



CONNOR, CLARK & LUNN

FONDS

ÉTATS FINANCIERS SEMESTRIELS (NON AUDITÉ)

30 juin 2022

- **Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L**
- **Fonds alternatif d'actions canadiennes 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 alternatif d'actions mondiales CC&L	3
Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L	100
Fonds alternatif de revenu CC&L.....	184
Fonds de rendement absolu PCJ II.....	203
Notes annexes.....	219

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

États de la situation financière aux

	30 juin 2022 (non audité)	31 décembre 2021 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	2 635 658 \$	551 929 \$
Placements	24 548 938	36 503 976
Plus-value latente des contrats de change à terme	24 659	14 436
Plus-value latente des contrats de swap	709 100	549 356
Marge de variation quotidienne	2 118 689	2 381 898
Montant à recevoir du courtier	445 837	1 357 250
Dividendes à recevoir	83 402	43 627
	30 566 283	41 402 472
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	2 824 387	2 385 832
Placements vendus à découvert	6 262 228	9 040 374
Moins-value latente des contrats de change à terme	23 454	16 331
Moins-value latente des contrats de swap	693 551	445 883
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	27 754	7 493
Montant à payer au courtier	456 627	1 220 385
Frais d'emprunt de titres à payer	10 278	5 635
Charges à payer	35 412	42 961
Frais de gestion à payer	1 750	1 982
Rémunération au rendement à payer	6 389	17 346
	10 341 830	13 184 222
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	20 224 453 \$	28 218 250 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	135 983 \$	164 703 \$
Série F	2 862 812 \$	3 922 852 \$
Série I	17 225 658 \$	24 130 695 \$
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	13 477	13 355
Série F	285 676	321 623
Série I	1 704 307	1 970 842
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	10,09 \$	12,33 \$
Série F	10,02 \$	12,20 \$
Série I	10,11 \$	12,24 \$

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

Administrateur

« Tim Elliott »

Administrateur

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2022	2021
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	1 311 \$	73 806 \$
Variation du gain (perte) de change latent	(33 937)	748
Charges d'intérêts négatives	(10 968)	–
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	887	713
Autres revenus (pertes)	504	–
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	393 102	292 442
Charges de dividendes sur les titres vendus à découvert	(90 170)	(33 715)
Intérêts aux fins des distributions	2 212	114
Gain (perte) net réalisé sur les placements	(746 970)	2 664 778
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	686 876	(462 722)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	(46 739)	(38 388)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	45 815	(92 564)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	(7 286)	596 709
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	(5 632 007)	437 024
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	1 187 106	244 778
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	3 100	50 176
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	(87 924)	(73 675)
Gain (perte) net total sur placements	(4 292 885)	3 584 957
Total des revenus (pertes) nets	(4 335 088)	3 660 224
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	13 191	10 172
Honoraires des dépositaires	36 511	25 504
Frais de dépôt	22 251	18 885
Honoraires du comité d'examen indépendant	2 480	2 476
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	321	313
Charges d'intérêts	10 442	10 574
Frais de gestion	10 951	8 274
Rémunération au rendement	6 549	20 199
Coût d'emprunt de titres	58 058	35 829
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	4 388	4 050
Coûts d'opérations (note 9)	36 316	26 797
Total des charges d'exploitation	201 458	163 073
Retenues d'impôts (note 7)	(51 935)	(39 098)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(4 588 481) \$	3 458 053 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	(30 058) \$	16 674 \$
Série F	(656 979) \$	359 375 \$
Série I	(3 901 444) \$	3 082 004 \$
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	13 799	10 447
Série F	304 154	217 714
Série I	1 785 020	1 688 919
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	(2,18) \$	1,60 \$
Série F	(2,16) \$	1,65 \$
Série I	(2,19) \$	1,82 \$

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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 2022	Série A 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	164 703 \$	90 767 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(30 058)	16 674
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	15 000	42 782
Rachat de parts rachetables	(13 662)	–
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	1 338	42 782
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(28 720)	59 456
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	135 983 \$	150 223 \$
	Série F 2022	Série F 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	3 922 852 \$	3 250 077 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(656 979)	359 375
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	242 732	1 581 632
Rachat de parts rachetables	(645 793)	(2 573 515)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(403 061)	(991 883)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(1 060 040)	(632 508)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	2 862 812 \$	2 617 569 \$

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 2022	Série I 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	24 130 695 \$	19 167 170 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(3 901 444)	3 082 004
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	591	571 401
Rachat de parts rachetables	(3 004 184)	(1 107 575)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(3 003 593)	(536 174)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(6 905 037)	2 545 830
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	17 225 658 \$	21 713 000 \$
	Total 2022	Total 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	28 218 250 \$	22 508 014 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(4 588 481)	3 458 053
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	258 323	2 195 815
Rachat de parts rachetables	(3 663 639)	(3 681 090)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(3 405 316)	(1 485 275)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(7 993 797)	1 972 778
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	20 224 453 \$	24 480 792 \$

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2022	2021
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(4 588 481) \$	3 458 053 \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	33 937	(748)
(Gain) perte net réalisé sur les placements	746 970	(2 664 778)
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	(686 876)	462 722
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	5 632 007	(437 024)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	(1 187 106)	(244 778)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	(3 100)	(50 176)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	87 924	73 675
Achat de placements	(67 843 094)	(76 082 661)
Produit de la vente de placements	72 662 646	77 425 724
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	263 209	580 687
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(39 775)	(19 220)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	4 643	1 821
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	20 261	2 441
Augmentation (diminution) des charges à payer	(7 549)	(15 357)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(232)	(253)
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	(10 957)	8 085
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	5 084 427	2 498 213
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables	258 323	2 195 315
Rachat de parts rachetables	(3 663 639)	(3 681 090)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(3 405 316)	(1 485 775)
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	1 679 111	1 012 438
Variation du gain (perte) de change latent	(33 937)	748
Trésorerie, à l'ouverture de la période	551 929	51 399
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	(2 385 832)	(3 101 848)
	(188 729)	(2 037 263)
Trésorerie, à la clôture de la période	2 635 658 \$	675 535 \$
Dette bancaire, à la clôture de la période	(2 824 387) \$	(2 712 798) \$
	(188 729) \$	(2 037 263) \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	301 483 \$	234 135 \$
Dividendes payés*	69 909	31 274
Intérêts reçus*	2 212	114
Intérêts payés*	10 442	10 574

