plc, swap sur rendement total	(3 411)	287
(44)	31 juill. 2023	Fevertree Drinks Plc, swap sur rendement total	(902)	104
(2 037)	31 juill. 2023	Frasers Group Plc, swap sur rendement total	(24 057)	(685)
(506)	31 juill. 2023	Fresnillo Plc, swap sur rendement total	(5 194)	347
(398)	31 juill. 2023	Future Plc, swap sur rendement total	(4 520)	331
(79)	31 juill. 2023	Grainger Plc, swap sur rendement total	(305)	26
(111)	31 juill. 2023	Great Portland Estates Plc, swap sur rendement total	(790)	116
(6 745)	31 juill. 2023	Greatland Gold Plc, swap sur rendement total	(817)	82
(1 139)	31 juill. 2023	Gym Group Plc/The, swap sur rendement total	(1 748)	94
(6 628)	31 juill. 2023	Haleon Plc, swap sur rendement total	(35 932)	(106)
(748)	31 juill. 2023	Hikma Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	(23 790)	(1 072)
(30)	31 juill. 2023	Hill & Smith Holdings Plc, swap sur rendement total	(769)	(32)
(739)	31 juill. 2023	Hilton Food Group Plc, swap sur rendement total	(7 758)	1 288
(574)	31 juill. 2023	Hotel Chocolat Group Plc, swap sur rendement total	(1 149)	322
(108)	31 juill. 2023	Ig Design Group Plc, swap sur rendement total	(261)	(1)
(810)	31 juill. 2023	Impax Asset Management Group, swap sur rendement total	(7 818)	1 323
(6 366)	31 juill. 2023	Itm Power Plc, swap sur rendement total	(7 741)	(300)
(65)	31 juill. 2023	James Fisher & Sons Plc, swap sur rendement total	(438)	(36)
(8 930)	31 juill. 2023	Jd Sports Fashion Plc, swap sur rendement total	(21 934)	4 067
(1 646)	31 juill. 2023	Jubilee Metals Group Plc, swap sur rendement total	(216)	(4)
(5 389)	31 juill. 2023	Legal & General Group Plc, swap sur rendement total	(20 607)	178
(263)	31 juill. 2023	Londonmetric Property Plc, swap sur rendement total	(743)	60
(287)	31 juill. 2023	M&G Plc, swap sur rendement total	(924)	48
(50)	31 juill. 2023	Mortgage Advice Bureau Holdi, swap sur rendement total	(496)	100
(206)	31 juill. 2023	Next Plc, swap sur rendement total	(23 912)	(1 818)
(5 591)	31 juill. 2023	Ocado Group Plc, swap sur rendement total	(53 425)	(15 530)
(6 334)	31 juill. 2023	Old Mutual Ltd, swap sur rendement total	(5 413)	(788)
(66)	31 juill. 2023	Oxford Biomedica Plc, swap sur rendement total	(466)	33
(386)	31 juill. 2023	Petrofac Ltd, swap sur rendement total	(513)	(53)
(1 422)	31 juill. 2023	Phoenix Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(12 722)	541
(100)	31 juill. 2023	Phoenix Spree Deutschland Lt, swap sur rendement total	(313)	16
(259)	31 juill. 2023	Picton Property Income Ltd, swap sur rendement total	(305)	22
(3 850)	31 juill. 2023	Prudential Plc, swap sur rendement total	(71 797)	(3 075)
(7 692)	31 juill. 2023	Quilter Plc, swap sur rendement total	(10 249)	672
(2 526)	31 juill. 2023	Regional Reit Ltd, swap sur rendement total	(2 055)	124
(183)	31 juill. 2023	Rws Holdings Plc, swap sur rendement total	(732)	(24)
(406)	31 juill. 2023	Serica Energy Plc, swap sur rendement total	(1 533)	(38)
(1 621)	31 juill. 2023	Shaftesbury Capital Plc, swap sur rendement total	(3 139)	143
(146)	31 juill. 2023	Shell Plc, swap sur rendement total	(5 754)	(277)
(2 843)	31 juill. 2023	St James'S Place Plc, swap sur rendement total	(52 013)	1 504
(264)	31 juill. 2023	Strix Group Plc, swap sur rendement total	(470)	(27)
(525)	31 juill. 2023	Target Healthcare Reit Plc, swap sur rendement total	(634)	19
(873)	31 juill. 2023	Thg Plc, swap sur rendement total	(1 197)	(282)
(656)	31 juill. 2023	Tremor International Ltd, swap sur rendement total	(3 125)	(27)
(590)	31 juill. 2023	Wh Smith Plc, swap sur rendement total	(15 365)	332
(2)	31 juill. 2023	Woodside Energy Group, swap sur rendement total	(61)	(1)
(100)	31 juill. 2023	Workspace Group Plc, swap sur rendement total	(795)	48
				<u>(10 916)</u>
Euro – taux à court terme (ESTR)				
(99)	31 juill. 2023	l&l Ag, swap sur rendement total	(1 432)	4
(14)	31 juill. 2023	Aalberts Nv, swap sur rendement total	(801)	(6)
(100)	31 juill. 2023	Abc Arbitrage, swap sur rendement total	(859)	33
(18)	31 juill. 2023	Accor Sa, swap sur rendement total	(884)	(67)
(23)	31 juill. 2023	Ado Properties Sa, swap sur rendement total	(18)	(3)
(400)	31 juill. 2023	Adp, swap sur rendement total	(75 937)	6 290
(29)	31 juill. 2023	Adyen Nv, swap sur rendement total	(66 392)	(639)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(6 948)	31 juill. 2023	Aegon Nv, swap sur rendement total	(46 442)	(4 951)
(4)	31 juill. 2023	Aena Sme Sa, swap sur rendement total	(855)	(8)
(44)	31 juill. 2023	Alfen Nv, swap sur rendement total	(3 912)	265
(319)	31 juill. 2023	Almirall Sa, swap sur rendement total	(3 489)	305
(25)	31 juill. 2023	Alteara, swap sur rendement total	(4 028)	242
(5 725)	31 juill. 2023	Amper Sa, swap sur rendement total	(838)	(29)
(165)	31 juill. 2023	Anora Group Oyj, swap sur rendement total	(1 172)	(11)
(4)	31 juill. 2023	Argenx Se, swap sur rendement total	(2 052)	56
(176)	31 juill. 2023	Asm International Nv, swap sur rendement total	(98 674)	4 120
(131)	31 juill. 2023	Basf Se, swap sur rendement total	(8 410)	3
(831)	31 juill. 2023	Bayer Ag, actions ord., swap sur rendement total	(60 788)	1 940
(31)	31 juill. 2023	Beiersdorf Ag, swap sur rendement total	(5 426)	(79)
(78)	31 juill. 2023	Bike24 Holding Ag, swap sur rendement total	(350)	1
(2 186)	31 juill. 2023	Cellnex Telecom Sa, swap sur rendement total	(116 735)	2 898
(96)	31 juill. 2023	Colruyt Sa, swap sur rendement total	(4 733)	(424)
(7)	31 juill. 2023	Construce Y Aux De Ferrocarr, swap sur rendement total	(311)	(9)
(73)	31 juill. 2023	Cropenergies Ag, swap sur rendement total	(1 056)	(57)
(21)	31 juill. 2023	Cts Eventim Ag & Co Kgaa, swap sur rendement total	(1 754)	77
(157)	31 juill. 2023	Daimler Truck Holding Ag, swap sur rendement total	(7 480)	(299)
(232)	31 juill. 2023	Danone, swap sur rendement total	(18 803)	(57)
(29)	31 juill. 2023	Delivery Hero Se, swap sur rendement total	(1 692)	(168)
(2 710)	31 juill. 2023	Deutsche Telekom Ag, actions ord., swap sur rendement total	(78 153)	(1 474)
(331)	31 juill. 2023	Deutsche Wohnen Se, swap sur rendement total	(10 092)	(1 178)
(100)	31 juill. 2023	Die Asset Ag, swap sur rendement total	(735)	5
(27)	31 juill. 2023	Draegerwerk Ag, actions priv., swap sur rendement total	(1 698)	3
(154)	31 juill. 2023	Ebro Foods Sa, swap sur rendement total	(3 593)	109
(34)	31 juill. 2023	Elia Group Sa/Nv, swap sur rendement total	(5 709)	(124)
(4)	31 juill. 2023	Energiekontor Ag, swap sur rendement total	(405)	(6)
(140)	31 juill. 2023	Essilorluxottica, swap sur rendement total	(34 885)	(729)
(321)	31 juill. 2023	Faes Farma Sa, swap sur rendement total	(1 474)	62
(4 780)	31 juill. 2023	Fortum Oyj, swap sur rendement total	(84 637)	1 443
(354)	31 juill. 2023	Freenet Ag, swap sur rendement total	(11 744)	10
(12)	31 juill. 2023	Galapagos Nv, swap sur rendement total	(647)	22
(217)	31 juill. 2023	Gaztransport Et Techniga Sa, swap sur rendement total	(29 213)	168
(186)	31 juill. 2023	Hamborner Reit Ag, swap sur rendement total	(1 716)	72
(13)	31 juill. 2023	Hamburger Hafen Und Logistik, swap sur rendement total	(213)	16
(198)	31 juill. 2023	Hella Gmbh & Co Kgaa, swap sur rendement total	(20 609)	(235)
(2 301)	31 juill. 2023	Hellofresh Se, swap sur rendement total	(75 074)	(1 887)
(28)	31 juill. 2023	Henkel Ag & Co Kgaa Vorzug, swap sur rendement total	(2 961)	14
(6)	31 juill. 2023	Hypoport Ag, swap sur rendement total	(1 449)	(157)
(118)	31 juill. 2023	Immobel, swap sur rendement total	(5 928)	826
(1 253)	31 juill. 2023	Just Eat Takeaway.Com Nv, swap sur rendement total	(25 390)	120
(333)	31 juill. 2023	Kamux Corp, swap sur rendement total	(2 610)	(145)
(77)	31 juill. 2023	Kerry Group Plc-A, swap sur rendement total	(9 936)	(132)
(101)	31 juill. 2023	Kesko Oyj, actions, B, swap sur rendement total	(2 515)	117
(1 133)	31 juill. 2023	Kojamo Oyj, swap sur rendement total	(14 100)	1 289
(21)	31 juill. 2023	Kws Saat Se & Co Kgaa, swap sur rendement total	(1 707)	(72)
(250)	31 juill. 2023	Lassila & Tikanoja Oyj, swap sur rendement total	(3 598)	63
(50)	31 juill. 2023	Lectra, swap sur rendement total	(1 971)	21
(79)	31 juill. 2023	Lna Sante, swap sur rendement total	(3 285)	(79)
(63)	31 juill. 2023	Lvmh Moët Hennessy Louis Vui, swap sur rendement total	(78 491)	(3 776)
(324)	31 juill. 2023	Mercialys, swap sur rendement total	(3 866)	(346)
(21)	31 juill. 2023	Miquel Y Costas, swap sur rendement total	(349)	4
(75)	31 juill. 2023	Mtu Aero Engines Ag, swap sur rendement total	(25 704)	(2 102)
(50)	31 juill. 2023	Musti Group Oy, swap sur rendement total	(1 291)	89
(240)	31 juill. 2023	Nacon Sa, swap sur rendement total	(686)	94
(376)	31 juill. 2023	Neinor Homes Sa, swap sur rendement total	(5 010)	(138)
(214)	31 juill. 2023	Neoen Sa, swap sur rendement total	(8 959)	(265)
(49)	31 juill. 2023	Ohb Se, swap sur rendement total	(2 260)	(64)
(100)	31 juill. 2023	Orange Belgium, swap sur rendement total	(1 998)	(18)
(487)	31 juill. 2023	Oriola Corp-B, swap sur rendement total	(904)	57
(137)	31 juill. 2023	Orion Oyj, cat. B, swap sur rendement total	(7 520)	323
(8)	31 juill. 2023	Orpea, swap sur rendement total	(22)	1
(115)	31 juill. 2023	Permod Ricard Sa, swap sur rendement total	(33 603)	-
(748)	31 juill. 2023	Prosegur Cash Sa, swap sur rendement total	(641)	44
(670)	31 juill. 2023	Prosus Nv, swap sur rendement total	(64 913)	(1 092)
(307)	31 juill. 2023	Qiagen N.V., swap sur rendement total	(18 233)	230

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(227)	31 juill. 2023	Raisio Oyj, actions, V, swap sur rendement total	(670)	21
(13)	31 juill. 2023	Rémy Cointreau, swap sur rendement total	(2 758)	(71)
(611)	31 juill. 2023	Repsol Sa, swap sur rendement total	(11 758)	(537)
(14)	31 juill. 2023	Rheinmetall Ag, swap sur rendement total	(5 069)	63
(1)	31 juill. 2023	Robertet Sa, swap sur rendement total	(1 216)	11
(174)	31 juill. 2023	Rwe Ag, swap sur rendement total	(10 015)	(151)
(41)	31 juill. 2023	Sartorius Ag-Vorzug, swap sur rendement total	(18 769)	(658)
(4)	31 juill. 2023	Sartorius Stedim Biotech, swap sur rendement total	(1 321)	177
(7)	31 juill. 2023	Secunet Security Networks Ag, swap sur rendement total	(2 198)	(188)
(108)	31 juill. 2023	Ses, swap sur rendement total	(841)	6
(91)	31 juill. 2023	Sif Holding Nv, swap sur rendement total	(1 747)	(8)
(8)	31 juill. 2023	Signify Nv, swap sur rendement total	(296)	(17)
(273)	31 juill. 2023	Smurfit Kappa Group Plc, swap sur rendement total	(12 033)	1 197
(35)	31 juill. 2023	Sodexo Sa, swap sur rendement total	(5 096)	25
(4 524)	31 juill. 2023	Stora Enso Oyj, actions, R, swap sur rendement total	(69 393)	8 074
(17)	31 juill. 2023	Suedzucker Ag, swap sur rendement total	(401)	(3)
(694)	31 juill. 2023	Symrise Ag, swap sur rendement total	(96 203)	1 971
(31)	31 juill. 2023	Synlab Ag, swap sur rendement total	(405)	2
(260)	31 juill. 2023	Technip Energies Nv, swap sur rendement total	(7 924)	(930)
(2)	31 juill. 2023	Thales Sa, swap sur rendement total	(396)	(19)
(1 508)	31 juill. 2023	Upm-Kymmene Oyj, swap sur rendement total	(59 368)	2 317
(508)	31 juill. 2023	Verbio Vereinigte Bioenergi, swap sur rendement total	(27 025)	(2 421)
(25)	31 juill. 2023	Waga Energy Sa, swap sur rendement total	(1 039)	(104)
(41)	31 juill. 2023	Warehouses De Pauw Sca, swap sur rendement total	(1 487)	74
(50)	31 juill. 2023	Westwing Group Ag, swap sur rendement total	(621)	1
(14)	31 juill. 2023	Zeal Network Se, swap sur rendement total	(697)	(17)
				<u>9 425</u>
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
(4 000)	31 juill. 2023	China Aoyuan Group Ltd, swap sur rendement total	(797)	(66)
(1 200)	31 juill. 2023	China Zhongwang Holdings Ltd, swap sur rendement total	(340)	1
(4 000)	31 juill. 2023	Redco Properties Group Ltd, swap sur rendement total	(898)	3
				<u>(62)</u>
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
(6)	31 juill. 2023	Anglo American Platinum Ltd, swap sur rendement total	(358)	124
(4 484)	31 juill. 2023	Attacq Ltd, swap sur rendement total	(2 657)	(126)
(949)	31 juill. 2023	Blue Label Telecoms Ltd, swap sur rendement total	(232)	11
(4 723)	31 juill. 2023	Fortress Reit Ltd-A, swap sur rendement total	(4 254)	11
(73 625)	31 juill. 2023	Growthpoint Properties Ltd, swap sur rendement total	(60 132)	560
(993)	31 juill. 2023	Kap Industrial Holdings Ltd, swap sur rendement total	(188)	(32)
(451)	31 juill. 2023	Oceana Group Ltd, swap sur rendement total	(2 227)	68
(2 632)	31 juill. 2023	Pepkor Holdings Ltd, swap sur rendement total	(3 042)	(351)
(1 349)	31 juill. 2023	Redefine Properties Ltd, swap sur rendement total	(311)	(14)
(5 612)	31 juill. 2023	Resilient Reit Ltd, swap sur rendement total	(16 632)	(817)
(1 923)	31 juill. 2023	Spar Group Limited/The, swap sur rendement total	(14 143)	(417)
(2 985)	31 juill. 2023	Telkom Sa Soc Ltd, swap sur rendement total	(6 626)	(798)
(1 064)	31 juill. 2023	Truworths International Ltd, swap sur rendement total	(4 218)	(638)
(88)	31 juill. 2023	Vodacom Group Ltd, swap sur rendement total	(722)	(37)
(100)	31 juill. 2023	Wilson Bayly Holmes-Ovcon, swap sur rendement total	(732)	(61)
				<u>(2 517)</u>
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
(63)	31 juill. 2023	Afry Ab, swap sur rendement total	(1 229)	46
(15)	31 juill. 2023	Atrium Ljungberg Ab, actions, B, swap sur rendement total	(343)	(18)
(33)	31 juill. 2023	Bactiguard Holding Ab, swap sur rendement total	(289)	(4)
(118)	31 juill. 2023	Cellavision Ab, swap sur rendement total	(2 654)	296
(673)	31 juill. 2023	Eolus Vind Ab, actions, B, swap sur rendement total	(5 879)	200
(102)	31 juill. 2023	Jm Ab, swap sur rendement total	(1 796)	(159)
(336)	31 juill. 2023	K-Fast Holding Ab, swap sur rendement total	(795)	(10)
(144)	31 juill. 2023	Lime Technologies Ab, swap sur rendement total	(4 825)	141
(12)	31 juill. 2023	Nordea Bank Abp, swap sur rendement total	(172)	(12)
(727)	31 juill. 2023	Pandex Ab, swap sur rendement total	(11 186)	(1 218)
(100)	31 juill. 2023	Platzer Fastigheter Hold-B, swap sur rendement total	(979)	(39)
(313)	31 juill. 2023	Powercell Sweden Ab, swap sur rendement total	(3 219)	(219)
(538)	31 juill. 2023	Rvrc Holding Ab, swap sur rendement total	(2 190)	(84)
(504)	31 juill. 2023	Sedana Medical Ab, swap sur rendement total	(1 670)	180
(4 653)	31 juill. 2023	Sinch Ab, swap sur rendement total	(13 880)	(965)
(345)	31 juill. 2023	Viaplay Group Ab-B, swap sur rendement total	(2 612)	3 691