* Inclus dans les activités d'exploitation.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Actions canadiennes – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2021 : 2,40 %)				
ARC Resources Ltd.	2 843	44 430	46 142	
Athabasca Oil Corp.	3 300	4 215	8 217	
Cardinal Energy Ltd.	4 200	19 467	30 366	
Cenovus Energy Inc.	3 278	52 883	80 278	
CES Energy Solutions Corp.	200	350	466	
Crew Energy Inc.	800	3 396	3 696	
Enerflex Ltd.	100	830	607	
Enerplus Corp.	3 186	25 030	54 194	
Ensign Energy Services Inc.	100	403	337	
Headwater Exploration Inc.	200	1 340	1 082	
Keyera Corp.	400	12 247	11 760	
MEG Energy Corp.	1 700	14 898	30 294	
NexGen Energy Ltd., TSE	6 000	36 725	27 720	
Parex Resources Inc.	2 300	36 746	50 140	
PrairieSky Royalty Ltd.	400	6 985	6 484	
Secure Energy Services Inc.	4 902	24 542	29 412	
Surge Energy Inc.	200	1 688	1 822	
Tamarack Valley Energy Ltd.	5 355	20 762	23 187	
Corporation TC Énergie	200	13 895	13 336	
Touchstone Exploration Inc.	400	661	456	
TransGlobe Energy Corp.	100	336	439	
Vaalco Energy Inc.	69	345	618	
Whitecap Resources Inc.	3 200	18 621	28 608	
		340 795	449 661	2,22
Matières premières (31 décembre 2021 : 3,42%)				
Argonaut Gold Inc.	1 700	5 666	765	
B2Gold Corp.	200	949	872	
Société aurifère Barrick	200	4 933	4 552	
Capstone Mining Corp.	100	549	325	
Cascades inc.	1 200	16 232	12 156	
Centerra Gold Inc.	5 500	51 417	48 015	
Eldorado Gold Corp.	200	2 111	1 642	
First Majestic Silver Corp.	500	5 122	4 615	
GCM Mining Corp.	1 000	5 723	3 510	
Hudbay Minerals Inc.	3 700	32 601	19 425	
IAMGOLD Corp.	2 400	9 954	4 968	
Interfor Corp.	600	21 838	15 564	
Ivanhoe Mines Ltd.	1 700	18 107	12 597	
Karora Resources Inc.	200	897	664	
Kinross Gold Corp.	10 100	73 160	46 258	
Labrador Iron Ore Royalty Corp.	1 600	57 494	45 360	
New Gold Inc.	1 200	2 696	1 644	
Novagold Resources Inc.	1 400	11 288	8 610	
OceanaGold Corp.	8 285	18 751	20 464	
Minière Osisko Inc.	800	3 074	2 448	
Pan American Silver Corp.	1 100	31 384	27 819	
Sabina Gold & Silver Corp.	300	394	318	
Silvercorp Metals Inc.	500	2 376	1 595	
SSR Mining Inc.	1 300	32 523	27 950	
Taseko Mines Ltd.	2 701	2 942	3 808	
Transcontinental Inc.	100	1 425	1 531	
Turquoise Hill Resources Ltd.	700	24 623	24 136	
Wesdome Gold Mines Ltd.	100	972	1 115	
West Fraser Timber Co., Ltd.	400	41 820	39 508	
Western Copper & Gold Corp.	200	401	354	
Western Forest Products Inc.	600	781	870	
Wheaton Precious Metals Corp.	300	16 792	13 914	
Yamana Gold Inc.	3 800	19 356	22 762	
		518 351	420 134	2,08

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Industries (31 décembre 2021 : 0,65 %)				
Air Canada	1 300	22 899	20 852	
ATS Automation Tooling Systems Inc.	1 900	86 773	67 165	
Bombardier Inc.	28	919	541	
Civeo Corp.	31	697	1 035	
Dexterra Group Inc.	100	355	553	
Doman Building Materials Group Ltd.	100	709	627	
GFL Environmental Inc.	500	18 586	16 580	
Magellan Aerospace Corp.	200	1 563	1 502	
NFI Group Inc.	200	4 035	2 678	
Stantec Inc.	400	24 927	22 556	
TFI International Inc., TSE	700	72 683	72 331	
Thomson Reuters Corp., TSE	600	80 436	80 514	
Waste Connections Inc.	100	14 958	15 960	
WSP Global Inc.	300	48 017	43 662	
		377 557	346 556	1,71
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 0,32 %)				
Aritzia Inc.	700	33 044	24 395	
BRP Inc.	200	20 635	15 844	
Les Industries Dorel Inc., cat B	900	8 929	5 814	
Martinrea International Inc.	300	2 542	2 493	
Restaurant Brands International Inc.	500	31 103	32 285	
Roots Corp.	500	1 465	1 560	
		97 718	82 391	0,41
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 0,40%)				
Empire Co., Ltd.	1 600	60 301	63 440	
Les Aliments Maple Leaf Inc.	100	2 494	2 531	
Rogers Sugar Inc.	100	530	605	
		63 325	66 576	0,33
Soins de santé (31 décembre 2021 : 0,05 %)				
BELLUS Santé inc.	2 200	17 482	26 070	
OrganiGram Holdings Inc.	2 500	7 345	2 950	
Sienna Senior Living Inc.	1 737	26 380	22 564	
Viemed Healthcare Inc.	100	578	696	
		51 785	52 280	0,26
Services financiers (31 décembre 2021 : 1,74 %)				
Banque Canadienne Impériale de Commerce	100	6 500	6 251	
CI Financial Corp.	3 400	79 531	46 478	
iA Société financière inc.	799	55 640	51 152	
Société financière IGM Inc.	300	13 427	10 350	
Groupe TMX Ltée	100	13 782	13 100	
La Banque Toronto-Dominion	300	25 590	25 323	
		194 470	152 654	0,75
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 0,32 %)				
Absolute Software Corp.	3 300	36 217	36 630	
Blackberry Ltd.	200	2 288	1 388	
Celestica Inc.	100	1 040	1 252	
Converge Technology Solutions Corp.	200	2 229	1 026	
Descartes Systems Group Inc.	600	52 458	47 994	
Quarterhill Inc.	300	441	558	
		94 673	88 848	0,44
Services de communication (31 décembre 2021 : 0,44 %)				
AcuityAds Holdings Inc.	700	2 033	2 114	
Aimia Inc.	300	1 120	1 380	
BCE Inc.	400	25 057	25 308	
Cogeco Communications inc.	300	30 326	26 121	
Corus Entertainment Inc.	4 200	21 362	14 826	
Shaw Communications Inc., cat. B	100	3 356	3 793	
TELUS Corp.	2 600	83 402	74 542	
		166 656	148 084	0,73
Services publics (31 décembre 2021 : 0,27 %)				
Algonquin Power & Utilities Corp.	4 000	74 296	69 200	
AltaGas Ltd.	600	17 207	16 296	
Brookfield Infrastructure Corp.	750	46 097	40 973	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Emera Inc.	300	18 199	18 090	
Polaris Infrastructure Inc.	100	1 831	1 947	
Superior Plus Corp.	500	5 830	5 680	
		163 460	152 186	0,75
Immobilier (31 décembre 2021 : 0,73 %)				
Groupe Altus limitée	340	21 080	15 161	
FirstService Corp.	300	62 598	46 842	
FPI Granite	600	56 857	47 370	
Killam Apartment REIT	900	19 077	15 435	
Summit Industrial Income REIT	3 000	64 090	51 330	
		223 702	176 138	0,87
Total des actions canadiennes – position acheteur		2 292 492	2 135 508	10,55
Actions canadiennes – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2021 : -1,26 %)				
Birchcliff Energy Ltd.	(200)	(2 138)	(1 750)	
Corporation Cameco, TSE	(1 400)	(45 380)	(37 884)	
Canacol Energy Ltd.	(2 600)	(7 708)	(6 552)	
Canadian Natural Resources Ltd.	(200)	(13 029)	(13 834)	
Computer Modelling Group Ltd.	(3 400)	(19 446)	(16 524)	
Crescent Point Energy Corp.	(300)	(3 274)	(2 745)	
Denison Mines Corp.	(33 700)	(64 355)	(42 799)	
Energy Fuels Inc., NYSE	(6 292)	(49 093)	(39 852)	
Energy Fuels Inc., TSE	(1 500)	(15 738)	(9 510)	
North American Construction Group Ltd.	(100)	(1 413)	(1 413)	
Pason Systems Inc.	(2 000)	(12 014)	(29 180)	
Shawcor Ltée	(1 200)	(6 567)	(6 852)	
Total Energy Services Inc.	(400)	(2 765)	(2 988)	
Tourmaline Oil Corp.	(100)	(7 133)	(6 693)	
Trican Well Service Ltd.	(1 400)	(5 851)	(5 166)	
Ur-Energy Inc.	(2 300)	(2 632)	(3 105)	
Vermilion Energy Inc.	(2 800)	(60 649)	(68 600)	
		(319 185)	(295 447)	(1,46)
Matières premières (31 décembre 2021 : -2,16 %)				
Mines Agnico Eagle Ltée	(700)	(46 178)	(41 244)	
Alexco Resource Corp	(1 800)	(3 921)	(900)	
Americas Gold & Silver Corp.	(7 200)	(21 892)	(6 480)	
Calibre Mining Corp.	(200)	(272)	(194)	
Canfor Pulp Products Inc.	(500)	(4 627)	(2 500)	
Equinox Gold Corp.	(1 300)	(9 593)	(7 462)	