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(155)	31 juill. 2023	Vitrolife Ab, swap sur rendement total	(3 976)	92
(1 168)	31 juill. 2023	Wallenstam Ab, actions, B, swap sur rendement total	(5 226)	(223)
				<u>1 695</u>
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
(1 003)	31 juill. 2023	Adecco Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(43 363)	(2 952)
(84)	31 juill. 2023	Baloise Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(16 325)	1 083
(20)	31 juill. 2023	Daetwyler Holding Ag-Br, swap sur rendement total	(5 644)	971
(12)	31 juill. 2023	Dufry Ag, actions ord., swap sur rendement total	(723)	(19)
(1)	31 juill. 2023	Givaudan, actions ord., swap sur rendement total	(4 385)	(15)
(23)	31 juill. 2023	Gurit Holding Ag-Br, swap sur rendement total	(2 834)	28
(1 628)	31 juill. 2023	Idorsia Ltd, swap sur rendement total	(15 531)	2 983
(530)	31 juill. 2023	Julius Baer Group Ltd, swap sur rendement total	(44 165)	(514)
(27)	31 juill. 2023	Kuehne + Nagel Intl Ag, actions ord., swap sur rendement total	(10 571)	(200)
(74)	31 juill. 2023	Logitech International, actions ord., swap sur rendement total	(5 827)	318
(136)	31 juill. 2023	Lonza Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(107 295)	6 541
(3)	31 juill. 2023	Mobimo Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(1 069)	(17)
(109)	31 juill. 2023	Polypeptide Group Ag, swap sur rendement total	(3 026)	756
(114)	31 juill. 2023	Sgs Sa, actions ord., swap sur rendement total	(14 258)	(607)
(81)	31 juill. 2023	Sika Ag, actions ord., swap sur rendement total	(30 634)	(826)
(46)	31 juill. 2023	Softwareone Holding Ag, swap sur rendement total	(1 206)	(244)
(1 492)	31 juill. 2023	Ubs Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(39 932)	(1 434)
(90)	31 juill. 2023	Vat Group Ag, swap sur rendement total	(49 253)	677
				<u>6 529</u>
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
(2 100)	31 juill. 2023	3R Petroleum Oleo E Gas Sa, swap sur rendement total	(17 327)	(366)
(959)	31 juill. 2023	Aercap Holdings Nv, swap sur rendement total	(80 607)	(7 725)
(4 800)	31 juill. 2023	Aeris Industria E Comercio D, swap sur rendement total	(1 765)	102
(340)	31 juill. 2023	Albemarle Corp, swap sur rendement total	(100 549)	(6 963)
(1 400)	31 juill. 2023	Alpargatas Sa, actions priv., swap sur rendement total	(3 599)	227
(832)	31 juill. 2023	Alupar Investimento Sa, part, swap sur rendement total	(6 922)	(640)
(100)	31 juill. 2023	Ambipar Participacoes E Empr, swap sur rendement total	(606)	(73)
(83)	31 juill. 2023	Arlington Asset Investment-A, swap sur rendement total	(4 001)	(143)
(300)	31 juill. 2023	Armac Locacao Logistica E Se, swap sur rendement total	(1 242)	(12)
(1 063)	31 juill. 2023	Astrazeneca Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(100 671)	2 534
(1 300)	31 juill. 2023	Atacadao Sa, swap sur rendement total	(4 025)	(165)
(1 000)	31 juill. 2023	Banco Pan Sa, swap sur rendement total	(2 529)	(826)
(1 916)	31 juill. 2023	Bank Of New York Mellon Corp, swap sur rendement total	(112 874)	(7 468)
(500)	31 juill. 2023	Becle Sab De Cv, swap sur rendement total	(1 619)	(49)
(609)	31 juill. 2023	Bill.Com Holdings Inc, swap sur rendement total	(94 165)	(10 359)
(93)	31 juill. 2023	Broadcom Inc, swap sur rendement total	(106 748)	(6 722)
(841)	31 juill. 2023	Catalent Inc, swap sur rendement total	(48 253)	(6 538)
(100)	31 juill. 2023	Cia Brasileira De Distribuic, swap sur rendement total	(517)	(28)
(100)	31 juill. 2023	Cia Siderurgica Nacional Sa, swap sur rendement total	(335)	26
(2 482)	31 juill. 2023	Corning Inc, swap sur rendement total	(115 082)	(8 750)
(12 400)	31 juill. 2023	Cosan Sa Industria Comercio, swap sur rendement total	(61 216)	(11 168)
(9 000)	31 juill. 2023	Eneva Sa, swap sur rendement total	(30 524)	(3 592)
(550)	31 juill. 2023	Equitable Holdings Inc, swap sur rendement total	(19 767)	(1 811)
(2 400)	31 juill. 2023	Even Construtora E Inco Sa, swap sur rendement total	(4 518)	(515)
(1 600)	31 juill. 2023	Ez Tec Empreendimentos E Par, swap sur rendement total	(8 146)	(792)
(400)	31 juill. 2023	Gafisa Sa, swap sur rendement total	(765)	11
(200)	31 juill. 2023	Grupo De Moda Soma Sa, swap sur rendement total	(663)	(123)
(9 300)	31 juill. 2023	Grupo Mexico Sab De Cv, série B, swap sur rendement total	(59 244)	(4 329)
(11 469)	31 juill. 2023	Grupo Televisa Sa, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(77 855)	(335)
(60 900)	31 juill. 2023	Hapvida Participacoes E Inve, swap sur rendement total	(73 731)	(9 557)
(2 199)	31 juill. 2023	Hsbc Holdings Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(115 287)	(7 721)
(256)	31 juill. 2023	Hyatt Hotels Corp, cat. A, swap sur rendement total	(38 814)	(2 224)
(121)	31 juill. 2023	Idexx Laboratories Inc, swap sur rendement total	(80 414)	(5 703)
(100)	31 juill. 2023	Industrias Penoles Sab De Cv, swap sur rendement total	(1 859)	192
(13 500)	31 juill. 2023	Infracommerce Cxaas Sa, swap sur rendement total	(6 381)	(350)
(600)	31 juill. 2023	Irb Brasil Resseguros Sa, swap sur rendement total	(7 223)	(755)
(900)	31 juill. 2023	Jhsf Participacoes Sa, swap sur rendement total	(1 266)	(155)
(3 600)	31 juill. 2023	Localiza Rent A Car, swap sur rendement total	(68 164)	(9 744)
(100)	31 juill. 2023	Log Commercial Properties E, swap sur rendement total	(647)	(35)
(200)	31 juill. 2023	Log-In Logistica Intermodal, swap sur rendement total	(2 837)	(230)
(1 460)	31 juill. 2023	Lucid Group Inc, swap sur rendement total	(13 311)	(1 269)
(1 302)	31 juill. 2023	Marvell Technology Group Ltd, swap sur rendement total	(102 993)	(1 873)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Swaps sur rendement total (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(1 859)	31 juill. 2023	Match Group Inc, swap sur rendement total	(102 948)	(7 530)
(687)	31 juill. 2023	Micron Technology Inc, swap sur rendement total	(57 372)	4 800
(3 700)	31 juill. 2023	Minerva Sa, swap sur rendement total	(10 872)	(1 005)
(455)	31 juill. 2023	Moderna Inc, swap sur rendement total	(73 153)	3 977
(163)	31 juill. 2023	Mongodb Inc, swap sur rendement total	(88 646)	(14 851)
(2 700)	31 juill. 2023	Movida Participacoes Sa, swap sur rendement total	(7 859)	(614)
(900)	31 juill. 2023	Mpm Corporeos Sa, swap sur rendement total	(453)	(111)
(1 100)	31 juill. 2023	Mrv Engenharia, swap sur rendement total	(3 518)	(617)
(127 800)	31 juill. 2023	Nemak Sab De Cv, swap sur rendement total	(40 405)	(618)
(1 500)	31 juill. 2023	Omega Energia Sa, swap sur rendement total	(4 685)	(832)
(3 100)	31 juill. 2023	Operadora De Sites Mex-A-1, swap sur rendement total	(3 904)	(269)
(7 400)	31 juill. 2023	Petroreconcavo Sa, swap sur rendement total	(39 212)	(2 711)
(1 700)	31 juill. 2023	Qgep Participacoes Sa, swap sur rendement total	(6 456)	(741)
(100)	31 juill. 2023	Ser Educacional Sa, swap sur rendement total	(138)	(38)
(119)	31 juill. 2023	Shell Plc, CAAÉ, swap sur rendement total	(9 508)	(448)
(200)	31 juill. 2023	Sinqia Sa, swap sur rendement total	(1 225)	(183)
(1 608)	31 juill. 2023	Synovus Financial Corp, swap sur rendement total	(65 174)	(7 305)
(575)	31 juill. 2023	Td Synnex Corp, swap sur rendement total	(71 522)	(3 199)
(288)	31 juill. 2023	Tesla Inc, swap sur rendement total	(99 759)	(12 744)
(836)	31 juill. 2023	Trade Desk Inc/The, cat. A, swap sur rendement total	(85 424)	(5 048)
(300)	31 juill. 2023	Trisul Sa, swap sur rendement total	(467)	(87)
(720)	31 juill. 2023	Unifin Financiera Sab De Cv, swap sur rendement total	(67)	(2)
(300)	31 juill. 2023	Vamos Locacao De Caminhos M, swap sur rendement total	(1 006)	(9)
(3 600)	31 juill. 2023	Walmart De Mexico Sab De Cv, swap sur rendement total	(18 845)	(1)
(69)	31 juill. 2023	Zoetis Inc, swap sur rendement total	(15 724)	(555)
				(166 757)
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position vendeur		(162 603)
		Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total		583 640
		Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total		(372 540)
		Plus-value (moins-value) latente des swaps sur rendement total, montant net		211 100

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Il est conseillé de lire les présentes notes propres au Fonds en parallèle avec les notes annexes des états financiers, qui font partie intégrante des présents états financiers. Les présentes notes propres au Fonds peuvent faire référence aux notes annexes en indiquant le numéro de la note correspondante. Comme elles complètent les notes annexes, il n'y a pas nécessairement de note propre au Fonds correspondante pour chacune des notes annexes.

Entité publiante et objectif de placement (note 1)

Le Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L) (le « Fonds ») est une fiducie de fonds commun de placement à capital variable établie en vertu des lois de l'Ontario et est régi par une déclaration de fiducie datée du 1^{er} mai 2012 dans sa version modifiée. Le Fonds est entré en activité le 15 février 2019. L'adresse du siège social du Fonds est le 1400 – 130 King St. West, P.O. Box 240, Toronto (Ontario) Canada, M5X 1C8. Le 23 mars 2023, le Fonds a changé de nom et le Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L est devenu le Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L.

L'objectif de placement du Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L est de procurer une appréciation du capital à long terme et un rendement attrayant redressé en fonction du risque sur une longue période de temps, en investissant dans un portefeuille composé de titres et de contrats dérivés ainsi qu'en employant des stratégies d'actions longues/courtes.

Juste valeur des instruments financiers (note 5)

Classement des placements selon la hiérarchie des justes valeurs

Les tableaux ci-dessous présentent le classement des instruments financiers du Fonds évalués à la juste valeur à la date de clôture. Les montants sont établis selon les valeurs comptabilisées dans l'état de la situation financière.

Au 30 juin 2023

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	1 433 339 \$	– \$	– \$	1 433 339 \$
Actions américaines – position acheteur	4 260 240	887	–	4 261 127
Actions étrangères – position acheteur	6 526 508	46 984	–	6 573 492
Contrats de change à terme	–	191 404	–	191 404
Contrats de swap	–	583 640	–	583 640
	12 220 087 \$	822 915 \$	– \$	13 043 002 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	1 013 354 \$	2 236 \$	– \$	1 015 590 \$
Actions américaines – position vendeur	4 847 195	–	–	4 847 195
Actions étrangères – position vendeur	3 828 150	3 499	–	3 831 649
Contrats de change à terme	–	19 754	–	19 754
Contrats de swap	–	372 540	–	372 540
	9 688 699 \$	398 029 \$	– \$	10 086 728 \$

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L
(auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)
Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Au 31 décembre 2022

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	18 728 516 \$	– \$	– \$	18 728 516 \$
Actions américaines – position acheteur	2 280 807	2 101	–	2 282 908
Actions étrangères – position acheteur	1 947 689	3 875	–	1 951 564
Contrats de change à terme	–	22 253	–	22 253
Contrats de swap	–	320 991	–	320 991
	22 957 012 \$	349 220 \$	– \$	23 306 232 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	387 476 \$	2 236 \$	– \$	389 712 \$
Actions américaines – position vendeur	2 508 707	–	–	2 508 707
Actions étrangères – position vendeur	2 718 274	3 141	–	2 721 415
Contrats de change à terme	–	1 727	–	1 727
Contrats de swap	–	320 346	–	320 346
	5 614 457 \$	327 450 \$	– \$	5 941 907 \$

Il n'y a eu aucun transfert important d'actifs ou de passifs financiers entre les niveaux 1, 2 et 3 pour la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022, les changements aux parts en circulation ont été les suivants :

	Solde à l'ouverture de la période	Parts rachetables émises	Parts rachetables réinvesties	Parts rachetables rachetées	Solde à la clôture de la période
2023					
Série A	48 055	4 852	–	(8 315)	44 592
Série F	313 938	51 836	–	(275 377)	90 397
Série I	1 454 887	1 382	–	(452 230)	1 004 039
2022					
Série A	41 855	4 013	4 215	(2 028)	48 055
Série F	35 406	333 401	32 164	(87 033)	313 938
Série I	2 004 975	2 763	157 173	(710 024)	1 454 887

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2022, le Fonds disposait de pertes en capital inutilisées de néant (néant au 31 décembre 2021) pouvant être reportées indéfiniment pour réduire ses futurs gains en capital réalisés. Il ne disposait d'aucune perte autre qu'en capital inutilisée pouvant être reportée aux fins de l'impôt (néant au 31 décembre 2021).

Au cours de la période, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2022).

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

(auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Transactions avec des parties liées et autres charges (note 8)

Frais de gestion

Le Fonds paie des frais de gestion, qui sont comptabilisés quotidiennement et payés mensuellement. Les taux des frais de gestion annuels, avant taxes, sont de 2,00 % pour la série A et de 1,00 % pour la série F. Le Fonds ne paie aucuns frais de gestion pour les parts de série I. Les frais de gestion pour ces parts sont négociés et payés directement par les porteurs de parts au gestionnaire et ne peuvent pas être plus élevés que les frais de gestion des parts de série A du Fonds.

Rémunération au rendement

Le Fonds verse trimestriellement une rémunération au rendement au gestionnaire (la « rémunération au rendement »), celle-ci étant calculée et comptabilisée quotidiennement. Cette rémunération au rendement correspond à 20 % du rendement excédentaire par rapport au rendement minimal du Fonds, sous réserve d'un rendement de référence perpétuel. Le rendement minimal est de 4,00 % par année. La rémunération au rendement s'applique aux parts des séries A et F. Les porteurs de parts de série I peuvent négocier une rémunération au rendement qui sera versée directement au gestionnaire.

Parts détenues par des parties liées

Connor, Clark & Lunn Financial Group Investments Inc. (« CCLFGII ») et Groupe financier Connor, Clark & Lunn Ltée (« GFCC&L »), sociétés liées au gestionnaire du fait d'une propriété commune, détiennent des parts du Fonds. Au 30 juin 2023, CCLFGII détenait 962 154 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 10 137 832 \$ (1 412 779 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 14 387 318 \$ au 31 décembre 2022). Au 30 juin 2023, GFCC&L détenait 6 867 parts de série A, 7 036 parts de série F et 7 278 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 70 282 \$, de 73 442 \$ et de 76 685 \$ (6 867 parts de série A, 7 036 parts de série F et 7 278 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 69 052 \$, de 71 628 \$ et de 74 117 \$ au 31 décembre 2022).

Commissions de courtage et autres coûts de transactions (note 9)

Le Fonds a payé 19 681 \$ (14 488 \$ en 2022) en commissions de courtage et autres coûts de transactions relativement à des opérations de portefeuille durant la période. Les paiements indirects effectués pour la période se sont élevés à 4 039 \$ (1 831 \$ en 2022).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, en dollars canadiens. Les montants présentés sont fondés sur la juste valeur des actifs monétaires (y compris la trésorerie et les placements à court terme) et sur le capital sous-jacent des contrats de change à terme, le cas échéant.

Les tableaux indiquent également l'effet potentiel, sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, d'une fluctuation de 5 % des devises par rapport au dollar canadien, toutes les autres variables restant constantes. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L
(auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)
Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Au 30 juin 2023

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar australien	40 202	(244 868)	(204 666)	(1,7)	(10 233)
Réal brésilien	3 537	–	3 537	–	177
Livre sterling	51 192	302 817	354 009	3,0	17 700
Renminbi chinois	204	(109 845)	(109 641)	(0,9)	(5 482)
Couronne danoise	219 142	(253 992)	(34 850)	(0,3)	(1 743)
Euro	264 416	(379 684)	(115 268)	(1,0)	(5 763)
Dollar de Hong Kong	68 904	(156 529)	(87 625)	(0,7)	(4 381)
Forint hongrois	11 516	–	11 516	0,1	576
Roupie indonésienne	(7 340)	–	(7 340)	(0,1)	(367)
Nouveau shekel israélien	54 819	(205 390)	(150 571)	(1,3)	(7 529)
Yen japonais	1 377 051	(2 142 395)	(765 344)	(6,4)	(38 267)
Ringgit malaisien	273	–	273	–	14
Peso mexicain	(10 852)	–	(10 852)	(0,1)	(543)
Dollar néo-zélandais	2 258	(178 352)	(176 094)	(1,5)	(8 805)
Couronne norvégienne	79 288	(387 086)	(307 798)	(2,6)	(15 390)
Peso philippin	(2 709)	–	(2 709)	–	(135)
Zloty polonais	11 097	–	11 097	0,1	555
Dollar de Singapour	(17 217)	(332 438)	(349 655)	(2,9)	(17 483)
Rand sud-africain	11 083	(106 890)	(95 807)	(0,8)	(4 790)
Couronne suédoise	132 748	(166 121)	(33 373)	(0,3)	(1 669)
Franc suisse	52 841	(96 140)	(43 299)	(0,4)	(2 165)
Dollar américain	6 491 287	(6 221 945)	269 342	2,3	13 467
Total	8 833 740	(10 678 858)	(1 845 118)	(15,5)	(92 256)

Au 31 décembre 2022

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar australien	39 666	–	39 666	0,2	1 983
Livre sterling	60 617	84 753	145 370	0,8	7 269
Renminbi chinois	96	–	96	–	5
Couronne danoise	30 175	–	30 175	0,2	1 509
Euro	(328)	189 435	189 107	1,0	9 455
Dollar de Hong Kong	49 836	(110 758)	(60 922)	(0,3)	(3 046)
Forint hongrois	(957)	–	(957)	–	(48)
Nouveau shekel israélien	61 173	–	61 173	0,3	3 059
Yen japonais	16 291	500 945	517 236	2,8	25 862
Peso mexicain	2 123	–	2 123	–	106
Dollar néo-zélandais	18 394	–	18 394	0,1	920
Couronne norvégienne	(12 620)	–	(12 620)	(0,1)	(631)
Dollar de Singapour	12 822	–	12 822	0,1	641
Rand sud-africain	(11 619)	–	(11 619)	(0,1)	(581)
Couronne suédoise	40 458	(72 042)	(31 584)	(0,2)	(1 579)
Franc suisse	37 851	–	37 851	0,2	1 893
Dollar américain	367 862	(98 114)	269 748	1,5	13 487
Total	711 840	494 219	1 206 059	6,5	60 304

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L
(auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)
Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le risque de taux d'intérêt était négligeable, l'exposition du Fonds aux placements portant intérêt à long terme n'étant pas importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix, principalement en raison de ses placements en actions négociées sur des bourses. La quasi-totalité de l'actif net du Fonds attribuable aux porteurs de parts rachetables est exposé à l'autre risque de prix en raison de son exposition aux fluctuations du marché (ne découlant pas d'autres facteurs précités). Si les cours des actions négociées avaient augmenté ou diminué de 10 %, tous les autres facteurs demeurant inchangés, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué d'environ 257 000 \$ (1 734 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le risque de crédit était négligeable, car l'exposition du Fonds aux titres de créance n'était pas importante. Le Fonds était exposé au risque de crédit du fait de ses placements dans des instruments dérivés. Les gains latents sur les obligations contractuelles avec les contreparties correspondaient à 6,5 % (1,9 % au 31 décembre 2022) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables. Les contreparties aux instruments dérivés avaient toutes obtenu des notations de AA à AAA ou étaient non notées (résultat de la combinaison des notations attribuées par diverses agences, comme Standard & Poor's, Moody's et Dominion Bond Rating Services).

Prêt de titre (note 12)

Pour les périodes closes les 30 juin 2023 et 2022, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2023	2022
	(\$)	(\$)
Revenus bruts tirés du prêt de titres	2 305	1 422
Charges liées au prêt de titres	(459)	(281)
Revenus nets tirés du prêt de titres	1 846	1 141
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	(45)	(85)
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	1 801	1 056

Les charges liées au prêt de titres ont représenté 19,9 % (19,8 % en 2022) des revenus bruts tirés du prêt de titres, et ont été payées en totalité au dépositaire du Fonds.

Le tableau qui suit présente un aperçu des titres prêtés et des garanties détenues au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022.