Fortuna Silver Mines Inc.	(13 100)	(66 744)	(47 946)	
Galiano Gold Inc.	(4 300)	(3 654)	(2 279)	
Jaguar Mining Inc.	(500)	(1 995)	(1 420)	
Largo Inc.	(100)	(905)	(879)	
Lithium Americas Corp.	(900)	(31 887)	(23 337)	
Lundin Gold Inc.	(1 100)	(11 502)	(10 164)	
MAG Silver Corp.	(1 200)	(25 722)	(18 852)	
Major Drilling Group International Inc.	(1 800)	(16 988)	(16 254)	
Maverix Metals Inc.	(100)	(580)	(558)	
Methanex Corp.	(400)	(25 695)	(19 668)	
Nevada Copper Corp.	(500)	(377)	(130)	
Northern Dynasty Minerals Ltd.	(23 800)	(24 164)	(7 616)	
Novo Resources Corp.	(300)	(392)	(132)	
Nutrien Ltd.	(500)	(52 393)	(51 255)	
Orla Mining Ltd.	(1 200)	(5 677)	(4 224)	
Redevances aurifères Osisko Ltée	(400)	(5 470)	(5 192)	
Platinum Group Metals Ltd.	(600)	(1 492)	(1 008)	
SilverCrest Metals Inc.	(4 124)	(45 965)	(32 456)	
Skeena Resources Ltd.	(600)	(6 058)	(4 080)	
Ressources Teck Ltée	(800)	(35 076)	(31 488)	
Victoria Gold Corp.	(1 300)	(20 451)	(12 987)	
		(469 670)	(350 705)	(1,73)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Industries (31 décembre 2021 : -1,01 %)				
CAE inc., TSE	(200)	(6 440)	(6 344)	
Chorus Aviation Inc.	(6 800)	(21 436)	(22 236)	
DIRTT Environmental Solutions	(6 086)	(29 074)	(8 520)	
Exchange Income Corp.	(1 000)	(42 664)	(42 140)	
K-Bro Linen Inc.	(400)	(14 991)	(12 932)	
Corporation Internationale Masonite	(2)	(303)	(198)	
PyroGenèse Canada Inc.	(8 600)	(32 753)	(21 414)	
Corporation Savaria	(200)	(3 544)	(2 608)	
Transat AT inc.	(1 600)	(6 696)	(5 728)	
Westport Fuel Systems Inc.	(1 700)	(3 567)	(2 193)	
Xebec Adsorption Inc.	(10 800)	(30 382)	(8 964)	
		(191 850)	(133 277)	(0,66)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -0,74 %)				
Bragg Gaming Group Inc.	(100)	(655)	(594)	
Canada Goose Holdings Inc.	(1 000)	(34 521)	(23 220)	
Diversified Royalty Corp.	(500)	(1 387)	(1 290)	
ElectraMeccanica Vehicles Corp.	(19 024)	(74 608)	(33 129)	
Fire & Flower Holdings Corp.	(1 100)	(3 263)	(2 684)	
Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	(1 100)	(44 624)	(40 755)	
Goodfood Market Corp.	(5 500)	(24 394)	(8 800)	
Magna International Inc.	(300)	(25 245)	(21 204)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.	(1 400)	(72 443)	(71 750)	
Park Lawn Corp.	(100)	(3 414)	(3 404)	
Recipe Unlimited Corp.	(200)	(3 277)	(2 500)	
Sleep Country Canada Holdings Inc.	(100)	(2 511)	(2 402)	
		(290 342)	(211 732)	(1,05)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -0,28%)				
Andrew Peller Ltée	(200)	(1 208)	(1 170)	
Primo Water Corp., TSE	(1 800)	(34 070)	(30 942)	
SunOpta Inc.	(2 100)	(15 264)	(20 895)	
		(50 542)	(53 007)	(0,26)
Soins de santé (31 décembre 2021 : -1,08 %)				
Aurora Cannabis Inc.	(200)	(1 781)	(340)	
CannTrust Holdings Inc.	(1 600)	(4 665)	(23)	
Chartwell résidences pour retraités	(100)	(1 298)	(1 115)	
Cronos Group Inc.	(7 700)	(49 400)	(27 720)	
Extendicare Inc.	(100)	(833)	(686)	
HEXO Corp.	(28 199)	(60 433)	(7 614)	
HLS Therapeutics Inc.	(100)	(1 701)	(1 217)	
Thérapeutique Knight Inc.	(4 000)	(20 956)	(21 360)	
Sundial Growers Inc.	(76 773)	(51 056)	(32 295)	
Valens Co Inc.	(1 000)	(1 612)	(830)	
Well Health Technologies Corp.	(13 800)	(73 456)	(42 366)	
Xenon Pharmaceuticals Inc.	(74)	(2 982)	(2 904)	
		(270 173)	(138 470)	(0,68)
Services financiers (31 décembre 2021 : -0,02 %)				
ECN Capital Corp.	(5)	(37)	(28)	
Société Financière Manuvie	(200)	(4 566)	(4 464)	
Mogo Inc.	(2 900)	(7 032)	(3 161)	
		(11 635)	(7 653)	(0,04)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -0,47 %)				
Canadian Solar Inc.	(198)	(7 938)	(7 954)	
Hut 8 Mining Corp	(17 200)	(87 481)	(29 928)	
Lightspeed Commerce Inc., TSE	(1 600)	(73 681)	(45 920)	
Open Text Corp.	(1 300)	(69 429)	(63 288)	
Shopify Inc.	(900)	(40 486)	(36 198)	
		(279 015)	(183 288)	(0,91)
Services de communication (31 décembre 2021 : -0,24 %)				
Enthusiast Gaming Holdings Inc.	(1 200)	(4 201)	(3 060)	
Imax Corp.	(959)	(21 703)	(20 894)	
Rogers Communications Inc., TSE	(1 100)	(72 864)	(67 848)	
Groupe Stingray Inc.	(900)	(4 894)	(5 580)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Telesat Corp.	(102)	(2 056)	(1 470)	
WildBrain Ltd.	(300)	(804)	(738)	
		(106 522)	(99 590)	(0,49)
Services publics (31 décembre 2021 : -0,41 %)				
TransAlta Corp., TSE	(1 600)	(22 224)	(23 504)	(0,12)
Immobilier (31 décembre 2021 : -0,03 %)				
DREAM Unlimited Corp.	(200)	(8 707)	(6 370)	
Dundee Corp.	(200)	(288)	(274)	
European Residential REIT	(1 000)	(4 005)	(3 580)	
Information Services Corp.	(200)	(4 532)	(4 206)	
Morguard REIT	(200)	(1 029)	(1 028)	
NorthWest Healthcare Properties REIT	(100)	(1 335)	(1 206)	
Tricon Residential Inc., TSE	(100)	(1 280)	(1 305)	
		(21 176)	(17 969)	(0,09)
Total des actions canadiennes – position vendeur		(2 032 334)	(1 514 642)	(7,49)
Actions américaines – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2021: 2,43 %)				
Alto Ingredients Inc.	57	363	273	
Antero Midstream Corp.	409	5 479	4 775	
Arch Resources Inc.	5	1 049	923	
Archrock Inc.	452	5 218	4 822	
Baker Hughes Co.	1 612	62 799	60 033	
Berry Corp.	333	2 987	3 273	
Brigham Minerals Inc.	170	4 653	5 401	
Cactus Inc.	5	376	260	
Callon Petroleum Co.	7	530	354	
Cheniere Energy Inc.	65	7 506	11 154	
Chevron Corp.	549	101 597	102 531	
CONSOL Energy Inc.	453	9 053	28 855	
Coterra Energy Inc.	220	5 959	7 319	
CVR Energy Inc.	16	526	691	
Delek US Holdings Inc.	137	4 133	4 567	
Devon Energy Corp.	177	17 064	12 583	
Earthstone Energy Inc.	867	13 631	15 266	
Equitrans Midstream Corp.	2 740	27 830	22 479	
Exxon Mobil Corp.	1 192	129 838	131 682	
Gran Tierra Energy Inc., ASE	4 511	1 894	6 692	
Gran Tierra Energy Inc., TSE	2 600	5 490	3 848	
Halliburton Co.	255	11 120	10 316	
Helix Energy Solutions Group Inc.	793	3 699	3 171	
Hess Midstream LP	1 720	61 855	62 124	
HF Sinclair Corp.	195	11 893	11 360	
Kinder Morgan Inc.	581	12 808	12 561	
Kinetik Holdings Inc.	66	2 965	2 907	
KLX Energy Services Holdings Inc.	71	927	397	
Kosmos Energy Ltd.	602	3 118	4 807	
Laredo Petroleum Inc.	250	15 635	22 232	
Liberty Energy Inc.	602	12 107	9 909	
Marathon Petroleum Corp.	170	21 402	18 028	
New Fortress Energy Inc.	139	7 832	7 095	
Newpark Resources Inc.	395	1 139	1 574	
NextDecade Corp.	253	2 019	1 449	
Oceaneering International Inc.	279	4 533	3 844	
Oil States International Inc.	372	3 270	2 601	
ONEOK Inc.	126	9 039	9 021	
Par Pacific Holdings Inc.	496	10 356	9 975	
PBF Energy Inc.	107	2 121	4 006	
Peabody Energy Corp.	196	5 737	5 393	
Phillips 66	136	17 898	14 384	
Pioneer Natural Resources Co.	65	16 542	18 705	
Ranger Oil Corp.	424	9 214	17 978	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ring Energy Inc.	1 495	3 687	5 130	
Select Energy Services Inc.	52	674	457	
Sitio Royalties Corp.	71	1 897	2 123	
Solaris Oilfield Infrastructure Inc.	140	1 959	1 965	
Southwestern Energy Co.	5 715	53 015	46 076	
Targa Resources Corp.	61	5 851	4 695	
Tellurian Inc.	717	3 257	2 756	
Tidewater Inc.	38	929	1 034	
Uranium Energy Corp.	528	2 608	2 098	
US Silica Holdings Inc.	33	757	486	
Valero Energy Corp.	115	18 074	15 766	
Viper Energy Partners LP	32	1 208	1 101	
Williams Cos Inc.	345	13 999	13 890	
World Fuel Services Corp.	27	945	713	
		764 064	779 908	3,86
Matières premières (31 décembre 2021: 1,06 %)				
Advanced Emissions Solutions Inc.	119	889	720	
Air Products and Chemicals Inc.	62	21 057	19 233	
Albemarle Corp.	33	6 775	8 896	
Alpha Metallurgical Resources Inc.	2	329	333	
American Vanguard Corp.	13	384	375	
Arconic Corp.	34	1 167	1 230	
Avery Dennison Corp.	23	5 132	4 803	
Ball Corp.	91	9 017	8 073	
Berry Global Group Inc.	15	1 060	1 057	
Celanese Corp.	30	5 769	4 551	
CF Industries Holdings Inc.	57	5 337	6 304	
Clearwater Paper Corp.	8	330	347	
Cleveland-Cliffs Inc.	148	4 413	2 934	
Corteva Inc.	205	16 164	14 317	
Crown Holdings Inc.	36	5 576	4 280	
Dow Inc.	205	15 104	13 648	
DuPont de Nemours Inc.	145	13 559	10 396	
Eastman Chemical Co.	35	4 726	4 053	
Ecolab Inc.	28	7 227	5 554	
FMC Corp.	36	5 477	4 969	
FutureFuel Corp.	116	1 313	1 089	
Gold Resource Corp.	110	373	231	
Hecla Mining Co.	582	3 375	2 943	
International Flavors & Fragrances Inc.	71	11 875	10 910	
International Paper Co.	103	6 353	5 558	
Livent Corp.	278	9 590	8 137	
Loop Industries Inc.	132	1 534	661	
LSB Industries Inc.	111	2 753	1 985	
Martin Marietta Materials Inc.	17	7 031	6 562	
Mcewen Mining Inc.	300	343	162	
Mosaic Co.	104	8 917	6 336	
Newmont Corp.	200	19 557	15 320	
Packaging Corp. of America	27	5 581	4 789	
Ramaco Resources Inc.	58	1 340	984	
Rayonier Advanced Materials Inc.	84	757	284	
Ryerson Holding Corp.	86	3 082	2 362	
Schnitzer Steel Industries Inc.	25	1 812	1 059	
Sealed Air Corp.	42	3 044	3 127	
Sherwin-Williams Co.	70	21 925	20 218	
Steel Dynamics Inc.	54	6 147	4 608	
SunCoke Energy Inc.	67	720	589	
Synalloy Corp.	40	813	725	
Vulcan Materials Co.	37	6 605	6 782	
Westlake Corp.	11	1 848	1 391	
WestRock Co.	74	4 875	3 803	
		261 055	226 688	1,12