	30 juin 2023	31 décembre 2022
	(en milliers de \$)	(en milliers de \$)
Titres prêtés	547	909
Garanties reçues	575	954
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L
(auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)
Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Effet de levier et emprunt (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 63,2 % à 141,6 % (de 65,4 % à 130,8 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 30 juin 2023, l'exposition totale du Fonds correspondait à 123,6 % (73,7 % au 31 décembre 2022) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur actions, de positions vendeur sur contrats de swap d'actions et des emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de 4 517 \$ à 6 661 984 \$ (de 2 518 906 \$ à 12 262 358 \$ en 2022) avec un taux d'intérêt moyen de 5,32 % (1,98 % en 2022). Au 30 juin 2023, les emprunts en trésorerie correspondaient à 0,4 % (18,3 % au 31 décembre 2022) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de la situation financière aux

	30 juin 2023 (non audité)	31 décembre 2022 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	343 238 \$	39 867 \$
Placements à court terme	1 360 404	428 412
Placements	47 227 643	50 654 800
Plus-value latente des contrats de change à terme	69 130	114 467
Plus-value latente des contrats à terme normalisés	192 380	232 781
Plus-value latente des contrats de swap	6 417	–
Plus-value latente des swaps sur défaillance de crédit	12 866	573
Marge de variation quotidienne	620 715	770 090
Montant à recevoir du courtier	600 858	69 357
Intérêts à recevoir	487 450	559 924
Autres créances	16 852	47
Souscriptions à recevoir	42 094	300
	50 980 047	52 870 618
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	308 269	526 167
Placements à court terme vendus à découvert	–	4 820 910
Placements vendus à découvert	22 504 200	19 391 897
Moins-value latente des contrats de change à terme	29 979	22 483
Moins-value latente des contrats à terme normalisés	116 860	180 575
Moins-value latente des swaps sur défaillance de crédit	5 040	218
Intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	270 867	287 527
Montant à payer au courtier	321 021	542 781
Frais d'emprunt de titres à payer	–	9 001
Charges à payer	16 106	58 002
Frais de gestion à payer	705	748
	23 573 047	25 840 309
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	27 407 000 \$	27 030 309 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de la situation financière aux

	30 juin 2023 (non audité)	31 décembre 2022 (audité)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	208 016 \$	105 001 \$
Série F	1 172 303 \$	1 630 088 \$
Série I	26 026 681 \$	25 295 220 \$
	<hr/>	<hr/>
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	26 357	13 264
Série F	142 849	199 147
Série I	3 029 619	2 959 236
	<hr/>	<hr/>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	7,89 \$	7,92 \$
Série F	8,21 \$	8,19 \$
Série I	8,59 \$	8,55 \$
	<hr/>	<hr/>

Approuvé par le gestionnaire

« *Michael Freund* »

Administrateur

« *Tim Elliott* »

Administrateur

Fonds alternatif de revenu CC&L

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2023	2022
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	(1 768) \$	(77 668) \$
Variation du gain (perte) de change latent	440	(16 779)
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	484	811
Autres revenus (pertes)	–	12 000
Gain (perte) net sur placements		
Intérêts aux fins des distributions	1 025 997	1 163 775
Charges d'intérêts sur les titres vendus à découvert	(496 106)	(459 772)
Gain (perte) net réalisé sur les placements	(529 248)	(2 771 971)
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	(115 587)	1 258 978
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	311 021	67 665
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	223 914	(164 099)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	(20 307)	(437 918)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	332 549	(4 045 641)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	(71 497)	2 893 113
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	(52 833)	(195 833)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats à terme normalisés	23 314	(4 867)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	13 888	59 259
Gain (perte) net total sur placements	<u>645 105</u>	<u>(2 637 311)</u>
Total des revenus (pertes) nets	<u>644 261</u>	<u>(2 718 947)</u>
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	8 006	13 191
Honoraires des dépositaires	27 754	38 325
Frais de dépôt	12 276	22 251
Honoraires du comité d'examen indépendant	2 232	2 480
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	–	321
Charges d'intérêts	173	2 116
Frais de gestion	5 042	7 844
Coût d'emprunt de titres	32 651	49 552
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	7 002	5 803
Coûts d'opérations (note 9)	6 260	4 453
Total des charges d'exploitation	<u>101 396</u>	<u>146 336</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>542 865 \$</u>	<u>(2 865 283) \$</u>

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2023	2022
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	189 \$	(8 862) \$
Série F	31 749 \$	(242 046) \$
Série I	510 927 \$	(2 614 375) \$
	<hr/>	<hr/>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	17 675	11 084
Série F	191 203	311 871
Série I	2 992 346	3 355 634
	<hr/>	<hr/>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	0,01 \$	(0,80) \$
Série F	0,17 \$	(0,78) \$
Série I	0,17 \$	(0,78) \$
	<hr/>	<hr/>

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série A 2023	Série A 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	105 001 \$	99 388 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	189	(8 862)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	114 375	26 000
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	1 213	1 304
Rachat de parts rachetables	(10 449)	(11 089)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	105 139	16 215
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(2 313)	(1 498)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(2 313)	(1 498)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	103 015	5 855
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	208 016 \$	105 243 \$
	Série F 2023	Série F 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	1 630 088 \$	2 781 622 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	31 749	(242 046)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	23 515	557 871
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	13 363	34 881
Rachat de parts rachetables	(502 812)	(214 978)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(465 934)	377 774
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(23 600)	(43 113)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(23 600)	(43 113)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(457 785)	92 615
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	1 172 303 \$	2 874 237 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série I 2023	Série I 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	25 295 220 \$	33 901 148 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	510 927	(2 614 375)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	251 210	259 322
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	388 891	472 889
Rachat de parts rachetables	(30 676)	(8 313 618)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	609 425	(7 581 407)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(388 891)	(472 889)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(388 891)	(472 889)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	731 461	(10 668 671)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	26 026 681 \$	23 232 477 \$
	Total 2023	Total 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	27 030 309 \$	36 782 158 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	542 865	(2 865 283)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	389 100	843 193
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	403 467	509 074
Rachat de parts rachetables	(543 937)	(8 539 685)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	248 630	(7 187 418)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(414 804)	(517 500)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(414 804)	(517 500)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	376 691	(10 570 201)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	27 407 000 \$	26 211 957 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2023	2022
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	542 865 \$	(2 865 283) \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	(440)	16 779
(Gain) perte net réalisé sur les placements	529 248	2 771 971
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	115 587	(1 258 978)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	(332 549)	4 045 641
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	71 497	(2 893 113)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	52 833	195 833
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats à terme normalisés	(23 314)	4 867
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	(13 888)	(59 259)
Achat de placements	(185 949 248)	(310 013 135)
Produit des placements vendus	185 598 762	317 538 805
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	149 375	(234 689)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	72 474	62 349
(Augmentation) diminution des autres créances	(16 805)	(453)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	(9 001)	6 952
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	(16 660)	123 881
Augmentation (diminution) des charges à payer	(41 896)	(1 947)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(43)	868
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	-	(4 408)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	728 797	7 436 681
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	347 306	851 842
Rachat de parts rachetables**	(543 937)	(8 395 094)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des réinvestissements	(11 337)	(8 426)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(207 968)	(7 551 678)
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	520 829	(114 997)
Variation du gain (perte) de change latent	440	(16 779)
Trésorerie, à l'ouverture de la période	39 867	852 931
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	(526 167)	(665 817)
	34 969	55 338
Trésorerie, à la clôture de la période	343 238 \$	1 082 553 \$
Dette bancaire, à la clôture de la période	(308 269) \$	(1 027 215) \$
	34 969 \$	55 338 \$
Intérêts reçus*	1 098 471 \$	1 226 124 \$
Intérêts payés*	512 939	338 007

* Inclus dans les activités d'exploitation.

** Déduction faite d'échanges hors trésorerie de néant (1 051 \$ en 2022)

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats de change à terme (Annexe 1) (non audité)

Au 30 juin 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Placements à court terme – position acheteur						
Bons du Trésor du Canada (31 décembre 2022 : 1,58 %)						
Bons du Trésor du Canada	4,846	17 août 2023	630 000	625 716	626 065	
Bons du Trésor du Canada*	4,892	31 août 2023	237 000	234 361	235 074	
Bons du Trésor du Canada	4,929	28 sept. 2023	475 000	469 279	469 320	
Province de Québec	5,588	14 juill. 2023	30 000	29 706	29 945	
				<u>1 359 062</u>	<u>1 360 404</u>	4,96
Total des placements à court terme – position acheteur				<u>1 359 062</u>	<u>1 360 404</u>	4,96
Placements à court terme – position vendeur						
Bons du Trésor du Canada (31 décembre 2022 : -17,84 %)						
Obligations – position acheteur						
Obligations fédérales canadiennes (31 décembre 2022 : 16,20 %)						
Obligations du gouvernement du Canada	1,500	1 ^{er} sept. 2024	379 000	366 764	364 649	
Obligations du gouvernement du Canada	3,750	1 ^{er} fév. 2025	1 096 000	1 095 470	1 079 927	
Obligations du gouvernement du Canada	3,750	1 ^{er} mai 2025	3 863 000	3 827 789	3 807 297	
Obligations du gouvernement du Canada	2,500	1 ^{er} déc. 2032	131 000	123 232	122 752	
Obligations du gouvernement du Canada	2,750	1 ^{er} juin 2033	698 000	661 006	668 076	
Obligations du gouvernement du Canada	2,000	1 ^{er} déc. 2051	102 000	77 738	80 758	
Obligations du gouvernement du Canada	1,750	1 ^{er} déc. 2053	1 214 000	901 040	896 006	
Obligations du gouvernement du Canada	2,750	1 ^{er} déc. 2064	310 000	352 114	285 047	
				<u>7 405 153</u>	<u>7 304 512</u>	26,65
Obligations provinciales canadiennes (31 décembre 2022 : 5,60 %)						
Province de l'Alberta	3,100	1 ^{er} juin 2050	855 000	1 002 952	714 847	
Province d'Ontario	2,900	2 juin 2028	139 000	134 796	132 157	
				<u>1 137 748</u>	<u>847 004</u>	3,09
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2022 : 46,55 %)						
Allied Properties REIT	1,726	12 fév. 2026	5 000	4 462	4 466	
AltaLink LP	1,509	11 sept. 2030	55 000	45 997	44 948	
ARC Resources Ltd.	2,354	10 mars 2026	138 000	127 955	127 096	
ARC Resources Ltd.	3,465	10 mars 2031	122 000	108 094	107 137	
Banque de Montréal	1,551	28 mai 2026	37 000	33 266	33 320	
Banque de Montréal	3,650	1 ^{er} avril 2027	306 000	295 731	289 617	
Banque de Montréal	2,077	17 juin 2030	359 000	331 116	333 604	
La Banque de Nouvelle-Écosse	5,679	2 août 2033	32 000	31 996	31 888	
Baytex Energy Corp.	8,750	1 ^{er} avril 2027	453 000	617 195	607 667	
Brookfield Renewable Partners ULC	3,380	15 janv. 2030	95 000	86 649	85 809	
Brookfield Renewable Partners ULC	5,292	28 oct. 2033	153 000	152 995	152 641	
CAE inc.	5,541	12 juin 2028	55 000	55 000	55 133	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2,750	7 mars 2025	383 000	370 996	365 575	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2,010	21 juill. 2030	451 000	412 879	417 208	
FPI Propriétés de Choix	2,848	21 mai 2027	8 000	7 304	7 305	
FPI Propriétés de Choix	4,178	8 mars 2028	41 000	38 705	38 929	
FPI Propriétés de Choix	2,981	4 mars 2030	205 000	178 008	177 571	
Fiducie de placement immobilier industriel Dream	3,968	13 avril 2026	54 000	51 844	51 320	
Société en commandite Sommet Industriel Dream	2,250	12 janv. 2027	40 000	35 567	35 567	
Emera Inc.	6,750	15 juin 2076	505 000	658 605	648 678	
Enbridge Gas Inc.	2,880	22 nov. 2027	88 000	82 143	81 628	
Enbridge Gas Inc.	2,900	1 ^{er} avril 2030	16 000	14 609	14 449	
Enbridge Gas Inc.	4,150	17 août 2032	3 000	2 990	2 893	
Enbridge Inc.	5,375	27 sept. 2077	91 000	85 030	83 461	
Enbridge Inc.	6,625	12 avril 2078	17 000	16 768	16 425	
Enbridge Inc.	5,000	19 janv. 2082	65 000	55 941	54 292	
Great-West Lifeco Inc.	3,337	28 fév. 2028	53 000	49 954	49 493	
Great-West Lifeco Inc.	6,670	21 mars 2033	130 000	147 194	145 471	
iA Société financière inc.	5,685	20 juin 2033	33 000	33 000	33 076	
Intact Corporation financière	3,691	24 mars 2025	150 000	152 955	145 672	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats de change à terme (Annexe 1) (non audité)

Au 30 juin 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Intact Corporation financière	2,850	7 juin 2027	84 000	89 051	77 609	
Inter Pipeline Ltd.	5,760	17 fév. 2028	814 000	822 453	817 798	
Inter Pipeline Ltd.	5,849	18 mai 2032	116 000	119 486	116 033	
Inter Pipeline Ltd.	6,380	17 fév. 2033	98 000	101 620	101 308	
Keyera Corp.	6,875	13 juin 2079	14 000	13 195	13 143	
Keyera Corp.	5,950	10 mars 2081	103 000	89 739	88 940	
Société Financière Manuvie	5,409	10 mars 2033	25 000	24 813	24 802	
Banque Nationale du Canada	2,580	3 fév. 2025	170 000	164 486	162 177	
Banque Nationale du Canada	5,296	3 nov. 2025	726 000	730 043	723 292	
Banque Nationale du Canada	5,219	14 juin 2028	250 000	250 000	250 289	
Banque Nationale du Canada	5,426	16 août 2032	486 000	481 297	478 429	
Nova Scotia Power Inc.	4,951	15 nov. 2032	369 000	370 347	365 399	
Nova Scotia Power Inc.	3,307	25 avril 2050	57 000	41 365	42 099	
Nova Scotia Power Inc.	5,355	24 mars 2053	91 000	92 570	94 162	
Pembina Pipeline Corp.	4,800	25 janv. 2081	290 000	241 710	236 846	
Primaris REIT	5,934	29 mars 2028	14 000	13 774	13 786	
FPI RioCan	5,962	1 ^{er} oct. 2029	335 000	334 886	336 381	
Rogers Communications Inc.	4,400	2 nov. 2028	314 000	299 477	300 399	
Rogers Communications Inc.	3,300	10 déc. 2029	232 000	202 439	206 375	
Rogers Communications Inc.	5,000	17 déc. 2081	192 000	192 000	174 646	
Banque Royale du Canada	5,341	23 juin 2026	167 000	167 000	167 226	
Banque Royale du Canada	5,235	2 nov. 2026	394 000	394 051	393 953	
Banque Royale du Canada	2,088	30 juin 2030	287 000	269 045	266 656	
Banque Royale du Canada	5,010	1 ^{er} fév. 2033	164 000	164 116	159 122	
Saputo inc.	5,250	29 nov. 2029	204 000	212 060	205 658	
Financière Sun Life inc.	5,500	4 juill. 2035	90 000	89 907	90 370	
La Banque Toronto-Dominion	2,667	9 sept. 2025	926 000	881 702	873 256	
La Banque Toronto-Dominion	2,260	7 janv. 2027	218 000	202 311	197 538	
La Banque Toronto-Dominion	3,105	22 avril 2030	466 000	440 415	443 339	
La Banque Toronto-Dominion	3,060	26 janv. 2032	2 000	1 763	1 826	
Transcanada Trust	4,650	18 mai 2077	253 000	246 914	225 293	
Transcanada Trust	4,200	4 mars 2081	135 000	110 084	108 010	
Vidéotron ltée	5,125	15 avril 2027	1 097 000	1 376 308	1 393 024	
				13 515 375	13 391 523	48,86
Obligations de sociétés américaines (31 décembre 2022 : 112,77 %)						
American Axle & Manufacturing Inc.	6,875	1 ^{er} juill. 2028	353 000	429 961	437 298	
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC	3,250	1 ^{er} sept. 2028	659 000	761 722	750 119	
AT&T Inc.	2,300	1 ^{er} juin 2027	367 000	437 883	436 850	
AT&T Inc.	1,650	1 ^{er} fév. 2028	541 000	611 966	615 688	
AT&T Inc.	2,250	1 ^{er} fév. 2032	404 000	438 761	424 811	
AT&T Inc.	2,550	1 ^{er} déc. 2033	125 000	150 326	129 987	
AT&T Inc.	3,650	1 ^{er} juin 2051	259 000	293 970	251 431	
AT&T Inc.	3,300	1 ^{er} fév. 2052	235 000	235 975	217 341	
AT&T Inc.	3,550	15 sept. 2055	111 000	102 607	102 792	
Ball Corp.	2,875	15 août 2030	190 000	203 814	208 529	
Cable One Inc.	4,000	15 nov. 2030	984 000	1 083 246	1 018 472	
CCO Holdings LLC	5,000	1 ^{er} fév. 2028	277 000	321 120	334 353	
Centene Corp.	2,500	1 ^{er} mars 2031	134 000	140 916	141 579	
Charter Communications Operating LLC	5,050	30 mars 2029	9 000	11 368	11 365	
Charter Communications Operating LLC	2,300	1 ^{er} fév. 2032	405 000	405 329	405 806	
CHS/Community Health Systems Inc.	8,000	15 mars 2026	406 000	524 057	522 916	
CHS/Community Health Systems Inc.	5,625	15 mars 2027	15 000	17 357	17 511	
CHS/Community Health Systems Inc.	5,250	15 mai 2030	126 000	134 037	131 507	
Cinemark USA Inc.	5,875	15 mars 2026	63 000	77 455	79 173	
Civitas Resources Inc.	8,375	1 ^{er} juill. 2028	647 000	855 195	866 008	
Civitas Resources Inc.	8,750	1 ^{er} juill. 2031	101 000	133 001	135 687	
Cleveland-Cliffs Inc.	6,750	15 avril 2030	401 000	530 705	511 924	
Comcast Corp.	2,350	15 janv. 2027	512 000	618 676	622 221	
CSC Holdings LLC	5,500	15 avril 2027	233 000	262 667	256 987	
CSC Holdings LLC	5,375	1 ^{er} fév. 2028	227 000	286 529	241 840	
CSC Holdings LLC	11,250	15 mai 2028	99 000	128 378	127 191	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats de change à terme (Annexe 1) (non audité)

Au 30 juin 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
CSC Holdings LLC	6,500	1 ^{er} fév. 2029	90 000	111 325	96 410	
Ford Motor Co.	3,250	12 fév. 2032	153 000	160 643	159 438	
Ford Motor Credit Co LLC	4,063	1 ^{er} nov. 2024	498 000	590 428	638 253	
Ford Motor Credit Co LLC	4,271	9 janv. 2027	158 000	195 313	193 439	
Ford Motor Credit Co LLC	2,900	10 fév. 2029	21 000	22 205	23 020	
Frontier Communications Holdings LLC	6,750	1 ^{er} mai 2029	163 000	176 288	167 481	
Frontier Communications Holdings LLC	5,875	1 ^{er} nov. 2029	43 000	43 421	41 594	
GLP Capital LP	5,300	15 janv. 2029	9 000	11 834	11 352	
GLP Capital LP	4,000	15 janv. 2030	434 000	502 613	498 195	
Gray Television Inc.	7,000	15 mai 2027	293 000	330 815	330 232	
HCA Inc.	4,125	15 juin 2029	582 000	706 128	712 637	
Hertz Corp.	5,000	1 ^{er} déc. 2029	281 000	307 934	307 786	
Kraft Heinz Foods Co.	3,875	15 mai 2027	770 000	1 015 051	978 609	
Kraft Heinz Foods Co.	4,875	1 ^{er} oct. 2049	575 000	697 908	694 014	
Level 3 Financing Inc.	3,400	1 ^{er} mars 2027	239 000	277 385	268 529	
Lions Gate Capital Holdings LLC	5,500	15 avril 2029	209 000	229 674	200 601	
Molina Healthcare Inc.	3,875	15 nov. 2030	187 000	219 114	212 497	
Molina Healthcare Inc.	3,875	15 mai 2032	204 000	238 980	226 710	
Ovintiv Inc.	6,250	15 juill. 2033	557 000	736 811	727 224	
Owens-Brockway Glass Container Inc.	6,375	15 août 2025	192 000	255 484	255 009	
Owens-Brockway Glass Container Inc.	7,250	15 mai 2031	613 000	832 824	822 300	
Pacific Gas and Electric Co.	6,100	15 janv. 2029	26 000	35 105	33 870	
Pacific Gas and Electric Co.	4,550	1 ^{er} juill. 2030	7 000	8 796	8 384	
Pacific Gas and Electric Co.	5,900	15 juin 2032	283 000	374 139	360 591	
Pacific Gas and Electric Co.	6,150	15 janv. 2033	129 000	179 190	166 830	
Penn Entertainment Inc.	4,125	1 ^{er} juill. 2029	177 000	195 720	192 266	
Performance Food Group Inc.	4,250	1 ^{er} août 2029	600 000	712 393	707 778	
Premier Entertainment Sub LLC	5,625	1 ^{er} sept. 2029	102 000	100 336	102 366	
Sinclair Television Group Inc.	4,125	1 ^{er} déc. 2030	222 000	195 601	192 677	
SM Energy Co.	6,500	15 juill. 2028	112 000	144 625	142 422	
Sprint Capital Corp.	6,875	15 nov. 2028	356 000	517 135	500 080	
Sprint Capital Corp.	8,750	15 mars 2032	420 000	673 835	672 376	
Sysco Corp.	3,300	15 juill. 2026	116 000	145 243	145 012	
Sysco Corp.	3,250	15 juill. 2027	861 000	1 070 828	1 064 151	
Sysco Corp.	5,950	1 ^{er} avril 2030	414 000	590 982	573 682	
Tenet Healthcare Corp.	6,125	15 juin 2030	56 000	73 475	72 454	
United Rentals North America Inc.	5,250	15 janv. 2030	194 000	249 953	245 291	
United Rentals North America Inc.	3,875	15 fév. 2031	329 000	385 385	377 278	
United States Treasury Bond	3,500	15 fév. 2033	49 000	65 486	63 137	
Verizon Communications Inc.	2,550	21 mars 2031	1 442 000	1 719 771	1 592 505	
VMware Inc.	1,800	15 août 2028	1 209 000	1 442 189	1 341 271	
VMware Inc.	2,200	15 août 2031	225 000	238 815	234 021	
				25 978 201	25 353 158	92,51
Obligations étrangères (31 décembre 2022 : 6,28 %)						
NXP BV / NXP Funding LLC	4,400	1 ^{er} juin 2027	259 000	338 088	331 446	1,21
Total des obligations – position acheteur				48 374 565	47 227 643	172,32
Obligations – position vendeur						
Obligations fédérales canadiennes (31 décembre 2022 : -6,19 %)						
Obligations du gouvernement du Canada	0,250	1 ^{er} mars 2026	(39 000)	(35 092)	(35 145)	
Obligations du gouvernement du Canada	1,250	1 ^{er} mars 2027	(8 000)	(7 306)	(7 292)	
Obligations du gouvernement du Canada	1,000	1 ^{er} juin 2027	(617 000)	(565 583)	(557 231)	
Obligations du gouvernement du Canada	2,750	1 ^{er} sept. 2027	(106 000)	(102 202)	(101 871)	
Obligations du gouvernement du Canada	3,500	1 ^{er} mars 2028	(3 504 000)	(3 559 879)	(3 477 321)	
Obligations du gouvernement du Canada	2,000	1 ^{er} juin 2028	(41 000)	(38 618)	(38 220)	
Obligations du gouvernement du Canada	2,250	1 ^{er} juin 2029	(673 000)	(632 503)	(631 916)	
Obligations du gouvernement du Canada	1,250	1 ^{er} juin 2030	(269 000)	(237 895)	(233 943)	
Obligations du gouvernement du Canada	0,500	1 ^{er} déc. 2030	(237 000)	(193 896)	(192 837)	
Obligations du gouvernement du Canada	1,500	1 ^{er} déc. 2031	(35 000)	(31 658)	(30 351)	
				(5 404 632)	(5 306 127)	(19,36)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats de change à terme (Annexe 1) (non audité)