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Industries (31 décembre 2021: 5,36 %)				
3M Co.	161	32 082	26 876	
Alta Equipment Group Inc.	21	378	243	
AMERCO	2	934	1 234	
American Airlines Group Inc.	1 576	38 356	25 778	
AMETEK Inc.	66	10 398	9 356	
Atlas Air Worldwide Holdings Inc.	11	971	876	
Bloom Energy Corp.	720	14 898	15 325	
BlueLinx Holdings Inc.	18	1 527	1 551	
Boise Cascade Co.	5	433	384	
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	38	4 223	4 429	
Carrier Global Corp.	241	16 739	11 086	
Caterpillar Inc.	151	41 986	34 819	
CH Robinson Worldwide Inc.	36	4 982	4 707	
Cintas Corp.	26	9 649	12 528	
Copart Inc.	61	7 102	8 550	
CoStar Group Inc.	111	10 233	8 650	
CSX Corp.	1 393	50 145	52 218	
Cummins Inc.	40	10 488	9 986	
Deere & Co.	82	35 742	31 677	
Delta Air Lines Inc.	45	1 981	1 682	
Dover Corp.	40	7 215	6 260	
Emerson Electric Co.	168	19 883	17 237	
Energpac Tool Group Corp.	7	144	172	
Expeditors International of Washington Inc.	47	7 741	5 909	
Fastenal Co.	161	8 823	10 368	
FedEx Corp.	71	22 834	20 764	
Fortive Corp.	94	7 642	6 594	
Fortune Brands Home & Security Inc.	38	4 798	2 935	
Generac Holdings Inc.	18	4 920	4 889	
General Dynamics Corp.	67	18 198	19 122	
General Electric Co.	309	38 034	25 379	
GXO Logistics Inc.	1	64	56	
HEICO Corp.	29	4 250	4 905	
Heidrick & Struggles International Inc.	7	371	292	
Hexcel Corp.	6	340	405	
Honeywell International Inc.	194	51 963	43 496	
Huntington Ingalls Industries Inc.	11	2 832	3 091	
IDEX Corp.	21	5 165	4 920	
Illinois Tool Works Inc.	88	23 278	20 688	
Jacobs Engineering Group Inc.	37	6 906	6 068	
JB Hunt Transport Services Inc.	23	5 081	4 672	
JetBlue Airways Corp.	1 892	29 615	20 428	
Knight-Swift Transportation Holdings Inc.	43	2 711	2 568	
L3Harris Technologies Inc.	54	15 105	16 836	
Landstar System Inc.	2	394	375	
Leidos Holdings Inc.	37	5 121	4 807	
Lennox International Inc.	9	3 125	2 398	
Lockheed Martin Corp.	69	34 460	38 269	
Lyft Inc.	86	3 214	1 473	
Manitowoc Co Inc.	16	353	217	
Masco Corp.	69	4 976	4 504	
Mesa Air Group Inc.	37	382	105	
NN Inc.	307	1 872	1 002	
Nordson Corp.	15	4 322	3 917	
Norfolk Southern Corp.	88	22 827	25 801	
Northrop Grumman Corp.	42	22 057	25 928	
Old Dominion Freight Line Inc.	27	5 587	8 926	
Owens Corning	29	3 745	2 780	
PACCAR Inc.	99	11 201	10 515	
Parker-Hannifin Corp.	36	13 335	11 426	
Plug Power Inc.	147	2 958	3 142	
Proto Labs Inc.	142	12 957	8 763	
Quad/Graphics Inc.	498	2 192	1 767	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Quanta Services Inc.	40	6 143	6 467	
Raytheon Technologies Corp.	422	44 009	52 319	
Republic Services Inc.	62	7 206	10 467	
Robert Half International Inc.	31	3 698	2 995	
Rockwell Automation Inc.	33	13 874	8 484	
Rollins Inc.	62	3 087	2 793	
Southwest Airlines Co.	41	2 259	1 910	
Tetra Tech Inc.	2	335	352	
Textron Inc.	62	5 877	4 884	
Toro Co.	3	408	293	
TPI Composites Inc.	24	372	387	
TransDigm Group Inc.	15	10 277	10 384	
TransUnion	53	6 769	5 469	
Trex Co Inc.	9	865	632	
Uber Technologies Inc.	410	18 092	10 821	
Union Pacific Corp.	179	51 005	49 247	
United Airlines Holdings Inc.	1 226	59 883	56 016	
United Parcel Service Inc., cat. B	207	54 863	48 742	
United Rentals Inc.	20	9 003	6 267	
Upwork Inc.	401	10 569	10 697	
V2X Inc.	25	1 449	1 079	
Verisk Analytics Inc.	45	10 149	10 048	
Vertiv Holdings Co.	807	10 652	8 557	
Waste Management Inc.	117	17 328	23 089	
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	50	5 860	5 294	
Willis Lease Finance Corp.	29	777	1 402	
WW Grainger Inc.	13	7 685	7 621	
Xylem Inc.	50	5 982	5 042	
Yellow Corp.	389	5 918	1 470	
		1 110 632	1 019 352	5,04
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021: 8,79 %)				
2U Inc.	67	3 384	905	
Adtalem Global Education Inc.	20	825	928	
Advance Auto Parts Inc.	17	4 698	3 796	
Airbnb Inc.	94	19 257	10 801	
Amazon.com Inc.	2 579	488 637	353 349	
Aramark	65	3 043	2 568	
Asbury Automotive Group Inc.	2	495	437	
AutoZone Inc.	6	15 098	16 634	
Bath & Body Works Inc.	74	5 022	2 570	
Best Buy Co Inc.	62	7 289	5 214	
Big Lots Inc.	205	6 801	5 545	
Bluegreen Vacations Holding Corp.	84	1 289	2 705	
Booking Holdings Inc.	11	27 147	24 817	
BorgWarner Inc.	67	3 243	2 884	
Burlington Stores Inc.	19	3 901	3 339	
Carvana Co.	27	838	786	
Cavco Industries Inc.	1	278	253	
Cheesecake Factory Inc.	9	478	307	
Chegg Inc.	114	2 616	2 762	
Chewy Inc.	475	20 480	21 274	
Chipotle Mexican Grill Inc.	8	14 169	13 490	
Darden Restaurants Inc.	36	6 185	5 253	
Dick's Sporting Goods Inc.	64	6 579	6 222	
Dollar General Corp.	66	19 816	20 896	
Dollar Tree Inc.	63	11 253	12 666	
DoorDash Inc.	54	9 495	4 470	
DR Horton Inc.	96	12 373	8 197	
eBay Inc.	166	10 865	8 923	
Etsy Inc.	36	6 956	3 400	
Everi Holdings Inc.	35	735	736	
Expedia Group Inc.	508	85 668	62 142	
Ford Motor Co.	1 106	26 302	15 879	
General Motors Co.	307	20 858	12 577	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Genuine Parts Co.	40	6 831	6 863	
Group 1 Automotive Inc.	4	926	876	
Harley-Davidson Inc.	19	874	776	
Hasbro Inc.	36	4 467	3 802	
Hibbett Inc.	18	1 202	1 015	
Hilton Grand Vacations Inc.	6	387	277	
Hilton Worldwide Holdings Inc.	78	14 423	11 213	
Home Depot Inc.	294	105 104	104 016	
Hyatt Hotels Corp.	10	1 081	953	
iRobot Corp.	13	1 129	616	
Jack in the Box Inc.	3	352	217	
KB Home	10	377	367	
Las Vegas Sands Corp.	97	4 292	4 203	
La-Z-Boy Inc.	8	347	245	
Lennar Corp.	72	8 807	6 554	
LGI Homes Inc.	3	337	336	
LKQ Corp.	77	5 047	4 876	
Lowe's Cos Inc.	189	46 360	42 585	
Lucid Group Inc.	128	7 526	2 833	
Lululemon Athletica Inc.	33	14 430	11 605	
M/I Homes Inc.	4	324	205	
MarineMax Inc.	48	3 122	2 236	
Marriott International Inc.	78	16 606	13 685	
MasterCraft Boat Holdings Inc.	10	392	272	