Au 30 juin 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Obligations provinciales canadiennes (31 décembre 2022 : -12,96 %)						
Province d'Ontario	3,750	2 déc. 2053	(2 146 000)	(2 046 804)	(2 057 789)	
Province de Québec	3,100	1 ^{er} déc. 2051	(539 000)	(603 339)	(456 569)	
Province de Québec	2 850	1 ^{er} déc. 2053	(143 000)	(109 262)	(114 604)	
Province de Québec	4,400	1 ^{er} déc. 2055	(96 000)	(101 632)	(103 623)	
				(2 861 037)	(2 732 585)	(9,97)
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2022 : -14,86 %)						
407 International Inc.	2,840	7 mars 2050	(91 000)	(65 183)	(66 382)	
Aéroports de Montréal	3,441	26 avril 2051	(49 000)	(39 111)	(40 404)	
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada	2,200	29 mai 2028	(42 000)	(36 989)	(36 998)	
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada	5,150	9 fév. 2053	(131 000)	(124 126)	(129 040)	
Brookfield Renewable Partners ULC	4,250	15 janv. 2029	(27 000)	(25 742)	(25 795)	
Autorité aéroportuaire de Calgary	3,554	7 oct. 2053	(366 000)	(303 517)	(303 454)	
Capital Power Corp.	3,147	1 ^{er} oct. 2032	(556 000)	(539 627)	(461 338)	
FPI Propriétés de Choix	5,400	1 ^{er} mars 2033	(137 000)	(137 038)	(136 651)	
Enbridge Gas Inc	4,950	22 nov. 2050	(94 000)	(99 088)	(97 931)	
Enbridge Inc.	4,100	21 sept. 2051	(44 000)	(35 209)	(35 139)	
Pipelines Enbridge Inc.	4,200	12 mai 2051	(102 000)	(83 684)	(83 872)	
EPCOR Utilities Inc.	4,725	2 sept. 2052	(21 000)	(21 257)	(21 324)	
Great-West Lifeco Inc.	2,981	8 juill. 2050	(230 000)	(201 512)	(168 661)	
Hydro One Inc.	4,460	27 janv. 2053	(53 000)	(51 017)	(52 114)	
Intact Corporation financière	3,765	20 mai 2053	(432 000)	(330 821)	(363 460)	
Inter Pipeline Ltd.	5,091	27 nov. 2051	(379 000)	(305 974)	(331 577)	
Les Compagnies Loblaw ltée	2,284	7 mai 2030	(484 000)	(473 550)	(411 732)	
Les Compagnies Loblaw ltée	5,336	13 sept. 2052	(158 000)	(172 002)	(165 397)	
Ontario Power Generation Inc.	3,651	13 sept. 2050	(462 000)	(470 598)	(381 744)	
Taseko Mines Ltd.	7,000	15 fév. 2026	(65 000)	(81 275)	(78 508)	
Toronto Hydro Corp.	4,950	13 oct. 2052	(232 000)	(238 132)	(247 530)	
TransCanada PipeLines Ltd.	5,920	12 mai 2052	(148 000)	(145 834)	(156 619)	
				(3 981 286)	(3 795 670)	(13,85)
Obligations américaines (31 décembre 2022 : -37,73 %)						
Allison Transmission Inc.	5,875	1 ^{er} juin 2029	(574 000)	(728 437)	(734 581)	
Allison Transmission Inc.	3,750	30 janv. 2031	(168 000)	(192 612)	(187 994)	
American Airlines Inc.	5,750	20 avril 2029	(721 000)	(932 426)	(927 361)	
Asbury Automotive Group Inc.	4,625	15 nov. 2029	(404 000)	(449 762)	(475 127)	
Asbury Automotive Group Inc.	5,000	15 fév. 2032	(208 000)	(232 082)	(239 917)	
Avis Budget Car Rental LLC	4,750	1 ^{er} avril 2028	(448 000)	(536 296)	(536 229)	
Bloomin' Brands Inc.	5,125	15 avril 2029	(120 000)	(137 646)	(141 550)	
Century Communities Inc.	3,875	15 août 2029	(167 000)	(181 838)	(191 834)	
Charter Communications Operating LLC	2,250	15 janv. 2029	(26 000)	(29 173)	(28 517)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	5,125	15 août 2027	(206 000)	(250 340)	(245 963)	
CNX Resources Corp.	7,375	15 janv. 2031	(388 000)	(501 359)	(500 109)	
Comcast Corp.	2,887	1 ^{er} nov. 2051	(231 000)	(213 742)	(204 790)	
Conagra Brands Inc.	5,400	1 ^{er} nov. 2048	(22 000)	(32 573)	(27 744)	
DaVita Inc.	4,625	1 ^{er} juin 2030	(332 000)	(387 882)	(377 555)	
DaVita Inc.	3,750	15 fév. 2031	(216 000)	(234 345)	(228 849)	
Dell International LLC	3,450	15 déc. 2051	(140 000)	(121 175)	(124 241)	
Encompass Health Corp.	4,750	1 ^{er} fév. 2030	(33 000)	(41 508)	(39 805)	
General Motors Co.	5,400	1 ^{er} avril 2048	(39 000)	(47 464)	(44 347)	
General Motors Co.	5,950	1 ^{er} avril 2049	(121 000)	(145 164)	(149 566)	
Goodyear Tire & Rubber Co.	5,625	30 avril 2033	(190 000)	(216 256)	(218 694)	
Hewlett Packard Enterprise Co.	6,350	15 oct. 2045	(77 000)	(110 070)	(106 353)	
HP Inc.	6,000	15 sept. 2041	(216 000)	(287 879)	(288 862)	
iHeartCommunications Inc.	4,750	15 janv. 2028	(306 000)	(329 939)	(305 809)	
KB Home	7,250	15 juill. 2030	(92 000)	(118 014)	(123 427)	
KB Home	4,000	15 juin 2031	(200 000)	(212 424)	(228 491)	
LGI Homes Inc.	4,000	15 juill. 2029	(119 000)	(117 479)	(131 137)	
Lithia Motors Inc.	4,375	15 janv. 2031	(222 000)	(257 481)	(253 880)	
Matador Resources Co.	6,875	15 avril 2028	(995 000)	(1 328 061)	(1 298 735)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats de change à terme (Annexe 1) (non audité)

Au 30 juin 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Meritage Homes Corp.	3,875	15 avril 2029	(59 000)	(68 358)	(69 047)	
Outfront Media Capital LLC	4,625	15 mars 2030	(134 000)	(152 014)	(127 926)	
Scripps Escrow II Inc.	3,875	15 janv. 2029	(113 000)	(121 101)	(120 880)	
Select Medical Corp.	6,250	15 août 2026	(277 000)	(364 067)	(360 677)	
Sonic Automotive Inc.	4,875	15 nov. 2031	(141 000)	(152 824)	(153 303)	
Taylor Morrison Communities Inc.	5,125	1 ^{er} août 2030	(178 000)	(222 077)	(217 727)	
Tenet Healthcare Corp.	4,875	1 ^{er} janv. 2026	(459 000)	(596 679)	(592 146)	
Tenet Healthcare Corp.	6,125	1 ^{er} oct. 2028	(115 000)	(147 717)	(146 643)	
United Airlines Inc.	4,625	15 avril 2029	(150 000)	(180 083)	(181 038)	
Obligations du Trésor des États-Unis	3,875	15 fév. 2043	(128 000)	(175 675)	(164 902)	
Obligations du Trésor des États-Unis	3,625	15 fév. 2053	(84 100)	(107 739)	(106 659)	
Verizon Communications Inc.	3,550	22 mars 2051	(38 000)	(38 652)	(37 403)	
				(10 700 413)	(10 669 818)	(38,93)
Total des obligations – position vendeur				(22 947 368)	(22 504 200)	(82,11)
Total des placements				26 786 259	26 083 847	95,17
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)					69 130	0,25
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)					(29 979)	(0,11)
Total de la plus-value latente des contrats à terme normalisés (Annexe 2)					192 380	0,70
Total de la moins-value latente des contrats à terme normalisés (Annexe 2)					(116 860)	(0,43)
Total de la plus-value latente des swaps sur défaillance de crédit (Annexe 3)					12 866	0,05
Total de la moins-value latente des swaps sur défaillance de crédit (Annexe 3)					(5 040)	(0,02)
Total de la plus-value latente des contrats de swap de taux d'intérêt (Annexe 4)					6 417	0,02
Autres actifs, moins les passifs					1 194 239	4,37
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables					27 407 000	100,00

* Titres donnés en garantie pour les dérivés détenus par le Fonds.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats de change à terme (Annexe 1) (non audité)

Au 30 juin 2023

Contrepartie*	Code de devise	Montant vendu	Code de devise	Montant acheté	Date d'échéance	Plus-value (moins-value) latente \$
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(312 368)	USD	237 000	20 sept. 2023	830
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(115 527)	USD	88 000	20 sept. 2023	761
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(27 591)	USD	21 000	20 sept. 2023	159
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(62 000)	CAD	81 938	20 sept. 2023	2
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(7 000)	CAD	9 251	20 sept. 2023	–
Banque Royale du Canada	CAD	(113 204)	USD	86 000	20 sept. 2023	444
Banque Royale du Canada	USD	(8 827 457)	CAD	11 732 574	20 sept. 2023	65 929
La Banque Toronto-Dominion	USD	(671 000)	CAD	887 703	20 sept. 2023	934
La Banque Toronto-Dominion	USD	(53 000)	CAD	70 113	20 sept. 2023	71
						69 130
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(21 166)	USD	16 000	20 sept. 2023	(21)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(239 445)	USD	181 000	20 sept. 2023	(242)
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(66 000)	CAD	86 988	20 sept. 2023	(231)
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(65 000)	CAD	85 332	20 sept. 2023	(562)
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(148 000)	CAD	194 453	20 sept. 2023	(1 124)
Banque Royale du Canada	CAD	(27 898)	USD	21 000	20 sept. 2023	(144)
Banque Royale du Canada	CAD	(31 883)	USD	24 000	20 sept. 2023	(164)
Banque Royale du Canada	CAD	(254 352)	USD	191 000	20 sept. 2023	(1 915)
Banque Royale du Canada	CAD	(439 456)	USD	330 000	20 sept. 2023	(3 308)
Banque Royale du Canada	CAD	(1 811 253)	USD	1 362 767	20 sept. 2023	(10 178)
Banque Royale du Canada	CAD	(2 073 078)	USD	1 559 761	20 sept. 2023	(11 648)
Banque Royale du Canada	USD	(15 000)	CAD	19 744	20 sept. 2023	(78)
Banque Royale du Canada	USD	(116 000)	CAD	153 159	20 sept. 2023	(139)
Banque Royale du Canada	USD	(33 000)	CAD	43 384	20 sept. 2023	(225)
						(29 979)
						39 151

* Toutes les contreparties ont une notation de AA ou mieux.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats à terme normalisés (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2023

Description	Date d'échéance	Nombre de contrats	Juste valeur \$	Plus-value (moins-value) latente \$
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 5 ans	20 sept. 2023	(96)	(10 574 400)	119 327
Contrats à terme normalisés sur bons du Trésor américain à 5 ans, CBOT	29 sept. 2023	(16)	(2 267 389)	42 013
Contrats à terme normalisés sur bons du Trésor américain à 10 ans, CBOT	20 sept. 2023	(8)	(1 188 444)	19 338
Contrats à terme normalisés sur obligations, CBOT Ultra	20 sept. 2023	5	901 257	10 502
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 2 ans, MTL	20 sept. 2023	48	4 911 600	1 200
			(8 217 376)	192 380
Contrats à terme normalisés sur obligations, CBOT Ultra	20 sept. 2023	2	360 503	(2 952)
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 10 ans, MTL	20 sept. 2023	17	2 083 010	(11 730)
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 2 ans, MTL	20 sept. 2023	120	12 279 000	(102 178)
			14 722 513	(116 860)
			6 505 137	75 520

Fonds alternatif de revenu CC&L

Swaps sur défaillance de crédit (contrats sur indice) (Annexe 3) (non audité)

Au 30 juin 2023

Description	Date d'entrée en vigueur	Date d'expiration	Notionel	Juste valeur \$	Plus-value (moins-valeur) latente \$
CDX.NA.HY.40 5 %	17 mai 2023	20 juin 2028	152 000 USD	5 937	4 706
CDX.NA.HY.40 5 %	28 avril 2023	20 juin 2028	68 000 USD	2 656	1 200
CDX.NA.HY.40 5 %	28 juin 2023	20 juin 2028	452 000 USD	17 655	6 960
				26 248	12 866
CDX.NA.HY.40 5 %	8 juin 2023	20 juin 2028	151 000 USD	5 898	(784)
CDX.NA.HY.40 5 %	19 juin 2023	20 juin 2028	395 000 USD	15 429	(4 256)
				21 327	(5 040)
				47 575	7 826

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats de swap de taux d'intérêt (Annexe 4) (non audité)

Au 30 juin 2023

Notionnel	Date d'échéance	Description	Plus-value (moins-value) latente \$
Contrepartie : Banque Royale du Canada, notation AAA			
Dollar canadien – Canadian Dollar Offered Rate (CDOR) à 3 mois			
369 018	28 juin 2053	Swap de taux d'intérêt en CAD payeur taux variable / receveur taux fixe à 3,3138 %	6 417
			6 417
Plus-value (moins-value) latente nette des swaps de taux d'intérêt			6 417

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Il est conseillé de lire les présentes notes propres au Fonds en parallèle avec les notes annexes des états financiers, qui font partie intégrante des présents états financiers. Les présentes notes propres au Fonds peuvent faire référence aux notes annexes en indiquant le numéro de la note correspondante. Comme elles complètent les notes annexes, il n'y a pas nécessairement de note propre au Fonds correspondante pour chacune des notes annexes.

Entité publiante et objectif de placement (note 1)

Le Fonds alternatif de revenu CC&L (le « Fonds ») est une fiducie de fonds commun de placement à capital variable établie en vertu des lois de l'Ontario et est régi par une déclaration de fiducie datée du 1^{er} mai 2012 dans sa version modifiée. Le Fonds est entré en activité le 15 février 2019. L'adresse du siège social du Fonds est le 1400 – 130 King St. West, P.O. Box 240, Toronto (Ontario) Canada, M5X 1C8.

L'objectif de placement du Fonds est de gérer activement un portefeuille diversifié constitué principalement de titres à revenu fixe mondiaux en prenant des positions acheteur et vendeur au moment opportun, en vue de maximiser le rendement total à long terme.

Juste valeur des instruments financiers (note 5)

Classement des placements selon la hiérarchie des justes valeurs

Les tableaux ci-dessous présentent le classement des instruments financiers du Fonds évalués à la juste valeur à la date de clôture. Les montants sont établis selon les valeurs comptabilisées dans l'état de la situation financière.

Au 30 juin 2023

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– \$	1 360 404 \$	– \$	1 360 404 \$
Obligations – position acheteur	–	47 227 643	–	47 227 643
Contrats de change à terme	–	69 130	–	69 130
Contrats à terme normalisés	192 380	–	–	192 380
Swaps sur défaillance de crédit	12 866	–	–	12 866
Contrats de swap	–	6 417	–	6 417
	205 246 \$	48 663 594 \$	– \$	48 868 840 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Obligations – position vendeur	– \$	22 504 200 \$	– \$	22 504 200 \$
Contrats de change à terme	–	29 979	–	29 979
Contrats à terme normalisés	116 860	–	–	116 860
Swaps sur défaillance de crédit	5 040	–	–	5 040
	121 900 \$	22 534 179 \$	– \$	22 656 079 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Au 31 décembre 2022

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– \$	428 412 \$	– \$	428 412 \$
Obligations – position acheteur	–	50 654 800	–	50 654 800
Contrats de change à terme	–	114 467	–	114 467
Contrats à terme normalisés	232 781	–	–	232 781
Swaps sur défaillance de crédit	573	–	–	573
	233 354 \$	51 197 679 \$	– \$	51 431 033 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position vendeur	– \$	4 820 910 \$	– \$	4 820 910 \$
Obligations – position vendeur	–	19 391 897	–	19 391 897
Contrats de change à terme	–	22 483	–	22 483
Contrats à terme normalisés	180 575	–	–	180 575
Swaps sur défaillance de crédit	218	–	–	218
	180 793 \$	24 235 290 \$	– \$	24 416 083 \$

Il n'y a eu aucun transfert d'actifs ou de passifs financiers entre les niveaux 1, 2 et 3 pour la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022, les changements aux parts en circulation ont été les suivants :

	Solde à l'ouverture de la période	Parts rachetables émises	Parts rachetables réinvesties	Parts rachetables rachetées	Solde à la clôture de la période
2023					
Série A	13 264	14 241	152	(1 300)	26 357
Série F	199 147	2 859	1 611	(60 768)	142 849
Série I	2 959 236	29 066	44 859	(3 542)	3 029 619
2022					
Série A	10 663	2 975	858	(1 232)	13 264
Série F	291 593	84 777	11 871	(189 094)	199 147
Série I	3 416 269	205 049	259 383	(921 465)	2 959 236

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2022, le Fonds disposait de pertes en capital inutilisées de 3 272 949 \$ (néant au 31 décembre 2021) qui peuvent être reportées indéfiniment pour réduire ses gains en capital réalisés futurs. Il ne disposait d'aucune perte autre qu'en capital inutilisée pouvant être reportée aux fins de l'impôt (néant au 31 décembre 2021).

Au cours de la période, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2022).

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Transactions avec des parties liées et autres charges (note 8)

Frais de gestion

Le Fonds paie des frais de gestion, qui sont comptabilisés quotidiennement et payés mensuellement. Les taux des frais de gestion annuels, avant taxes, sont de 1,45 % pour la série A et de 0,45 % pour la série F. Le Fonds ne paie aucuns frais de gestion pour les parts de série I. Les frais de gestion pour ces parts sont négociés et payés directement par les porteurs de parts au gestionnaire et ne peuvent pas être plus élevés que les frais de gestion des parts de série A du Fonds.

Rémunération au rendement

Le Fonds verse trimestriellement une rémunération au rendement au gestionnaire (la « rémunération au rendement »), celle-ci étant calculée et comptabilisée quotidiennement. Cette rémunération au rendement est égale à 15 % de l'excédent du rendement d'une série donnée du Fonds sur la référence de rendement minimal. Elle s'applique aux parts des séries A et F. Les porteurs de parts de série I peuvent négocier une rémunération au rendement qui sera versée directement au gestionnaire.

Le taux de rendement minimal du Fonds correspond au rendement de l'indice des Bons du Trésor à 91 jours FTSE Canada.

Parts détenues par des parties liées

Groupe financier Connor, Clark & Lunn Ltée (« GFCC&L »), société liée au gestionnaire du fait d'une propriété commune, détient des parts du Fonds. Au 30 juin 2023, GFCC&L détenait 6 522 parts de série A, 6 585 parts de série F et 2 324 956 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 51 468 \$, de 54 036 \$ et de 19 971 605 \$ (6 425 parts de série A, 6 487 parts de série F et 2 290 410 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 50 862 \$, de 53 099 \$ et de 19 578 425 \$ au 31 décembre 2022).

Commissions de courtage et autres coûts de transactions (note 9)

Le Fonds a payé 6 260 \$ (4 453 \$ en 2022) en commissions de courtage et autres coûts de transactions relativement à des opérations de portefeuille durant la période. Aucun paiement indirect n'a été effectué durant la période (aucun en 2022).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, en dollars canadiens. Les montants présentés sont fondés sur la juste valeur des actifs monétaires (y compris la trésorerie et les placements à court terme) et sur le capital sous-jacent des contrats de change à terme, le cas échéant.

Les tableaux indiquent également l'effet potentiel, sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, d'une fluctuation de 5 % des devises par rapport au dollar canadien, toutes les autres variables restant constantes. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Au 30 juin 2023

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar américain	18 147 507	(7 867 951)	10 279 556	37,5	513 978
Total	18 147 507	(7 867 951)	10 279 556	37,5	513 978

Au 31 décembre 2022

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar américain	22 877 973	(12 625 679)	10 252 294	37,9	512 615
Total	22 877 973	(12 625 679)	10 252 294	37,9	512 615

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était directement exposé au risque de taux d'intérêt du fait de ses placements dans des titres à revenu fixe, des instruments de créance à court terme et des instruments dérivés de taux d'intérêt. Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque lié aux taux d'intérêt au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022. Les montants présentés sont fondés sur la valeur comptable des instruments de créance et excluent la trésorerie et les actions privilégiées, le cas échéant.

Au 30 juin 2023

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total \$	% de l'actif net
Moins de 1 an	1 360 404	5,0
De 1 à 3 ans	8 694 825	31,7
De 3 à 5 ans	3 429 206	12,5
Plus de 5 ans	12 599 412	46,0
Total	26 083 847	95,2

Au 31 décembre 2022

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total \$	% de l'actif net
Moins de 1 an	(4 392 498)	(16,3)
De 1 à 3 ans	2 534 587	9,4
De 3 à 5 ans	13 589 799	50,3
Plus de 5 ans	15 138 517	56,0
Total	26 870 405	99,4

Si les taux d'intérêt en vigueur avaient augmenté ou diminué de 1,0 %, la courbe des taux évoluant en parallèle et tous les autres facteurs demeurant inchangés, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 755 000 \$ (995 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, l'autre risque de prix était négligeable, le Fonds n'ayant eu aucune exposition importante à des placements soumis aux fluctuations du marché.

Risque de crédit

Les tableaux ci-dessous présentent l'exposition du Fonds au risque de crédit au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022. Les montants présentés sont fondés sur la valeur comptable des instruments de créance et le gain latent sur les instruments dérivés en cours avec des contreparties.

Au 30 juin 2023

Notations des créances et des contreparties	Total \$	% de l'actif net
AAA	8 771 903	32,0
AA	31 697	0,1
A	5 147 783	18,8
BBB	19 933 921	72,8
BB	10 447 822	38,1
B	3 818 426	13,9
CCC	512 042	1,9
Total	48 663 594	177,6

Au 31 décembre 2022

Notations des créances et des contreparties	Total \$	% de l'actif net
AAA	5 244 534	19,4
AA	11 674	–
A	7 391 566	27,4
BBB	22 966 752	85,0
BB	10 767 609	39,8
B	4 327 379	16,0
CCC	488 165	1,8
Total	51 197 679	189,4

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Prêt de titres (note 12)

Pour les périodes closes les 30 juin 2023 et 2022, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2023	2022
	\$	\$
Revenus bruts tirés du prêt de titres	605	1 014
Charges liées au prêt de titres	(121)	(203)
Revenus nets tirés du prêt de titres	484	811
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	–	–
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	484	811

Les charges liées au prêt de titres ont représenté 20,0 % (20,0 % en 2022) des revenus bruts tirés du prêt de titres, et ont été payées en totalité au dépositaire du Fonds.

Le tableau qui suit présente un aperçu des titres prêtés et des garanties détenues au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022.

	30 juin 2023	31 décembre 2022
	(en milliers de \$)	(en milliers de \$)
Titres prêtés	2 290	693
Garanties reçues	2 405	727
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Effet de levier (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 117,1 % à 186,0 % (de 85,2 % à 191,1 % au 31 décembre 2022) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 30 juin 2023, l'exposition totale du Fonds correspondait à 134,4 % (182,4 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur titres à revenu fixe, de positions vendeur sur placements à court terme, de contrats à terme sur obligations et d'emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de néant à 2 134 902 \$ (de néant à 7 973 344 \$ en 2022), avec un taux d'intérêt moyen de 8,95 % (6,21 % en 2022). Au 30 juin 2023, les emprunts en trésorerie correspondaient à 1,1 % (2,0 % au 31 décembre 2022) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds de rendement absolu PCJ II

États de la situation financière aux

	30 juin 2023 (non audité)	31 décembre 2022 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	69 865 \$	596 221 \$
Placements à court terme	55 312 502	51 167 098
Placements	40 373 748	36 554 059
Montant à recevoir du courtier	770 874	339 809
Dividendes à recevoir	88 311	43 326
Intérêts à recevoir	170	30 960
Autres créances	52 938	17 929
Souscriptions à recevoir	277 108	104 529
	96 945 516	88 853 931
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	2 414 798	2 162 647
Placements vendus à découvert	35 081 923	33 683 725
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	88 861	105 676
Montant à payer au courtier	1 210 304	197 856
Frais d'emprunt de titres à payer	–	9 511
Charges à payer	18 694	58 511
Frais de gestion à payer	45 971	42 799
Rachats à payer	1 680	9 283
	38 862 231	36 270 008
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	58 083 285 \$	52 583 923 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	1 785 665 \$	1 948 885 \$
Série F	52 025 817 \$	46 400 923 \$
Série I	4 271 803 \$	4 234 115 \$
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	193 430	210 804
Série F	5 511 312	4 933 501
Série I	440 000	440 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	9,23 \$	9,25 \$
Série F	9,44 \$	9,41 \$
Série I	9,71 \$	9,62 \$

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

Administrateur

« Tim Elliott »

Administrateur

Fonds de rendement absolu PCJ II

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2023	2022
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	47 688 \$	165 398 \$
Variation du gain (perte) de change latent	6 565	(45 553)
Autres revenus (pertes)	444	–
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	358 497	155 835
Charges de dividendes sur les titres vendus à découvert	(573 379)	(284 630)
Intérêts aux fins des distributions	1 274 316	80 368
Gain (perte) net réalisé sur les placements	1 493 609	(1 545 441)
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	(1 701 981)	1 686 325
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	833 902	(3 159 375)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	(935 923)	3 048 908
Gain (perte) net total sur placements	<u>749 041</u>	<u>(18 010)</u>
Total des revenus (pertes) nets	<u>803 738</u>	<u>101 835</u>
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	7 486	13 191
Honoraires des dépositaires	11 996	23 723
Frais de dépôt	8 285	22 251
Honoraires de FundSERV	75	–
Honoraires du comité d'examen indépendant	2 232	2 480
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	–	321
Charges d'intérêts	111 370	3 729
Frais de gestion	282 128	234 192
Honoraires de professionnels	3 111	3 058
Coût d'emprunt de titres	43 742	70 004
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	28 555	24 454
Coûts d'opérations (note 9)	<u>73 162</u>	<u>109 813</u>
Total des charges d'exploitation	<u>572 142</u>	<u>507 216</u>
Retenues d'impôts (note 7)	<u>(8 786)</u>	<u>(6 638)</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>222 810 \$</u>	<u>(412 019) \$</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	(2 382) \$	(34 377) \$
Série F	187 504 \$	(341 831) \$
Série I	<u>37 688 \$</u>	<u>(35 811) \$</u>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	200 829	173 108
Série F	5 250 768	3 911 850
Série I	<u>440 000</u>	<u>440 000</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	(0,01) \$	(0,20) \$
Série F	0,04 \$	(0,09) \$
Série I	<u>0,09 \$</u>	<u>(0,08) \$</u>

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)
Pour les semestres clos les 30 juin

	Série A 2023	Série A 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	1 948 885 \$	1 716 918 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 382)	(34 377)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	9 398	–
Rachat de parts rachetables	(170 236)	(125 916)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(160 838)	(125 916)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(163 220)	(160 293)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	1 785 665 \$	1 556 625 \$
	Série F 2023	Série F 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	46 400 923 \$	31 876 784 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	187 504	(341 831)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	9 670 263	16 764 716
Rachat de parts rachetables	(4 232 873)	(4 185 709)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	5 437 390	12 579 007
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	5 624 894	12 237 176
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	52 025 817 \$	44 113 960 \$

Fonds de rendement absolu PCJ II

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)
Pour les semestres clos les 30 juin

	Série I 2023	Série I 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	4 234 115 \$	4 262 619 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	37 688	(35 811)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	37 688	(35 811)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	4 271 803 \$	4 226 808 \$
	Total 2023	Total 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	52 583 923 \$	37 856 321 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	222 810	(412 019)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	9 679 661	16 764 716
Rachat de parts rachetables	(4 403 109)	(4 311 625)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	5 276 552	12 453 091
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	5 499 362	12 041 072
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	58 083 285 \$	49 897 393 \$

Fonds de rendement absolu PCJ II

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)
Pour les semestres clos les 30 juin

	2023	2022
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	222 810 \$	(412 019) \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	(6 565)	45 553
(Gain) perte net réalisé sur les placements	(1 493 609)	1 545 441
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	1 701 981	(1 686 325)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	(833 902)	3 159 375
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	935 923	(3 048 908)
Achat de placements	(253 899 925)	(238 464 667)
Produit de la vente de placements	247 604 020	228 153 072
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(44 985)	(35 539)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	30 790	-
(Augmentation) diminution des autres créances	(35 009)	5 120
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	(9 511)	6 835
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	(16 815)	19 034
Augmentation (diminution) des charges à payer	(39 817)	3 222
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	3 172	12 557
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	(5 881 442)	(10 697 249)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	9 507 082	16 306 777
Rachat de parts rachetables**	(4 410 712)	(4 299 830)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	5 096 370	12 006 947
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	(785 072)	1 309 698
Variation du gain (perte) de change latent	6 565	(45 553)
Trésorerie, à l'ouverture de la période	596 221	9
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	(2 162 647)	(2 917 980)
	(2 344 933)	(1 653 826)
Trésorerie, à la clôture de la période	69 865 \$	17 322 \$
Dette bancaire, à la clôture de la période	(2 414 798) \$	(1 671 148) \$
	(2 344 933) \$	(1 653 826) \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	304 726 \$	113 658 \$
Dividendes payés*	590 194	265 596
Intérêts reçus*	1 305 106	80 368
Intérêts payés*	111 370	3 729

* Inclus dans les activités d'exploitation.

** Déduction faite d'échanges hors trésorerie de néant (9 331 \$ en 2022).

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Placements à court terme – position acheteur						
Bons du Trésor du Canada (31 décembre 2022 : 97,31 %)						
Bons du Trésor du Canada	9,281	6 juill. 2023	5 300 000	5 247 666	5 295 964	
Bons du Trésor du Canada	4,965	20 juill. 2023	15 850 000	15 691 620	15 809 931	
Bons du Trésor du Canada	4,892	3 août 2023	1 050 000	1 039 406	1 045 354	
Bons du Trésor du Canada	4,846	17 août 2023	10 550 000	10 441 073	10 484 100	
Bons du Trésor du Canada	4,892	31 août 2023	4 050 000	4 006 114	4 017 091	
Bons du Trésor du Canada	4,921	14 sept. 2023	18 500 000	18 296 969	18 314 247	
Bons du Trésor du Canada	4,929	28 sept. 2023	350 000	345 839	345 815	
				<u>55 068 687</u>	<u>55 312 502</u>	95,23
Total des placements à court terme – position acheteur				<u>55 068 687</u>	<u>55 312 502</u>	95,23
Obligations – position acheteur						
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2022 : 1,84 %)						
Chorus Aviation Inc.	6,000	30 juin 2026	1 032 000	1 062 384	980 400	1,69
Total des obligations – position acheteur				<u>1 062 384</u>	<u>980 400</u>	1,69
Actions canadiennes – position acheteur						
Énergie (31 décembre 2022 : 5,53 %)						
Advantage Energy Ltd.			87 290	699 002	755 059	
Corporation Cameco, NYSE			11 090	364 665	459 760	
Canadian Natural Resources Ltd., NYSE			4 170	262 607	310 438	
Crescent Point Energy Corp.			39 160	348 942	349 307	
Gibson Energy Inc.			25 170	507 176	530 080	
MEG Energy Corp.			28 060	574 761	589 260	
Rubellite Energy Inc.			37 730	140 097	63 386	
Shawcor Ltée			9 900	188 328	189 684	
Corporation TC Énergie, NYSE			24 060	1 306 411	1 286 541	
Vermilion Energy Inc., NYSE			29 680	482 702	488 959	
				<u>4 874 691</u>	<u>5 022 474</u>	8,65
Matières premières (31 décembre 2022 : 4,81 %)						
Canfor Corp.			13 700	317 393	325 786	
West Fraser Timber Co., Ltd., négociées hors cot			5 050	556 686	574 550	
				<u>874 079</u>	<u>900 336</u>	1,55
Industries (31 décembre 2022 : 10,25 %)						
Air Canada			20 580	477 491	514 294	
ATS Corp.			5 110	295 600	311 455	
Black Diamond Group Ltd.			132 240	853 999	800 052	
Bombardier Inc.			8 520	535 611	556 441	
Boyd Group Services Inc.			1 000	243 204	252 750	
CAE inc., NYSE			50 659	1 449 121	1 500 223	
Canadien Pacifique Kansas City Limitée, NYSE			30 850	3 302 224	3 297 192	
Exchange Income Corp.			6 100	301 360	319 701	
Héroux-Devtek Inc.			15 680	223 294	240 531	
NFI Group Inc.			4 960	40 920	56 594	
Parkit Enterprise Inc.			225 240	292 320	184 697	
RB Global Inc., NYSE			24 260	1 842 294	1 926 110	
Métaux Russel Inc.			7 080	237 583	259 836	
Groupe SNC-Lavalin inc.			33 340	1 091 368	1 158 565	
Stantec Inc., NYSE			6 527	460 369	563 292	
				<u>11 646 758</u>	<u>11 941 733</u>	20,56
Bien de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 2,02 %)						
Restaurant Brands International Inc., NYSE			3 020	293 561	309 785	0,53
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 2,37 %)						

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
George Weston ltée			8 930	1 372 903	1 398 617	
Saputo inc.			6 330	210 509	187 874	
				<u>1 583 412</u>	<u>1 586 491</u>	2,73
Services financiers (31 décembre 2022 : 10,46 %)						
Banque de Montréal, TSE			2 110	250 246	252 440	
Element Fleet Management Corp.			33 300	631 703	671 994	
Fairfax Financial Holdings Ltd.			2 070	1 941 688	2 054 040	
Payfare Inc.			46 940	257 108	262 864	
La Banque Toronto-Dominion, NYSE			2 030	162 845	166 570	
				<u>3 243 590</u>	<u>3 407 908</u>	5,87
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 4,70 %)						
Docebo Inc.			11 440	513 047	599 914	
Kinaxis Inc.			2 040	323 357	386 172	
TECSYS Inc.			10 810	296 578	301 167	
				<u>1 132 982</u>	<u>1 287 253</u>	2,22
Services de communication (31 décembre 2022 : 1,74 %)						
Rogers Communications Inc., NYSE			36 787	2 332 677	2 221 668	3,82
Services publics (31 décembre 2022 : 1,74 %)						
TransAlta Corp., NYSE			11 909	149 945	147 499	0,25
Immobilier (31 décembre 2022 : 3,95 %)						
Boardwalk REIT			9 520	565 845	592 049	
Fonds de placement immobilier d'immeubles résidentiels canadiens			42 680	2 047 471	2 170 705	
DREAM Unlimited Corp.			8 710	256 212	179 687	
InterRent REIT			75 540	1 046 645	968 423	
Real Matters Inc.			20 150	111 727	122 109	
Tricon Residential Inc.			34 250	397 622	400 040	
				<u>4 425 522</u>	<u>4 433 013</u>	7,63
Total des actions canadiennes – position acheteur				<u>30 557 217</u>	<u>31 258 160</u>	53,81
Actions canadiennes – position vendeur						
Énergie (31 décembre 2022 : -4,40 %)						
Athabasca Oil Corp.			(84 980)	(241 782)	(243 893)	
Baytex Energy Corp., TSE			(71 150)	(313 266)	(307 368)	
Birchcliff Energy Ltd.			(82 510)	(701 090)	(646 878)	
Enbridge Inc.			(13 940)	(734 680)	(686 406)	
Gibson Energy Inc.			(25 170)	(565 494)	(524 291)	
Paramount Resources Ltd.			(6 920)	(197 085)	(199 296)	
Whitecap Resources Inc.			(53 910)	(538 489)	(499 746)	
				<u>(3 291 886)</u>	<u>(3 107 878)</u>	(5,35)
Matières premières (31 décembre 2022 : -1,70 %)						
Cascades inc.			(22 290)	(225 266)	(260 570)	(0,45)
Industries (31 décembre 2022 : -2,02 %)						
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada			(12 750)	(2 029 066)	(2 045 355)	
Cargojet Inc.			(3 860)	(440 061)	(371 409)	
Mullen Group Ltd.			(21 870)	(305 401)	(331 987)	
NFI Group Inc. (NFI.CN)			(4 970)	(55 878)	(56 757)	
				<u>(2 830 406)</u>	<u>(2 805 508)</u>	(4,83)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -1,52 %)						
Boston Pizza Royalties Income Fund			(7 780)	(128 382)	(129 148)	
La Société Canadian Tire Ltée			(2 760)	(449 938)	(499 891)	
Meubles Léon Ltée			(2 560)	(48 339)	(56 192)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.			(3 880)	(223 519)	(235 089)	
Sleep Country Canada Holdings Inc.			(5 530)	(141 998)	(158 766)	
				<u>(992 176)</u>	<u>(1 079 086)</u>	(1,86)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -0,88 %)						
Les Aliments Maple Leaf Inc.			(23 240)	(633 746)	(601 451)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
North West Co Inc.			(5 020)	(190 002)	(157 628)	
				(823 748)	(759 079)	(1,31)
Services financiers (31 décembre 2022 : -5,76 %)						
Banque de Montréal, NYSE			(2 110)	(247 076)	(252 149)	
La Banque de Nouvelle-Écosse			(4 260)	(303 459)	(282 353)	
EQB Inc.			(5 040)	(284 627)	(352 800)	
Corporation Fiera Capital			(34 330)	(302 683)	(221 772)	
Goeasy Ltd.			(3 190)	(344 454)	(352 750)	
Intact Corporation financière			(1 440)	(282 796)	(294 538)	
				(1 765 095)	(1 756 362)	(3,02)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -2,41 %)						
Descartes Systems Group Inc.			(6 120)	(537 164)	(649 454)	(1,12)
Services de communication (31 décembre 2022 : néant)						
BCE Inc.			(9 070)	(565 043)	(547 828)	
TELUS Corp.			(40 460)	(1 112 746)	(1 043 059)	
				(1 677 789)	(1 590 887)	(2,74)
Services publics (31 décembre 2022 : -2,02 %)						
TransAlta Renewables Inc.			(34 420)	(398 614)	(391 700)	(0,67)
Immobilier (31 décembre 2022 : -1,61 %)						
Allied Properties REIT			(6 480)	(139 785)	(140 746)	
Automotive Properties REIT			(2 050)	(27 151)	(23 555)	
CT REIT			(18 640)	(286 501)	(281 278)	
Nexus Industrial REIT			(15 440)	(136 994)	(130 931)	
NorthWest Healthcare Properties REIT			(83 570)	(650 292)	(524 820)	
FPI RioCan			(38 980)	(800 534)	(751 534)	
SmartCentres REIT			(9 390)	(278 080)	(228 083)	
				(2 319 337)	(2 080 947)	(3,58)
Total des actions canadiennes – position vendeur				(14 861 481)	(14 481 471)	(24,93)
Actions américaines – position acheteur						
Matières premières (31 décembre 2022 : 1,53 %)						
Industries (31 décembre 2022 : 9,64 %)						
FedEx Corp.			1 330	390 194	436 282	
Howmet Aerospace Inc.			11 230	668 502	736 462	
Quanta Services Inc.			2 000	456 759	519 902	
Uber Technologies Inc.			12 980	648 504	741 474	
United Rentals Inc.			3 550	1 736 515	2 092 129	
XPO Inc.			5 840	409 870	455 936	
				4 310 344	4 982 185	8,59
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 3,56 %)						
Amazon.com Inc.			1 530	259 601	263 922	
Valvoline Inc.			14 100	689 259	699 850	
				948 860	963 772	1,66
Soins de santé (31 décembre 2022 : 1,23 %)						
Services financiers (31 décembre 2022 : 3,76 %)						
Bank of America Corp.			15 209	589 328	577 391	
Visa Inc.			1 000	304 229	314 243	
				893 557	891 634	1,54
Services de communication (31 décembre 2022 : 0,36 %)						
Total des actions américaines – position acheteur				6 152 761	6 837 591	11,79
Actions américaines – position vendeur						
Matières premières (31 décembre 2022 : -0,55 %)						