McDonald's Corp.	209	62 294	66 559	
MercadoLibre Inc.	1	1 147	822	
MGM Resorts International	97	4 481	3 622	
Mohawk Industries Inc.	14	2 521	2 241	
Newell Brands Inc.	119	3 291	2 923	
NIKE Inc., cat. B	359	53 660	47 328	
NVR Inc.	1	4 302	5 165	
O'Reilly Automotive Inc.	19	16 295	15 484	
PlayAGS Inc.	106	652	706	
Porch Group Inc.	19	601	63	
PulteGroup Inc.	72	4 173	3 681	
Quotient Technology Inc.	605	5 081	2 318	
Red Robin Gourmet Burgers Inc.	56	726	580	
Rivian Automotive Inc.	54	7 914	1 793	
Ross Stores Inc.	100	13 283	9 059	
Rush Street Interactive Inc.	304	7 761	1 831	
Sally Beauty Holdings Inc.	15	355	231	
Starbucks Corp.	324	42 282	31 927	
Stitch Fix Inc.	751	14 803	4 786	
Strategic Education Inc.	4	358	364	
Target Corp.	195	41 843	35 525	
Tesla Inc.	242	231 033	210 221	
TJX Cos Inc.	338	27 235	24 351	
Toll Brothers Inc.	244	14 014	14 038	
Tractor Supply Co.	32	8 546	8 002	
Tri Pointe Homes Inc.	132	3 050	2 873	
Ulta Beauty Inc.	15	7 975	7 459	
Vail Resorts Inc.	11	3 474	3 094	
Vivint Smart Home Inc.	746	13 333	3 349	
Wayfair Inc.	498	67 831	27 983	
Whirlpool Corp.	17	4 250	3 396	
Wynn Resorts Ltd.	77	6 522	5 660	
Yum China Holdings Inc.	119	7 701	7 445	
Yum! Brands Inc.	82	10 412	12 007	
		1 784 015	1 424 237	7,05
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 3,44 %)				
Altria Group Inc.	1 193	70 620	64 281	
Andersons Inc.	9	422	383	
Archer-Daniels-Midland Co.	158	18 818	15 816	
BJ's Wholesale Club Holdings Inc.	5	347	402	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Brown-Forman Corp., cat. B	87	7 814	7 874	
Campbell Soup Co.	61	3 452	3 781	
Church & Dwight Co Inc.	68	7 024	8 128	
Clorox Co.	34	6 296	6 183	
Coca-Cola Co.	1 159	85 445	94 054	
Colgate-Palmolive Co.	97	9 641	10 028	
Conagra Brands Inc.	133	5 918	5 874	
Constellation Brands Inc.	46	11 751	13 829	
Costco Wholesale Corp.	125	58 245	77 281	
Coty Inc.	205	1 979	2 118	
elf Beauty Inc.	10	341	396	
Estee Lauder Cos Inc.	65	27 578	21 353	
Farmer Bros Co.	254	2 412	1 537	
General Mills Inc.	172	14 462	16 740	
Hershey Co.	41	9 344	11 379	
Hormel Foods Corp.	83	4 353	5 071	
J M Smucker Co.	31	5 115	5 119	
Kellogg Co.	72	6 932	6 626	
Keurig Dr Pepper Inc.	220	9 379	10 043	
Kimberly-Clark Corp.	54	8 972	9 414	
Kraft Heinz Co.	207	9 203	10 184	
Kroger Co.	197	12 453	12 028	
McCormick & Co Inc.	69	7 711	7 410	
Molson Coors Beverage Co.	51	3 574	3 586	
Mondelez International Inc.	392	28 779	31 397	
Monster Beverage Corp.	112	11 684	13 393	
Oil-Dri Corp. of America	49	1 491	1 937	
PepsiCo Inc.	390	71 748	83 844	
Performance Food Group Co.	107	6 548	6 346	
Philip Morris International Inc.	437	47 873	55 661	
Post Holdings Inc.	48	4 929	5 099	
Procter & Gamble Co.	675	111 263	125 201	
Simply Good Foods Co.	20	1 016	974	
Spectrum Brands Holdings Inc.	3	342	317	
Sysco Corp.	144	16 175	15 735	
Tyson Foods Inc.	83	9 659	9 214	
Village Super Market Inc.	22	721	647	
Walgreens Boots Alliance Inc.	206	10 943	10 071	
Walmart Inc.	430	72 718	67 438	
		805 490	858 192	4,24
Soins de santé (31 décembre 2021: 9,27 %)				
2seventy bio Inc.	136	4 439	2 316	
Abbott Laboratories	498	71 195	69 797	
Abbvie Inc.	303	39 614	59 864	
ABIOMED Inc.	15	6 189	4 789	
Acadia Pharmaceuticals Inc.	387	7 301	7 034	
Adaptive Biotechnologies Corp.	75	2 193	783	
Adverum Biotechnologies Inc.	637	1 968	986	
Agilent Technologies Inc.	84	16 250	12 869	
Agios Pharmaceuticals Inc.	348	19 536	9 952	
Akebia Therapeutics Inc.	773	2 792	352	
Albireo Pharma Inc.	65	1 859	1 665	
Alector Inc.	186	4 606	2 438	
Align Technology Inc.	21	15 346	6 411	
Allakos Inc.	179	1 872	723	
Allogene Therapeutics Inc.	186	2 910	2 735	
Alnylam Pharmaceuticals Inc.	33	7 829	6 209	
Alpine Immune Sciences Inc.	120	1 315	1 317	
AmerisourceBergen Corp.	220	40 068	40 151	
Amgen Inc.	157	43 708	49 274	
Amicus Therapeutics Inc.	419	4 230	5 805	
AnaptysBio Inc.	348	7 024	9 113	
Arrowhead Pharmaceuticals Inc.	370	29 252	16 805	
Arvinas Inc.	381	38 562	20 686	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Assembly Biosciences Inc.	181	1 086	490	
Assertio Holdings Inc.	126	401	479	
Atara Biotherapeutics Inc.	185	2 931	1 859	
Athenex Inc.	249	1 238	132	
Atreca Inc.	207	765	478	
Avantor Inc.	172	8 156	6 900	
Axonics Inc.	40	2 510	2 924	
Baxter International Inc.	142	15 359	11 765	
Becton Dickinson and Co.	80	27 575	25 441	
Biogen Inc.	41	14 434	10 786	
BioMarin Pharmaceutical Inc.	52	5 301	5 559	
Bio-Rad Laboratories Inc.	6	5 246	3 831	
Bio-Techne Corp.	11	5 937	4 919	
Black Diamond Therapeutics Inc.	114	367	362	
Bluebird Bio Inc.	109	669	582	
Blueprint Medicines Corp.	100	7 138	6 516	
Boston Scientific Corp.	402	22 722	19 327	
Bridgebio Pharma Inc.	105	1 280	1 230	
Bristol-Myers Squibb Co.	613	52 162	60 887	
Cardinal Health Inc.	76	5 152	5 124	
Castle Biosciences Inc.	31	928	878	
Catalent Inc.	47	5 813	6 505	
Catalyst Pharmaceuticals Inc.	43	371	389	
Celldex Therapeutics Inc.	77	2 746	2 678	
Centene Corp.	165	17 553	18 009	
Charles River Laboratories International Inc.	14	5 694	3 864	
Chemed Corp.	1	652	605	
Chimerix Inc.	200	1 796	537	
Chinook Therapeutics Inc.	123	2 976	2 775	
CIGNA Corp.	90	27 987	30 594	
Citius Pharmaceuticals Inc.	1	2	1	
Cogent Biosciences Inc.	376	4 456	4 375	
Coherus Biosciences Inc.	170	2 339	1 588	
Concert Pharmaceuticals Inc.	350	5 061	1 901	
ConforMIS Inc.	1 244	2 327	568	
Cooper Cos Inc.	14	6 506	5 655	
Corcept Therapeutics Inc.	18	415	552	
Crinetics Pharmaceuticals Inc.	13	376	313	
Cutera Inc.	27	1 846	1 306	
CVS Health Corp.	369	37 322	44 106	
Cymabay Therapeutics Inc.	73	361	278	
Cytokinetics Inc.	219	10 618	11 099	
CytomX Therapeutics Inc.	1 070	2 639	2 526	
DaVita Inc.	18	2 616	1 857	