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Rayonier Advanced Materials Inc.			(6 670)	(57 730)	(37 775)	(0,07)
Industries (31 décembre 2022 : -10,45 %)						
American Airlines Group Inc.			(11 440)	(219 466)	(271 574)	
Caterpillar Inc.			(990)	(302 205)	(322 326)	
CH Robinson Worldwide Inc.			(1 970)	(259 606)	(245 950)	
Copart Inc.			(2 540)	(292 769)	(306 560)	
CSX Corp.			(6 920)	(298 100)	(312 248)	
Deluxe Corp.			(5 080)	(247 651)	(117 502)	
Expeditors International of Washington Inc.			(2 720)	(398 487)	(435 973)	
Hawaiian Holdings Inc.			(15 830)	(263 598)	(225 598)	
JB Hunt Transport Services Inc.			(620)	(142 071)	(148 519)	
Kennametal Inc.			(10 688)	(334 757)	(401 514)	
Knight-Swift Transportation Holdings Inc.			(1 910)	(141 227)	(140 422)	
Landstar System Inc.			(710)	(172 155)	(180 892)	
Middleby Corp.			(1 910)	(348 260)	(373 624)	
Norfolk Southern Corp.			(980)	(287 155)	(294 057)	
Old Dominion Freight Line Inc.			(360)	(121 709)	(176 137)	
Oshkosh Corp.			(6 350)	(721 030)	(727 580)	
PACCAR Inc.			(1 890)	(173 098)	(209 202)	
Schneider National Inc.			(3 220)	(113 959)	(122 371)	
Terex Corp.			(960)	(46 413)	(76 003)	
United Parcel Service Inc., cat. B			(1 410)	(336 664)	(334 439)	
Werner Enterprises Inc.			(1 890)	(112 605)	(110 491)	
				(5 332 985)	(5 532 982)	(9,53)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -5,22 %)						
Carter's Inc.			(2 010)	(166 925)	(193 095)	
Cheesecake Factory Inc.			(6 600)	(286 497)	(302 001)	
DoorDash Inc.			(3 016)	(247 086)	(304 984)	
Helen of Troy Ltd.			(2 900)	(377 179)	(414 516)	
Home Depot Inc.			(1 010)	(404 225)	(415 162)	
Polaris Inc.			(7 180)	(1 044 116)	(1 148 941)	
Pool Corp.			(1 040)	(449 180)	(515 569)	
Tesla Inc			(430)	(123 550)	(148 946)	
				(3 098 758)	(3 443 214)	(5,93)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -2,73 %)						
PepsiCo Inc.			(1 010)	(235 828)	(247 542)	(0,43)
Services financiers (31 décembre 2022 : -6,47 %)						
Bank OZK			(6 150)	(295 948)	(326 819)	
Discover Financial Services			(2 130)	(281 969)	(329 342)	
First Hawaiian Inc.			(6 990)	(165 523)	(166 583)	
German American Bancorp Inc.			(3 330)	(132 339)	(119 766)	
Markel Group Inc.			(120)	(212 315)	(219 634)	
OneMain Holdings Inc.			(3 380)	(160 255)	(195 406)	
SEI Investments Co.			(3 640)	(255 374)	(287 166)	
Synchrony Financial			(6 840)	(321 487)	(307 009)	
T Rowe Price Group Inc.			(3 260)	(484 302)	(483 228)	
W R Berkley Corp.			(1 510)	(115 576)	(119 007)	
				(2 425 088)	(2 553 960)	(4,40)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -0,51 %)						
Immobilier (31 décembre 2022 : -3,00 %)						
CBRE Group Inc.			(2 630)	(269 412)	(280 881)	
Equity Residential			(4 000)	(322 465)	(349 177)	
Iron Mountain Inc.			(3 340)	(213 850)	(251 123)	
				(805 727)	(881 181)	(1,52)
Total des actions américaines – position vendeur				(11 956 116)	(12 696 654)	(21,88)
Actions étrangères – position acheteur						

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Industries (31 décembre 2022 : néant)						
Rentokil Initial PLC			10 045	541 329	518 519	0,89
Services publics (31 décembre 2022 : néant)						
Brookfield Infrastructure Partners LP			16 090	768 982	779 078	1,34
Total des actions étrangères – position acheteur				<u>1 310 311</u>	<u>1 297 597</u>	2,23
Actions étrangères – position vendeur						
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -0,53 %)						
Services financiers (31 décembre 2022 : néant)						
Chubb Ltd.			(660)	(170 988)	(168 170)	(0,29)
Total des actions étrangères – position vendeur				<u>(170 988)</u>	<u>(168 170)</u>	(0,29)
Fonds négociés en bourse – position vendeur (31 décembre 2022 : -12,26 %)						
BMO S&P 500 Index ETF			(11 120)	(688 183)	(716 684)	
Industrial Select Sector SPDR Fund			(4 289)	(574 892)	(609 082)	
Invesco QQQ Trust Series 1			(2 050)	(982 884)	(1 002 105)	
iShares Core S&P/TSX Capped Composite Index ETF			(80 260)	(2 570 728)	(2 569 123)	
iShares Russell 2000 ETF			(3 050)	(708 863)	(755 800)	
iShares U.S. Real Estate ETF			(1 960)	(214 328)	(224 446)	
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF			(7 900)	(1 057 731)	(962 045)	
SPDR Dow Jones Industrial Average ETF Trust			(1 970)	(862 265)	(896 343)	
Total des fonds négociés en bourse – position vendeur				<u>(7 659 874)</u>	<u>(7 735 628)</u>	(13,32)
Commissions de courtage intégrées (note 3)						
				<u>(30 511)</u>		
Total des placements				<u>59 472 390</u>	<u>60 604 327</u>	104,33
Autres actifs, moins les passifs					<u>(2 521 042)</u>	(4,33)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables					<u>58 083 285</u>	100,00

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Il est conseillé de lire les présentes notes propres au Fonds en parallèle avec les notes annexes des états financiers, qui font partie intégrante des présents états financiers. Les présentes notes propres au Fonds peuvent faire référence aux notes annexes en indiquant le numéro de la note correspondante. Comme elles complètent les notes annexes, il n'y a pas nécessairement de note propre au Fonds correspondante pour chacune des notes annexes.

Renseignements généraux (note 1)

Le Fonds de rendement absolu PCJ II (le « Fonds ») est une fiducie de fonds commun de placement à capital variable établie en vertu des lois de l'Ontario et est régi par une déclaration de fiducie datée du 1^{er} mai 2012 dans sa version modifiée (la « déclaration de fiducie »). Le Fonds est entré en activité le 5 mars 2021. L'adresse du siège social du Fonds est le 1400 – 130 King St. West, P.O. Box 240, Toronto (Ontario) Canada, M5X 1C8.

Le gestionnaire a retenu les services de PCJ Investment Counsel Ltd. (« PCJ ») pour agir à titre de gestionnaire de portefeuille du Fonds (le « gestionnaire de placements »). PCJ fait partie de Groupe financier Connor, Clark & Lunn Ltée (« GFCC&L »), dont le gestionnaire est une société affiliée.

L'objectif de placement du Fonds est de procurer un rendement absolu positif et attrayant redressé en fonction du risque, qui présente une faible corrélation avec les portefeuilles de placements à long terme traditionnels et qui est moins volatil que celui de tels portefeuilles. Le Fonds aura recours à des opérations de ventes à découvert, à des emprunts en trésorerie et à des instruments dérivés afin d'atteindre son objectif de placement.

Juste valeur des instruments financiers (note 5)

Classement des placements selon la hiérarchie des justes valeurs

Les tableaux ci-dessous présentent le classement des instruments financiers du Fonds évalués à la juste valeur à la date de clôture. Les montants sont établis selon les valeurs comptabilisées dans l'état de la situation financière.

Au 30 juin 2023

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– \$	55 312 502 \$	– \$	55 312 502 \$
Obligations – position acheteur	–	980 400	–	980 400
Actions canadiennes – position acheteur	31 073 463	184 697	–	31 258 160
Actions américaines – position acheteur	6 837 591	–	–	6 837 591
Actions étrangères – position acheteur	1 297 597	–	–	1 297 597
	39 208 651 \$	56 477 599 \$	– \$	95 686 250 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	14 481 471 \$	– \$	– \$	14 481 471 \$
Actions américaines – position vendeur	12 696 654	–	–	12 696 654
Actions étrangères – position vendeur	168 170	–	–	168 170
Fonds négociés en bourse – position vendeur	7 735 628	–	–	7 735 628
	35 081 923 \$	– \$	– \$	35 081 923 \$

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Au 31 décembre 2022

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– \$	51 167 098 \$	– \$	51 167 098 \$
Obligations – position acheteur	–	969 048	–	969 048
Actions canadiennes – position acheteur	25 023 154	–	–	25 023 154
Actions américaines – position acheteur	10 561 857	–	–	10 561 857
	35 585 011 \$	52 136 146 \$	– \$	87 721 157 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	11 742 973 \$	– \$	– \$	11 742 973 \$
Actions américaines – position vendeur	15 221 018	–	–	15 221 018
Actions étrangères – position vendeur	280 097	–	–	280 097
Fonds négociés en bourse – position vendeur	6 439 637	–	–	6 439 637
	33 683 725 \$	– \$	– \$	33 683 725 \$

Il n'y a eu aucun transfert important d'actifs ou de passifs financiers entre les niveaux 1, 2 et 3 pour la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2023 et l'exercice clos le 31 décembre 2022, les changements aux parts en circulation ont été les suivants :

	Solde à l'ouverture de la période	Parts rachetables émises	Parts rachetables réinvesties	Parts rachetables rachetées	Solde à la clôture de la période
2023					
Série A	210 804	1 013	–	(18 387)	193 430
Série F	4 933 501	1 027 526	–	(449 715)	5 511 312
Série I	440 000	–	–	–	440 000
2022					
Série A	180 637	45 312	–	(15 145)	210 804
Série F	3 330 483	2 790 816	–	(1 187 798)	4 933 501
Série I	440 000	–	–	–	440 000

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, un seul porteur de parts détenait la totalité des parts rachetables en circulation de la série I du Fonds.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2022, le Fonds avait des pertes en capital inutilisées de 1 208 368 \$ (néant au 31 décembre 2021), qui peuvent être reportées indéfiniment et servir à réduire le montant des gains en capital réalisés futurs. Le solde des pertes autres qu'en capital inutilisées et pouvant être reportées aux fins de l'impôt totalisait 32 595 \$ (1 952 198 \$ au 31 décembre 2021) et devait venir à échéance au cours des vingt prochaines années, comme l'indique le tableau suivant :

Année de réalisation de la perte autre qu'en capital	Montant de la perte fiscale	Date d'échéance
2021	32 595	2041
Total	32 595	

Au cours de la période considérée, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2022).

Transactions avec des parties liées et autres charges (note 8)

Frais de gestion

Le Fonds paie des frais de gestion, qui sont comptabilisés quotidiennement et payés mensuellement. Le gestionnaire reçoit des frais de gestion pour la prestation ou l'organisation des services de gestion de portefeuille, le choix des fournisseurs de services du Fonds, la préparation de tous les documents réglementaires nécessaires, y compris ceux qui sont requis pour offrir les parts du Fonds, la commercialisation du Fonds, la supervision des activités du Fonds ainsi que l'utilisation des contrôles et la surveillance aux fins de conformité.

Les taux des frais de gestion annuels, avant taxes, sont de 2,00 % pour la série A et de 1,00 % pour la série F.

Le Fonds ne paie aucuns frais de gestion pour les parts de série I. Les frais de gestion pour ces parts sont négociés et payés directement par les porteurs de parts au gestionnaire et ne peuvent pas être plus élevés que les frais de gestion des parts de série A du Fonds.

Rémunération au rendement

Pour les parts de série A et de série F, le Fonds peut verser trimestriellement une rémunération au rendement au gestionnaire de placements (la « rémunération au rendement »), celle-ci étant calculée et comptabilisée quotidiennement et payable le dernier jour ouvrable de chaque trimestre civil ou à un autre moment (p. ex., à la dissolution du Fonds). Cette rémunération au rendement est égale à 20 % de l'excédent de l'accroissement de la valeur liquidative par part de chaque série sur le rendement de référence de la série en question.

Le « rendement de référence » par part d'une série donnée est égal au produit de i) la plus élevée entre la valeur liquidative par part a) au moment de l'émission de la série en question et b) à la fin de la dernière période de rendement pour laquelle une rémunération au rendement a été versée relativement à cette série (après déduction de toutes les charges administratives, y compris les frais de gestion et la rémunération au rendement); et de ii) la somme de un (1) et du rendement minimal cumulatif depuis le calcul de cette valeur liquidative pour la série en question [correspondant à a) ou à b) ci-dessus, selon le cas].

Le taux de rendement minimal est de 2,0 % par année pour les parts de série A et de série F du Fonds.

La rémunération au rendement n'est payable que lorsque la valeur liquidative par part des parts de série A du Fonds excède le rendement de référence à la date du calcul.

Les porteurs de parts de série I peuvent négocier une rémunération au rendement qui sera versée directement au gestionnaire.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Transactions avec des parties liées

Groupe financier Connor, Clark & Lunn Ltée (« GFCC&L »), société liée au gestionnaire du fait d'une propriété commune, détient des parts du Fonds. Au 30 juin 2023, GFCC&L détenait 5 000 parts de série A, 5 000 parts de série F et 440 000 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 46 152 \$, 47 203 \$ et 4 271 803 \$ (5 000 parts de série A, 5 000 parts de série F et 440 000 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 46 226 \$, 47 027 \$ et 4 234 115 \$ au 31 décembre 2022).

Commissions de courtage et autres coûts de transactions (note 9)

Le Fonds a payé 73 162 \$ (109 813 \$ en 2022) en commissions de courtage et autres coûts de transactions relativement à des opérations de portefeuille durant la période. Aucun paiement indirect n'a été effectué durant la période (aucun en 2022).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, en dollars canadiens. Les montants présentés sont fondés sur la juste valeur des actifs monétaires (y compris la trésorerie et les placements à court terme) et sur le capital sous-jacent des contrats de change à terme, le cas échéant.

Les tableaux indiquent également l'effet potentiel, sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, d'une fluctuation de 5 % des devises par rapport au dollar canadien, toutes les autres variables restant constantes. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Au 30 juin 2023

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar américain	(2 957 046)	(5,1)	(147 852)
	(2 957 046)	(5,1)	(147 852)

Au 31 décembre 2022

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar américain	(1 788 483)	(3,4)	(89 424)
	(1 788 483)	(3,4)	(89 424)

Risque lié aux taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était directement exposé au risque lié aux taux d'intérêt du fait de ses placements dans des titres à revenu fixe et des instruments de créance à court terme. Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque lié aux taux d'intérêt au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022. Les montants présentés sont fondés sur la valeur comptable des instruments de créance et excluent la trésorerie et les actions privilégiées.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Au 30 juin 2023

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total \$	% de l'actif net
Moins de 1 an	55 312 502	95,2
De 1 à 3 ans	980 400	1,7
Total	56 292 902	96,9

Au 31 décembre 2022

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total \$	% de l'actif net
Moins de 1 an	51 167 098	97,3
De 3 à 5 ans	969 048	1,9
Total	52 136 146	99,2

Si les taux d'intérêt en vigueur avaient augmenté ou diminué de 1,0 %, la courbe des taux évoluant en parallèle et tous les autres facteurs demeurant inchangés, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 62 000 \$ (35 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023, environ 7,4 % (4,0 % au 31 décembre 2022) de l'actif net du Fonds est exposé à l'autre risque de prix en raison de son exposition aux fluctuations du marché (ne découlant pas d'autres facteurs précités). Si les cours des actions détenues au sein du portefeuille avaient augmenté ou diminué de 10 %, tous les autres facteurs demeurant inchangés, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué d'environ 431 000 \$ (192 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Risque de crédit

Les tableaux ci-dessous présentent l'exposition du Fonds au risque de crédit au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022. Les montants présentés sont fondés sur la valeur comptable des instruments de créance.

Au 30 juin 2023 :

Notations des créances et des contreparties	Total \$	% de l'actif net
AAA	55 312 502	95,2
Non notées	980 400	1,7
Total	56 292 902	96,9

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Au 31 décembre 2022 :

Notations des créances et des contreparties	Total \$	% de l'actif net
AAA	51 167 098	97,3
Non notées	969 048	1,9
Total	52 136 146	99,2

Effet de levier (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 59,1 % à 81,0 % (de 37,6 % à 84,5 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 30 juin 2023, l'exposition totale du Fonds correspondait à 64,6 % (68,2 % au 31 décembre 2022) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur actions et des emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de néant à 6 741 306 \$ (de néant à 4 841 032 \$ en 2022), avec un taux d'intérêt moyen de 5,01 % (1,91 % en 2022). Au 30 juin 2023, les emprunts en trésorerie correspondaient à 4,2 % (4,1 % au 31 décembre 2022) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Il est conseillé de lire les présentes notes en parallèle avec les notes propres au Fonds, qui font partie intégrante des présents états financiers.

1 Renseignements généraux

Les activités de placement des Fonds ci-dessous (collectivement, les « Fonds ») sont gérées par Fonds Connor, Clark & Lunn Inc. (le « gestionnaire »).

- Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)
- Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)
- Fonds alternatif de revenu CC&L
- Fonds de rendement absolu PCJ II

Fiducie RBC Services aux investisseurs en est le fiduciaire.

Le gestionnaire a approuvé la publication des états financiers le 25 août 2023.

2 Mode de présentation

a) Déclaration de conformité :

Les états financiers ont été préparés conformément aux Normes internationales d'information financière publiées par l'International Accounting Standards Board (les *International Financial Reporting Standards*, ou « IFRS »), notamment la norme comptable internationale IAS 34, *Information financière intermédiaire*. Les états financiers ont été établis selon la méthode du coût historique, sauf en ce qui a trait à la réévaluation à la juste valeur par le biais du résultat net des actifs et des passifs financiers (y compris les instruments dérivés).

b) Monnaie fonctionnelle et monnaie de présentation :

Les souscriptions, les rachats et certaines activités d'exploitation des Fonds sont libellés en dollars canadiens, monnaie fonctionnelle et monnaie de présentation du Fonds.

3 Principales méthodes comptables

Les méthodes comptables ci-après ont été appliquées uniformément à toutes les périodes présentées dans les états financiers.

a) Instruments financiers :

Il a été établi que les Fonds répondaient à la définition d'« entité d'investissement ». Pour qu'une entité soit une entité d'investissement, elle doit obtenir des fonds d'un ou de plusieurs investisseurs pour leur fournir des services de gestion d'investissements, s'engager à investir ces fonds dans le seul but de réaliser des rendements sous forme de plus-value du capital ou de revenus de placement, ou les deux, et évaluer la performance de la quasi-totalité de ses placements sur la base de la juste valeur. Le jugement important posé par les Fonds pour déterminer qu'ils répondaient à la définition d'entité d'investissement a consisté à établir que la juste valeur était le principal critère d'évaluation de la performance de la quasi-totalité de leurs placements.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Les Fonds classent et évaluent les instruments financiers conformément à l'IFRS 9, *Instruments financiers : classement et évaluation* (« IFRS 9 »). La norme exige que les actifs financiers soient classés au coût amorti, à la juste valeur par le biais du résultat net (« JVRN ») ou à la juste valeur par le biais des autres éléments du résultat global (« JVAERG »), selon le modèle économique adopté par l'entité pour la gestion des actifs financiers et les caractéristiques des flux de trésorerie contractuels de ces actifs. La détermination du modèle économique adopté nécessite un jugement comptable. Les Fonds classent leurs placements selon les modèles économiques qu'ils ont adoptés pour la gestion des actifs financiers et les caractéristiques de leurs flux de trésorerie contractuels. Les portefeuilles d'actifs financiers sont gérés et leur performance est évaluée d'après la méthode de la juste valeur. Les Fonds se concentrent principalement sur la juste valeur et utilisent ces données pour évaluer la performance et prendre des décisions. Tous les placements sont donc désignés comme étant à la juste valeur par le biais du résultat net.

Plus précisément, les placements, les actifs et passifs dérivés, et les ventes à découvert des Fonds sont évalués à la JVRN. L'obligation des Fonds au titre de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables est présentée au prix de rachat. Tous les autres actifs et passifs financiers sont initialement comptabilisés à la juste valeur et ensuite évalués au coût amorti. Selon cette méthode, les actifs et les passifs financiers reflètent les montants à recevoir ou à payer, actualisés s'il y a lieu, au taux d'intérêt effectif de l'instrument financier. La juste valeur des actifs et des passifs financiers des Fonds qui ne sont pas comptabilisés à la JVRN avoisine leur valeur comptable du fait de leur nature à court terme.

La valeur liquidative par part est égale à la valeur de marché de l'actif net d'un fonds en un jour déterminé, divisée par le nombre total de ses parts en circulation, avant la prise en compte des rachats et des souscriptions de parts le jour en question.

Les intérêts aux fins des distributions présentés dans l'état du résultat global, s'il en est, correspondent à l'intérêt nominal perçu par les Fonds comptabilisé selon la méthode de la comptabilité d'engagement. Les Fonds n'amortissent pas les primes payées ni les escomptes reçus à l'achat de titres à revenu fixe, sauf pour les obligations à coupon zéro, pour lesquelles l'amortissement est fait selon la méthode linéaire. Les dividendes reçus sont comptabilisés à titre de produits à la date ex-dividende. Les dividendes payés sur les titres vendus à découvert, s'il en est, sont comptabilisés à titre de charges à la date ex-dividende. Les distributions des fiducies de revenu et des fonds en gestion commune, s'il en est, sont comptabilisées dès qu'est établi le droit des Fonds d'en recevoir le paiement. Le coût des placements est déterminé selon la méthode du coût moyen.

b) Parts rachetables du Fonds :

Selon l'IAS 32, *Instruments financiers : Présentation*, les parts rachetables des Fonds sont classées dans les passifs. Elles ne satisfont pas aux critères de l'IAS 32 permettant le classement dans les capitaux propres, car les Fonds ont plus d'une obligation contractuelle envers leurs porteurs de parts. Les investisseurs ont le droit d'exiger leur rachat en espèces, sous réserve de la disponibilité de liquidités, à un prix par part fondé sur les politiques d'évaluation des Fonds à chaque date de rachat. Les porteurs de parts ont droit aux distributions déclarées et ont le droit de recevoir des distributions en espèces; par conséquent, l'option de rachat n'est pas la seule obligation contractuelle concernant les parts.

c) Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part de catégorie :

L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part de catégorie correspond à l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables de chaque catégorie, divisée par le nombre moyen pondéré de parts en circulation dans cette catégorie au cours de la période.

d) Trésorerie :

La trésorerie comprend les fonds en caisse et les dettes bancaires. Les dettes bancaires sont classées à titre de passif courant dans l'état de la situation financière.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

e) Placements à court terme :

Les placements à court terme sont les titres de créance dont l'échéance est inférieure à un an à la date d'acquisition.

f) Conversion des devises :

Les placements et d'autres actifs et passifs libellés en devises sont convertis en dollars canadiens aux taux de change en vigueur à chaque date d'évaluation. Les achats et les ventes de placements ainsi que les opérations comptabilisées à titre de produits et de charges libellés en devises sont convertis aux taux de change en vigueur à la date de l'opération. Les gains et les pertes de change sur les actifs et passifs libellés en devises autres que les placements sont présentés séparément dans l'état du résultat global. Les gains et les pertes de change sur les placements sont présentés à titre de gain (perte) net réalisé sur les placements et variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements dans l'état du résultat global.

g) Répartition des produits et des charges :

Les gains réalisés/pertes réalisées, la variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés, les produits et les charges sont répartis tous les jours entre chaque catégorie, en fonction de la quote-part de la valeur liquidative représentée par chacune d'elles. La quote-part de chaque catégorie correspond à la somme des souscriptions nettes de parts de la catégorie le jour visé et de la valeur liquidative de la catégorie le jour précédent. Les produits et les charges propres à une catégorie particulière (par exemple, les frais de gestion) sont comptabilisés séparément afin qu'ils n'aient pas d'incidence sur la valeur liquidative des autres catégories.

h) Impôts sur le revenu :

Les Fonds sont considérés comme des fiducies de fonds communs de placement aux termes de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). Pour toute période, les Fonds doivent distribuer aux porteurs de parts la totalité de leur résultat net aux fins de l'impôt et un montant suffisant des gains en capital nets réalisés, de sorte qu'ils n'aient pas d'impôt à payer. Par conséquent, les Fonds ne comptabilisent pas de charge d'impôt. Pour cette raison, l'avantage fiscal des pertes en capital et des pertes autres qu'en capital n'est pas reflété dans l'état de la situation financière à titre d'actif d'impôt différé.

i) Coûts d'opérations :

Les coûts d'opérations, comme les commissions de courtage liées à l'achat et à la vente de titres, sont passés en charges et comptabilisés dans l'état du résultat global lorsqu'ils sont engagés.

j) Placements dans des fonds sous-jacents et des entités structurées non consolidées :

Les fonds sous-jacents sont évalués chaque jour ouvrable à la valeur liquidative présentée par le gestionnaire du fonds sous-jacent. Une entité structurée est une entité conçue de telle manière que les droits de vote ou droits similaires ne constituent pas le facteur déterminant pour établir qui contrôle l'entité; c'est notamment le cas lorsque les droits de vote concernent uniquement des tâches administratives et que les activités pertinentes sont dirigées au moyen d'accords contractuels. Une entité structurée présente souvent certaines des ou toutes les caractéristiques suivantes : a) des activités bien circonscrites, b) un objectif précis et bien défini, par exemple fournir des possibilités de placement à des investisseurs en leur transférant les risques et avantages associés aux actifs de l'entité structurée, c) des capitaux propres insuffisants pour permettre à l'entité structurée de financer ses activités sans recourir à un soutien financier subordonné et d) un financement par émission, auprès d'investisseurs, de multiples instruments liés entre eux par contrat et créant des concentrations de risque de crédit ou d'autres risques (des « tranches »). Les Fonds considèrent tous leurs placements dans d'autres fonds (les « fonds détenus ») comme des placements dans des entités structurées non consolidées. Les Fonds peuvent investir dans des fonds détenus dont l'objectif est de réaliser une croissance du capital à moyen et à long terme et dont la stratégie de placement exclut le recours à l'emprunt. Les fonds détenus sont gérés par des gestionnaires d'actifs étant ou n'étant pas des parties liées et ont recours à diverses stratégies de placement pour atteindre leurs objectifs respectifs. Les fonds détenus financent leurs

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

activités par l'émission de parts rachetables au gré du porteur et accordent à celui-ci le droit à une quote-part de leur actif net. Le Fonds détient des parts rachetables de chacun des fonds détenus. La variation de la juste valeur de chaque fonds détenu est inscrite au poste « Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements » de l'état du résultat global.

k) Contrats de change à terme :

Les Fonds peuvent conclure des contrats de change à terme à des fins de couverture ou pour avoir une exposition à une devise donnée. La valeur des contrats de change à terme en cours est calculée d'après le gain ou la perte qui serait constaté si la position se dénouait à la date d'évaluation. Les gains et les pertes latents sur les contrats de change à terme sont inscrits au poste « Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme » de l'état du résultat global et, à l'échéance d'un contrat, le gain ou la perte réalisé est inscrit au poste « Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme ». Les montants non réglés sur les contrats de change à terme après liquidation sont inscrits à l'inventaire du portefeuille et sont présentés dans l'état de la situation financière à titre de plus-value latente des contrats de change à terme ou de moins-value latente des contrats de change à terme.

l) Contrats à terme sur obligations :

Les contrats à terme sur obligations sont des instruments financiers fondés sur une obligation souveraine donnée. Les Fonds se servent de ces instruments pour se couvrir contre les variations de prix de l'obligation sous-jacente, et pour en tirer parti. Ils peuvent recourir à des achats et à des ventes normales de ces instruments ainsi qu'à des ventes à découvert et à des achats pour couverture. Tous les risques liés aux ventes à découvert traditionnelles s'appliquent aussi aux ventes à découvert de ces instruments. Les contrats à terme sur obligations sont négociés avec les paiements d'intérêts de l'obligation sous-jacente et une date de règlement précise. Normalement, ils sont dénoués avant la date de règlement par une opération opposée équivalente du même contrat à terme sur obligations.

La valeur des contrats à terme sur obligations en cours est calculée d'après le gain ou la perte qui serait constaté si la position se dénouait à la date d'évaluation. Les Fonds comptabilisent la variation de l'écart entre la juste valeur et le coût de chaque contrat à terme sur obligations à titre de variation du gain ou de la perte latent dans la détermination de la valeur liquidative du Fonds à l'état du résultat global. L'écart entre le prix d'achat et de vente favorise ou défavorise les Fonds selon les gains ou les pertes réalisés.

Les gains et les pertes latents sur les contrats à terme sur obligations sont inscrits au poste « Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats à terme sur obligations » de l'état du résultat global et, à l'échéance d'un contrat, le gain ou la perte réalisé est inscrit au poste « Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme sur obligations ». Les montants non réglés sont inscrits à l'inventaire du portefeuille et sont présentés dans l'état de la situation financière à titre de plus-value latente des contrats à terme sur obligations ou de moins-value latente des contrats à terme sur obligations.

m) Contrats à terme normalisés :

Les Fonds peuvent acquérir des contrats à terme normalisés négociés en bourse. Les contrats à terme normalisés en cours à la clôture de la période sont inscrits à l'inventaire du portefeuille et sont présentés dans l'état de la situation financière à titre de plus-value latente des contrats à terme normalisés ou de moins-value latente des contrats à terme normalisés. Tout écart de valeur enregistré entre la fermeture des bureaux à la date d'évaluation et la date d'évaluation précédente est réglé au comptant quotidiennement et inscrit au poste « Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats à terme normalisés » de l'état du résultat global et, au dénouement d'un contrat, le gain ou la perte réalisé est inscrit au poste « Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés ». Les montants à recevoir (à payer) provenant du règlement de contrats à terme normalisés figurent dans l'état de la situation financière en tant que « Marge de variation quotidienne ». Certains instruments de créance à court terme, comme l'indique l'inventaire du portefeuille, pourraient être traités séparément et détenus à titre de marge sur les contrats à terme normalisés achetés par les Fonds.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

n) Contrats de swap :

Les Fonds peuvent investir dans des contrats de swap. La juste valeur des contrats de swap de gré à gré est déterminée au moyen de techniques d'évaluation, qui comprennent l'utilisation de données observables comme les rendements du marché, les taux d'intérêt et les écarts de taux. Les variations de la juste valeur des contrats de swap en circulation à la date de clôture sont comptabilisées au poste « Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap » de l'état du résultat global. Lorsqu'un contrat de swap arrive à échéance ou est dénoué, le gain ou la perte net réalisé est inscrit au poste « Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap » de l'état du résultat global. Les contrats de swap en circulation à la clôture de la période sont inscrits à l'inventaire du portefeuille et sont présentés dans l'état de la situation financière à titre de plus-value latente des contrats de swap ou de moins-value latente des contrats de swap. Les montants à recevoir (à payer) provenant du règlement de contrats de swap figurent dans l'état de la situation financière en tant que « Marge de variation quotidienne ».

o) Swaps sur défaillance de crédit :

Les Fonds peuvent acquérir des contrats sur indice de swaps sur défaillance de crédit (« contrats sur indice CDX ») normalisés et négociés en bourse. Les variations de la juste valeur des contrats sur indice CDX en cours à la date de clôture sont comptabilisées au poste « Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap » de l'état du résultat global. Lorsqu'un contrat sur indice CDX arrive à échéance ou est dénoué, le gain ou la perte net réalisé est inscrit au poste « Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap » de l'état du résultat global. Les contrats sur indice CDX en cours à la clôture de la période sont inscrits à l'inventaire du portefeuille et sont présentés dans l'état de la situation financière à titre de plus-value latente des swaps sur défaillance de crédit ou de moins-value latente des swaps sur défaillance de crédit. Les montants à recevoir (à payer) provenant du règlement de contrats sur indice CDX figurent dans l'état de la situation financière en tant que « Marge de variation quotidienne ».

p) Prêt de titres :

Les Fonds peuvent conclure des opérations de prêt de titres. Ces transactions consistent en l'échange temporaire de titres donnés en garantie, la contrepartie s'engageant à rendre les mêmes titres à une date ultérieure. Les revenus tirés de ces transactions sont constitués de frais versés par la contrepartie et, dans certaines circonstances, d'intérêts versés et de dividendes payés sur les titres détenus en garantie. Les revenus tirés de ces transactions sont comptabilisés dans l'état du résultat global selon la méthode de la comptabilité d'engagement.

q) Nouvelles normes et interprétations non encore entrées en vigueur :

Les Fonds ont établi qu'il n'existe aucune norme IFRS publiée, mais non encore entrée en vigueur, qui aurait une incidence significative sur les états financiers.

4 Estimations et jugements comptables critiques

La préparation d'états financiers conformes aux IFRS exige du gestionnaire des jugements, des hypothèses et des estimations qui ont une incidence sur l'application des méthodes comptables et les montants présentés des actifs, passifs, produits et charges. Les résultats réels peuvent différer de ces estimations. Les estimations et les hypothèses sous-jacentes sont revues régulièrement.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

5 Juste valeur des instruments financiers

La juste valeur d'un instrument financier est le montant qui serait reçu pour la vente d'un actif ou payé pour le transfert d'un passif lors d'une transaction normale entre des intervenants du marché à la date d'évaluation. Les Fonds classent les évaluations de la juste valeur en fonction d'une hiérarchie qui place au plus haut niveau les cours non ajustés sur des marchés actifs pour des actifs ou des passifs identiques (niveau 1), et au niveau le plus bas les données d'entrée non observables (niveau 3). Les trois niveaux de la hiérarchie des justes valeurs sont les suivants :

Niveau 1 : cours (non ajustés) sur des marchés actifs, pour des actifs ou des passifs identiques auxquels l'entité peut avoir accès à la date d'évaluation;

Niveau 2 : données, autres que les cours du marché inclus dans les données d'entrée de niveau 1, qui sont observables directement ou indirectement;

Niveau 3 : données qui ne sont pas observables.

La juste valeur des actifs et des passifs financiers négociés sur des marchés actifs (comme les dérivés et les titres négociables cotés) est fonction des cours de clôture ou des cotations des courtiers à la date de clôture. Les Fonds utilisent le dernier cours négocié des actifs et des passifs financiers lorsque ce dernier est compris dans l'écart acheteur-vendeur du jour en question. Lorsque ce n'est pas le cas, le gestionnaire détermine, à l'intérieur de l'écart acheteur-vendeur, la valeur la plus représentative de la juste valeur selon les faits et circonstances. Les Fonds ont pour politique de comptabiliser les transferts entre les niveaux de la hiérarchie des justes valeurs à la date de l'événement ou du changement dans les circonstances donnant lieu au transfert.

La valeur comptable de la trésorerie, des montants à recevoir des courtiers, des souscriptions à recevoir, des intérêts et des dividendes à recevoir, des autres créances, de la dette bancaire, des montants à payer aux courtiers, des rachats à payer, des distributions à payer, des frais de gestion à payer, de la rémunération au rendement à payer et des charges à payer avoisine leur juste valeur compte tenu de leur nature à court terme. Ces instruments financiers sont classés au niveau 2 de la hiérarchie des justes valeurs parce que, même si des prix sont disponibles, il n'y a pas de marché actif pour ces instruments.

Évaluation de la juste valeur des dérivés et des titres qui ne sont pas cotés sur un marché actif

Pour les instruments financiers qui s'échangent rarement et dont le prix est peu transparent, la juste valeur est moins objective et fait appel à divers degrés de jugement en fonction de la liquidité, de l'incertitude des facteurs de marché, des hypothèses d'évaluation et d'autres risques qui ont une incidence sur l'instrument en question.

Les Fonds utilisent des modèles d'évaluation généralement reconnus, fondés uniquement sur des données de marché observables et exigeant peu de jugements et d'estimations de la part de la direction, pour déterminer la juste valeur des instruments financiers, comme les contrats à terme normalisés, les options, les contrats à terme ou les contrats de swap. Les cours et les données des modèles observables sont habituellement accessibles sur le marché pour les titres de créance et les titres de capitaux propres cotés, pour les dérivés négociés en bourse, comme les contrats à terme normalisés et les options, et pour les dérivés négociés hors cote, comme les contrats à terme et les contrats de swap. L'accessibilité des cours du marché et des données d'entrée observables réduit la nécessité des jugements et des estimations de la direction ainsi que l'incertitude associée à la détermination de la juste valeur.

Si des données de différents niveaux sont utilisées pour évaluer la juste valeur d'un actif ou d'un passif, selon la hiérarchie des justes valeurs, le classement repose sur le plus bas niveau auquel correspondent les données importantes utilisées aux fins de cette évaluation.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Classement des placements selon la hiérarchie des justes valeurs

Les titres de capitaux propres (y compris les fiducies de revenu, les fonds négociés en bourse et les sociétés en commandite) sont classés au niveau 1 lorsqu'ils sont activement négociés et qu'un cours fiable est observable. S'ils ne sont pas activement négociés et que des cours observables ne sont pas disponibles, la juste valeur est établie au moyen de données de marché observables (par exemple, des transactions pour des titres similaires du même émetteur) et classée au niveau 2, à moins que le calcul exige un nombre important de données non observables, auquel cas l'évaluation est classée au niveau 3.

Les obligations et les titres adossés à des créances hypothécaires sont principalement des obligations d'État et de sociétés et les titres adossés à des créances hypothécaires, qui sont évalués à l'aide de modèles dont les données comprennent les courbes de taux, les écarts de taux et les volatilités. Les données importantes pour l'évaluation étant généralement observables, les placements du Fonds dans des obligations et des titres adossés à des créances hypothécaires ont été classés au niveau 2.

Les placements à court terme sont classés au niveau 2, puisqu'ils sont comptabilisés au coût amorti, lequel avoisine la juste valeur.

Les parts de fonds en gestion commune, s'il y en a, détenues à titre de placement sont classées au niveau 2 étant donné que leur juste valeur est établie selon la valeur liquidative des fonds en question.

Les actifs et les passifs dérivés sont des contrats de change à terme, des contrats à terme sur obligations et des contrats de swap, évalués principalement en fonction du notionnel du contrat, de l'écart entre le taux du contrat et celui du marché à terme pour la même devise, des taux d'intérêt et des écarts de taux. Les contrats dont les écarts de taux des contreparties sont observables et fiables, ou dont les données liées au crédit ne sont pas considérées comme importantes pour évaluer la juste valeur, sont classés au niveau 2.

Les contrats à terme et les contrats sur indice CDX normalisés sont classés au niveau 1, car les cours utilisés reposent sur des données de marché observables.

Les bons de souscription sont classés au niveau 1, à moins qu'aucun cours observable ne soit disponible. Dans ce cas, la juste valeur est établie au moyen de données de marché observables et les bons de souscription sont classés au niveau 2.

6 Parts rachetables des Fonds

Chaque Fonds offre au public trois séries de parts rachetables par voie de prospectus : les séries A, F et I. Les Fonds ont autorisé un nombre illimité de séries de parts et peuvent émettre un nombre illimité de parts de chaque série. Toutes les parts émises sont entièrement libérées et sont inscrites dans le registre officiel des porteurs de parts, tenu à jour par Fiducie RBC Services aux investisseurs, fiduciaire des Fonds. Les parts des Fonds sont vendues, et sont rachetables au gré du porteur à la valeur liquidative par part en vigueur, conformément aux dispositions de la déclaration de fiducie. Les Fonds ne sont soumis à aucune restriction ni exigence particulière en matière de capital en ce qui concerne la souscription et le rachat de parts.

Les fluctuations pertinentes sont présentées dans l'état de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables. Toutefois, les échanges entre les différentes séries de chaque Fonds ne sont pas inscrits dans les postes « Produit de l'émission de parts rachetables » et « Rachat de parts rachetables » du tableau des flux de trésorerie. Conformément à leurs politiques de gestion des risques énoncées à la note 10 et à leurs objectifs, les Fonds visent à investir les souscriptions reçues dans des placements appropriés, tout en maintenant une liquidité suffisante pour les rachats. La liquidité est maintenue par la cession de titres négociables au besoin.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

7 Imposition des Fonds

Les Fonds peuvent avoir des pertes en capital inutilisées pouvant être reportées indéfiniment pour réduire leurs futurs gains en capital nets réalisés, de même que des pertes autres qu'en capital inutilisées pouvant être déduites des revenus de placement futurs aux fins de l'impôt, comme il est expliqué dans les notes propres à chaque Fonds.

Certains revenus de dividendes, revenus d'intérêts et revenus tirés du prêt de titres reçus par les Fonds sont assujettis à une retenue d'impôt dans le pays d'origine. Ces revenus et ces gains sont comptabilisés au montant brut, et les retenues d'impôt connexes sont présentées séparément dans l'état du résultat global.

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, les Fonds ont passé en revue les passifs d'impôt éventuels et les traitements fiscaux incertains, ainsi que les intérêts et pénalités, et ils ont déterminé qu'aucun montant ne devait être comptabilisé à l'égard de ces éléments.

8 Transactions avec des parties liées et autres charges

Frais de gestion

Les frais de gestion peuvent être facturés aux Fonds ou directement aux porteurs de parts par le gestionnaire, comme il est expliqué dans les notes propres au Fonds. Le gestionnaire a la responsabilité de gérer le portefeuille de placements, d'analyser les placements et de formuler des recommandations, de prendre des décisions de placement, de conclure des arrangements de courtage liés à la vente et à l'achat de titres en portefeuille et de conclure des ententes avec les courtiers inscrits pour l'achat et la vente de parts du Fonds par les investisseurs.

Rémunération au rendement

La rémunération au rendement peut être facturée aux Fonds ou directement aux porteurs de parts par le gestionnaire, comme il est expliqué dans les notes propres aux Fonds, le cas échéant.

Honoraires du comité d'examen indépendant

Conformément au Règlement 81-107, les Fonds ont mis en place un comité d'examen indépendant (le « CEI »). Le CEI sert tous les fonds CC&L visés. Les Fonds paient une partie des charges du CEI pour les services de gouvernance sur les questions de conflits d'intérêts des Fonds. Les coûts liés au CEI sont partagés entre les fonds pour lesquels le CEI fournit des services de gouvernance.

Autres charges

Les Fonds sont responsables des honoraires des auditeurs, des droits de garde, des coûts d'information aux porteurs de titres et de toute autre charge engagée directement pour leurs activités.

Placements dans des parties liées

Les Fonds peuvent faire des placements dans des fonds gérés par le gestionnaire ou par des entités liées au gestionnaire du fait d'une propriété commune.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

9 Commissions de courtage et accords de paiement indirect

Le gestionnaire peut sélectionner des courtiers qui facturent une commission constituant des « paiements indirects » s'il détermine de bonne foi que la commission est raisonnable au regard des services d'exécution d'ordres et des services de recherche utilisés. L'accord de paiement indirect permet de rémunérer le courtier pour les produits et services qu'il fournit (par exemple, des rapports de recherche) en lui confiant des transactions (par exemple, l'exécution des opérations). Les gestionnaires des Fonds peuvent affecter les paiements indirects au paiement d'une partie des commissions de courtage.

10 Gestion des risques financiers

Les Fonds peuvent être exposés à divers risques financiers, décrits ci-dessous. L'exposition des Fonds à ces risques est surtout liée à ses placements, y compris dans des instruments dérivés, le cas échéant. Pour déterminer les risques qui s'appliquent, et dans quelle mesure, il convient de consulter l'inventaire du portefeuille et les annexes complémentaires, le cas échéant, où les titres sont regroupés par catégorie d'actifs, par segment de marché et par région (s'ils sont libellés dans plusieurs devises). Le gestionnaire vise à gérer les effets potentiels de ces risques financiers sur le rendement des Fonds en embauchant et en supervisant des gestionnaires de portefeuille professionnels et expérimentés, qui effectuent un suivi régulier des placements des Fonds, de l'évolution du marché et de la conjoncture économique globale.

Les gestionnaires de portefeuille utilisent divers moyens pour assurer le suivi des Fonds, notamment l'évaluation de variables financières et économiques particulières pertinentes pour les Fonds. Le programme de gestion des risques des Fonds est fondé sur le contrôle de la conformité aux directives de placement présentées dans l'énoncé de politique de placement. L'énoncé de politique de placement est un document interne qui décrit le mode de gestion des Fonds. Il indique l'objectif de placement de chaque Fonds et les directives de placement. Les directives portent notamment sur les placements autorisés, les niveaux acceptables de diversification et les utilisations autorisées des dérivés.

Les titres sont sélectionnés dans l'optique de maximiser les rendements sans sortir des paramètres de gestion des risques définis dans l'énoncé de politique de placement. Les positions des Fonds font l'objet d'un suivi quotidien, à l'aide d'un système électronique de conformité, qui a pour but de vérifier que les directives et autres restrictions sont respectées et de garantir que, compte tenu des fluctuations du marché, les composantes des portefeuilles des Fonds ne s'écartent pas de fourchettes précises. Des mesures correctives sont prises au besoin, et les contraventions aux directives sont signalées au gestionnaire.

Les Fonds peuvent être exposés indirectement aux risques ci-dessous par leurs placements dans des FNB et dans des fonds sous-jacents.

Les incertitudes économiques quant aux pressions inflationnistes persistantes, à la reprise postérieure à la pandémie mondiale, aux événements géopolitiques, aux changements climatiques et aux catastrophes naturelles en cours pourraient ralentir la croissance de l'économie mondiale. L'établissement d'estimations fiables et l'exercice du jugement demeurent très complexes. Les résultats réels peuvent différer de ces estimations et hypothèses.

Voir les notes propres au Fonds pour obtenir des informations concernant leurs risques spécifiques.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Risque de change

Le risque de change est le risque que la valeur des actifs et des passifs monétaires libellés dans d'autres monnaies que le dollar canadien (la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation des Fonds) varie par suite de la fluctuation des taux de change. L'inventaire du portefeuille et les annexes complémentaires indiquent tous les placements et les instruments dérivés libellés en devises. Les obligations et les placements à court terme émis dans un pays étranger sont exposés à la devise de ce pays, à moins d'indication contraire. Les obligations, les placements à court terme et les dérivés libellés en devises sont exposés au risque de change, leurs prix étant convertis dans la monnaie fonctionnelle des Fonds au moment d'établir leur juste valeur. Les actions étrangères ne sont pas exposées au risque de change, car elles sont considérées comme des placements non monétaires. La variation de la valeur de marché de ces titres attribuable aux fluctuations des taux de change est considérée comme faisant partie de l'autre risque de prix (voir ci-après).

Le gestionnaire de portefeuille peut, à son gré, avoir recours à des stratégies de couverture pour réduire au minimum l'exposition au risque de change.

Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt est le risque que la juste valeur des placements portant intérêt varie par suite de la fluctuation des taux d'intérêt en vigueur. Plus son échéance est longue, toutes choses étant égales par ailleurs, plus un titre est sensible au risque de taux d'intérêt. L'exposition des Fonds au risque de taux d'intérêt est liée à ses placements dans des titres de créance (comme les obligations et les placements à court terme) et aux instruments dérivés de taux d'intérêt (le cas échéant). Les autres actifs et passifs ont une échéance à court terme et ne portent pas intérêt.

Dans une certaine mesure, les Fonds peuvent également détenir des titres de créance à taux variable, de la trésorerie et des placements à court terme, qui les exposeraient au risque de taux d'intérêt lié aux flux de trésorerie. Les Fonds sont exposés directement aux variations des taux d'intérêt en ce qui concerne l'évaluation et les flux de trésorerie des actifs et des passifs portant intérêt. Les Fonds pourraient aussi être indirectement exposés à l'effet de ces variations sur les bénéfices de sociétés dans le portefeuille. C'est pour cette raison que l'analyse de sensibilité pourrait ne pas refléter parfaitement l'incidence des variations futures des taux d'intérêt sur l'actif net attribuable aux porteurs d'actions ou de parts rachetables des Fonds.

Le gestionnaire de portefeuille vise pour les Fonds une durée qui respecte les niveaux de tolérance propres à l'indice de référence sous réserve d'indications contraires dans l'énoncé de politique de placement, afin de réduire l'exposition au risque de taux d'intérêt.

Une réforme fondamentale des principaux taux d'intérêt de référence est en cours à l'échelle mondiale; celle-ci vise à remplacer certains taux interbancaires offerts (« TIO ») par d'autres taux d'intérêt à risque quasi nul. Cette réforme des TIO a une incidence sur les Fonds par le truchement de leurs placements dans des dérivés et de leurs emprunts en trésorerie auprès de contreparties. Les placements dans les dérivés peuvent inclure des contrats de swap sur rendement total et des contrats de swap de taux d'intérêt.

Le principal risque auquel les Fonds sont exposés en raison de la réforme des TIO est le risque d'exploitation, lequel découle de l'identification des taux assujettis à la réforme et de la mise à jour des systèmes et des sommaires des modalités concurremment aux contreparties. Le risque financier se limite au risque de taux d'intérêt.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Le gestionnaire surveille et gère, pour le compte des Fonds, la transition vers d'autres taux d'intérêt de référence, et il a fait d'importants progrès à cet égard. Au 30 juin 2023, les Fonds pouvaient être exposés aux TIO de référence suivants dans le cadre de la transition :

Taux d'intérêt de référence actuel	Incidence de la réforme	Nouveau taux de référence
Dollar américain – taux interbancaire offert à Londres (ICE LIBOR) à 1 mois	Ce taux cessera d'être publié après le 30 juin 2023.	Taux de financement à un jour garanti (SOFR)
Taux CDOR à 3 mois	Il a été recommandé de cesser la publication de ce taux après le 30 juin 2024.	Taux des opérations de pension à un jour (CORRA)

Après le 30 juin 2023, le gestionnaire a remplacé le taux interbancaire offert à Londres (ICE LIBOR) à 1 mois en dollars américains par le SOFR, et il s'attend à ce que tout soit prêt bien avant la date d'expiration du taux CDOR à 3 mois dans le cadre de la réforme.

Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la juste valeur des instruments financiers varie par suite de la fluctuation des cours (autre que celle découlant du risque de change ou du risque de taux d'intérêt) causée par des facteurs propres à un instrument financier donné ou à son émetteur ou par des facteurs touchant tous les instruments financiers similaires négociés sur un marché.

Une volatilité ou une illiquidité inattendues pourraient survenir, notamment en raison de faits nouveaux juridiques, politiques, réglementaires, économiques ou autres, comme des urgences de santé publique, y compris une épidémie ou une pandémie, des catastrophes naturelles, des guerres et des risques géopolitiques connexes, et pourraient nuire à la capacité du gestionnaire de portefeuille à mettre en œuvre les objectifs des Fonds ou faire en sorte que les Fonds subissent des pertes. Il est impossible de prédire la durée et l'incidence définitive de telles conditions sur les marchés, ni à quel point la situation pourrait se détériorer.

Le gestionnaire de portefeuille respecte des restrictions précises en matière de placement en ce qui a trait aux catégories d'actifs et à la diversification, ce qui réduit au minimum l'exposition à l'autre risque de prix.

Les autres actifs et passifs sont des éléments monétaires qui ont une échéance à court terme et qui ne sont pas exposés à l'autre risque de prix.

Risque de crédit

Le risque de crédit est le risque qu'une perte résulte de l'incapacité d'un émetteur ou d'une partie à un instrument financier de respecter ses obligations financières. Afin de maximiser la qualité de crédit de ses placements, le gestionnaire de portefeuille du Fonds procède régulièrement à des évaluations de la solvabilité des émetteurs. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur. Le risque de crédit peut aussi découler des contreparties aux contrats à terme et aux contrats de swap. L'exposition au risque de crédit pour les instruments dérivés hors cote correspond au gain latent des Fonds au titre des obligations contractuelles avec la contrepartie à la date de clôture. L'exposition au risque de crédit des autres actifs est représentée par leur valeur comptable.

Les Fonds évaluent le risque de crédit et les pertes de crédit attendues à l'aide des mesures suivantes : la probabilité de défaillance, l'exposition en cas de défaillance et la perte en cas de défaillance. Pour établir les pertes de crédit attendues, le gestionnaire se fonde à la fois sur des analyses historiques et sur des informations prospectives. Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, la totalité des autres créances, des montants à recevoir de courtiers, de la trésorerie et des dépôts à court terme étaient détenus soit par des contreparties ayant une notation allant de AAA à A, soit par des contreparties non notées. Le risque de crédit lié aux transactions non réglées est considéré comme peu élevé en raison de la brièveté de la période de règlement en cause. Le gestionnaire pense que la probabilité de défaillance de ces instruments est presque nulle, car la capacité des contreparties à s'acquitter de leurs obligations contractuelles à court terme est élevée.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

Les notations sont déterminées à partir d'une combinaison des notations attribuées par diverses agences, comme Standard & Poor's, Moody's et Dominion Bond Rating Services, et peuvent être modifiées sans préavis.

Les Fonds peuvent également être exposés au risque de crédit dans la mesure où leur dépositaire ne peut pas effectuer le règlement des opérations en trésorerie. Le dépositaire des Fonds, RBC Services aux investisseurs et de trésorerie, satisfait à toutes les exigences des Autorités canadiennes en valeurs mobilières pour agir à titre de dépositaire.

Risque de liquidité

Le risque de liquidité est le risque que les Fonds ne soient pas en mesure d'effectuer leurs règlements ou de s'acquitter de leurs obligations à temps ou à un prix raisonnable. Les Fonds sont principalement exposés au risque de liquidité en raison des rachats quotidiens de parts rachetables en espèces, à la demande des porteurs. La liquidité de certains des titres détenus par les Fonds qui peuvent devoir être vendus afin de respecter les obligations à court terme, plus particulièrement les titres à revenu fixe non émis par des gouvernements qui se trouvent dans l'inventaire du portefeuille, est sensible aux mouvements négatifs rapides des marchés. Comme pour tous les titres à revenu fixe, la valeur de marché de ces titres est fondée sur une prime de risque de crédit, aussi appelée « écart de taux ». Plus le risque de crédit associé à un titre est important, plus l'écart de taux exigé par les porteurs est élevé. Il existe une corrélation négative entre l'importance de l'écart de taux et la valeur ou le prix du titre sous-jacent.

Les Fonds peuvent être exposés au risque de liquidité en raison de leurs placements dans des fonds sous-jacents. Les fonds sous-jacents investissent la plupart de leurs placements dans des titres négociés sur un marché actif et qui peuvent être facilement liquidés pour maintenir leur liquidité.

Les Fonds conservent suffisamment de trésorerie, de placements à court terme et de titres négociables cotés qui peuvent être facilement vendus pour maintenir leur liquidité. Le risque de liquidité est considéré comme négligeable. Les passifs financiers des Fonds sont tous à court terme par nature, et ils devraient arriver à échéance dans les trois mois suivant la date de clôture des états financiers au 30 juin 2023, à l'exception des parts rachetables, qui sont remboursables à vue, des positions vendeur sur obligations et de certains dérivés. Au 31 décembre 2022, tous les passifs financiers des Fonds venaient à échéance dans les trois mois suivant la date des états financiers.

Risque de concentration

Le risque de concentration découle de la concentration d'expositions à des risques dans une même catégorie, qu'il s'agisse d'une région, d'un type d'actif ou d'un secteur.

Le gestionnaire de portefeuille respecte des restrictions précises en matière de placement en ce qui a trait aux catégories d'actifs et à la diversification, ce qui réduit au minimum l'exposition au risque de concentration.

L'inventaire du portefeuille décrit en détail l'exposition des Fonds au risque de concentration au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022.

Gestion du risque lié au capital

Les parts rachetables émises et en circulation sont considérées comme le capital des Fonds. Les Fonds ne sont soumis à aucune restriction d'origine externe ou interne en ce qui concerne leur capital. Chaque part est rachetable au gré du porteur, conformément à la déclaration de fiducie, et confère à ce dernier une quote-part proportionnelle de la valeur liquidative du Fonds en cause. Les porteurs de parts ont droit aux distributions déclarées. Les distributions sur les parts des Fonds sont réinvesties dans des parts additionnelles des Fonds ou, à la demande des porteurs de parts, versées en espèces.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

11 Placements dans des entités structurées

Les Fonds ont déterminé que tous les fonds sous-jacents en gestion commune dans lesquels ils investissent sont des entités structurées non consolidées. L'exposition aux placements dans des fonds sous-jacents est présentée dans les notes propres au Fonds.

Les Fonds ont déterminé que tous les titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs dans lesquels ils investissent étaient des entités structurées non consolidées. Parmi ces titres on compte des titres adossés à des créances hypothécaires à flux identiques, des titres garantis par des créances hypothécaires, des titres adossés à des créances hypothécaires commerciales, des titres adossés à des actifs, des titres garantis par des créances et d'autres titres qui représentent une participation directe ou indirecte dans des prêts hypothécaires sur des biens immobiliers, ou qui sont garantis par de tels biens ou qui sont à payer sur de tels biens. Les titres de créance et de capitaux propres émis en lien avec ces titres peuvent comprendre des tranches ayant divers degrés de subordination. Ces titres peuvent donner lieu à un paiement mensuel d'intérêts et de capital. 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 établissements d'épargne et de crédit, des institutions de crédit hypothécaire, des banques commerciales et d'autres institutions. Les titres adossés à des actifs sont créés à partir de divers types d'actifs, dont des prêts automobiles, des créances sur cartes de crédit, des prêts sur l'avoir net foncier et des prêts aux étudiants.

Les Fonds ont déterminé que tous les fonds négociés en bourse dans lesquels ils investissaient étaient des entités structurées non consolidées. Les Fonds peuvent investir dans des fonds négociés en bourse, qui permettent d'obtenir les rendements d'indices boursiers, d'indices obligataires ou d'un panier d'actifs et servent à reproduire l'incidence économique d'une acquisition directe par les Fonds de l'actif ou du panier d'actifs sous-jacents. Un placement dans un fonds négocié en bourse est exposé à tous les risques associés à un placement dans les titres détenus par ce fonds.

Les placements dans des fonds sous-jacents en gestion commune sont présentés à la juste valeur dans les notes propres au Fonds. La perte maximale provenant de ces placements correspond à leur valeur comptable totale. La pondération des titres adossés à des créances hypothécaires et des titres adossés à des actifs, présentée dans l'inventaire du portefeuille, le cas échéant, représente le risque de perte maximal à la date des états financiers.

Les Fonds comptabilisent ces placements dans des entités structurées non consolidées à la juste valeur. La juste valeur de ces titres, présentée dans l'inventaire du portefeuille, le cas échéant, représente le risque de perte maximal à la date des états financiers.

Au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022, les Fonds n'ont pas soutenu financièrement d'entités structurées non consolidées et ils n'ont pas l'intention d'offrir un soutien financier ou d'une autre nature.

12 Prêt de titres

Les Fonds peuvent conclure un programme de prêt de titres avec leur dépositaire, RBC Services aux investisseurs et de trésorerie, afin de dégager des revenus supplémentaires. La valeur de marché de tous les titres prêtés par chaque Fonds ne doit pas dépasser 50 % de la juste valeur de ses actifs. Les Fonds reçoivent une garantie correspondant à au moins 105 % de la juste valeur des titres prêtés. La garantie consiste essentiellement en des titres à revenu fixe. Les revenus tirés du prêt de titres sont présentés à l'état du résultat global après déduction du montant des charges liées au prêt de titres que le dépositaire des Fonds est en droit de recevoir.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2023 et 2022 (non audité)

13 Effet de levier et emprunt

L'effet de levier se produit lorsqu'un Fonds emprunte de l'argent ou des titres, ou utilise des dérivés, dans le but de générer une exposition plus importante que le montant investi.

L'effet de levier de chaque Fonds est établi en calculant l'exposition totale, qui équivaut à la somme de :

- i) la valeur de marché des positions vendeur du Fonds;
- ii) le montant en trésorerie emprunté aux fins d'investissement;
- iii) la valeur notionnelle des positions en dérivés spécifiques, à l'exception des positions en dérivés spécifiques utilisées à des fins de couverture.

Cette exposition ne doit pas excéder 300 % de la valeur liquidative de chaque Fonds.

Si un Fonds a l'autorisation d'utiliser l'effet de levier et fait des ventes à découvert (tel que décrit dans l'énoncé de politique de placement du Fonds), le gestionnaire nommera un ou plusieurs courtiers principaux comme dépositaires. Par conséquent, la totalité ou une partie de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds peut être détenue dans des comptes de courtiers principaux. L'utilisation d'un compte de courtier principal permet une moins grande ségrégation des actifs du Fonds que les opérations de garde conventionnelles. Le courtier principal peut aussi prêter, céder en garantie ou hypothéquer ces actifs, ce qui peut entraîner leur perte. En conséquence, ces actifs peuvent être gelés ou non disponibles pour un retrait ou une opération pendant une longue période si le courtier principal éprouve des difficultés financières. Dans une telle éventualité, le Fonds pourrait subir des pertes en raison d'un manque d'actifs dans le compte du courtier principal pour payer leurs créanciers et faire face aux mouvements défavorables du marché alors que leurs titres ne peuvent être négociés.