DexCom Inc.	108	13 240	10 383	
Editas Medicine Inc.	205	4 976	3 128	
Edwards Lifesciences Corp.	176	20 114	21 589	
Eiger BioPharmaceuticals Inc.	156	1 412	1 268	
Elanco Animal Health Inc.	120	3 647	3 039	
Elevance Health Inc.	68	29 924	42 330	
Eli Lilly & Co.	228	51 251	95 359	
Embecta Corp.	15	576	490	
Exact Sciences Corp.	49	2 984	2 490	
Fate Therapeutics Inc.	48	1 704	1 534	
G1 Therapeutics Inc.	63	776	401	
Glaukos Corp.	30	2 677	1 758	
Global Blood Therapeutics Inc.	21	778	866	
Gossamer Bio Inc.	108	1 473	1 166	
Halozyne Therapeutics Inc.	265	15 818	15 041	
HCA Healthcare Inc.	69	21 003	14 959	
Health Catalyst Inc.	149	4 679	2 785	
HealthStream Inc.	12	366	336	
Henry Schein Inc.	39	4 338	3 861	
Hologic Inc.	71	6 743	6 347	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Homology Medicines Inc.	100	773	254	
Humana Inc.	36	18 752	21 736	
IDEXX Laboratories Inc.	24	16 599	10 858	
Illumina Inc.	44	26 475	10 464	
Incyte Corp.	52	5 719	5 096	
Insmed Inc.	160	4 385	4 070	
Intellia Therapeutics Inc.	83	5 905	5 542	
Intercept Pharmaceuticals Inc.	250	6 776	4 454	
Intuitive Surgical Inc.	101	44 662	26 150	
Ionis Pharmaceuticals Inc.	158	7 486	7 545	
IQVIA Holdings Inc.	49	11 335	13 715	
IVERIC bio Inc.	286	4 603	3 549	
Johnson & Johnson	742	154 778	169 903	
Jounce Therapeutics Inc.	468	4 603	1 829	
KalVista Pharmaceuticals Inc.	69	1 532	876	
Kezar Life Sciences Inc.	115	1 090	1 227	
Krystal Biotech Inc.	5	416	423	
Laboratory Corp. of America Holdings	26	9 129	7 860	
Madrigal Pharmaceuticals Inc.	9	922	831	
Masimo Corp.	15	4 611	2 528	
McKesson Corp.	42	15 126	17 673	
Merck & Co Inc.	713	72 833	83 853	
Miram Pharmaceuticals Inc.	16	339	402	
Molecular Templates Inc.	76	348	89	
Molina Healthcare Inc.	16	5 126	5 771	
Natera Inc.	270	14 127	12 343	
NeoGenomics Inc.	8	406	84	
Neurocrine Biosciences Inc.	27	3 644	3 395	
Nevro Corp.	109	9 875	6 163	
NextCure Inc.	140	1 047	849	
Oak Street Health Inc.	29	1 685	615	
OPKO Health Inc.	501	1 718	1 635	
Ovid Therapeutics Inc.	436	3 673	1 209	
Owens & Minor Inc.	73	3 431	2 962	
Pacira BioSciences Inc.	10	754	752	
PDL BioPharma Inc.	501	1 218	551	
Pfizer Inc.	474	26 570	32 058	
Precigen Inc.	135	358	233	
Prestige Consumer Healthcare Inc.	5	355	379	
PTC Therapeutics Inc.	13	703	672	
Quanterix Corp.	11	721	230	
Quest Diagnostics Inc.	34	5 836	5 832	
RI RCM Inc.	816	26 759	22 063	
Radius Health Inc.	196	2 109	2 622	
Regeneron Pharmaceuticals Inc.	10	8 134	7 625	
ResMed Inc.	41	11 813	11 087	
Rocket Pharmaceuticals Inc.	51	826	905	
Rubius Therapeutics Inc.	141	354	155	
Sage Therapeutics Inc.	50	2 240	2 083	
Sangamo Therapeutics Inc.	385	4 569	2 056	
Sarepta Therapeutics Inc.	4	340	387	
Savara Inc.	363	675	712	
SI-BONE Inc.	15	429	255	
Sierra Oncology Inc.	11	455	780	
SIGA Technologies Inc.	152	2 222	2 271	
SpringWorks Therapeutics Inc.	35	955	1 112	
Stryker Corp.	96	31 549	24 635	
Tabula Rasa HealthCare Inc.	83	586	275	
Teladoc Health Inc.	586	28 135	25 104	
Teleflex Inc.	13	6 262	4 123	
Thermo Fisher Scientific Inc.	111	62 809	77 790	
Traverse Therapeutics Inc.	688	19 861	21 504	
Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	25	1 801	1 924	
United Therapeutics Corp.	2	590	608	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
UnitedHealth Group Inc.	265	110 478	175 578	
Universal Health Services Inc., cat. B	22	3 996	2 858	
Vanda Pharmaceuticals Inc.	51	752	717	
Veeva Systems Inc.	39	12 308	9 963	
Vertex Pharmaceuticals Inc.	72	20 335	26 172	
Viatris Inc.	339	4 768	4 578	
Viking Therapeutics Inc.	202	1 053	753	
Voyager Therapeutics Inc.	161	897	1 227	
Waters Corp.	17	6 601	7 258	
Zimmer Biomet Holdings Inc.	59	11 105	7 996	
Zimvie Inc.	5	173	103	
Zoetis Inc.	11	2 456	2 439	
		1 771 205	1 800 132	8,91
Services financiers (31 décembre 2021: 6,71 %)				
Aflac Inc.	176	10 730	12 562	
Alleghany Corp.	4	3 317	4 299	
Allstate Corp.	124	18 286	20 271	
Ally Financial Inc.	94	5 583	4 063	
American Express Co.	182	36 385	32 544	
American Financial Group Inc.	20	2 801	3 581	
American International Group Inc.	231	14 994	15 236	
Ameriprise Financial Inc.	31	7 969	9 505	
Ameris Bancorp	6	376	311	
Ames National Corp.	39	1 113	1 116	
Arch Capital Group Ltd.	104	5 141	6 103	
Arthur J Gallagher & Co.	59	9 155	12 409	
Assurant Inc.	16	2 315	3 568	
Bank of America Corp.	2 043	76 563	82 039	
Bank of New York Mellon Corp.	215	16 947	11 568	
Bankwell Financial Group Inc.	21	722	841	
Berkshire Hathaway Inc., cat. B	180	49 249	63 393	
BlackRock Inc.	43	35 294	33 782	
Brookline Bancorp Inc.	21	425	361	
Brown & Brown Inc.	226	15 034	17 008	
BRP Group Inc.	184	7 142	5 732	
Capital One Financial Corp.	116	22 923	15 590	
Carter Bankshares Inc.	18	367	306	
Cboe Global Markets Inc.	30	5 014	4 380	
Charles Schwab Corp.	1 172	112 067	95 517	
Cincinnati Financial Corp.	43	6 559	6 600	
Citigroup Inc.	559	49 769	33 163	
Citizens Financial Group Inc.	142	7 315	6 537	
CME Group Inc.	101	27 880	26 669	
CNB Financial Corp.	12	357	374	
Coinbase Global Inc.	34	6 082	2 062	
Crawford & Co., cat. A	74	773	745	
Curo Group Holdings Corp.	83	1 920	592	
Customers Bancorp Inc.	15	669	656	
Discover Financial Services	79	11 036	9 638	
Eagle Bancorp Inc.	5	363	306	
eHealth Inc.	6	453	72	
Elevate Credit Inc.	338	1 570	1 029	
Equitable Holdings Inc.	114	4 717	3 834	
Erie Indemnity Co.	7	1 618	1 735	
FactSet Research Systems Inc.	10	4 814	4 961	
Fidelity National Financial Inc.	76	3 707	3 623	
Fifth Third Bancorp	196	11 356	8 495	
First Citizens BancShares Inc.	3	3 377	2 530	
First Republic Bank	49	10 940	9 115	
Globe Life Inc.	27	3 357	3 395	
Goldman Sachs Group Inc.	95	37 441	36 399	
Green Dot Corp.	42	1 591	1 360	
Guaranty Bancshares Inc.	11	399	514	
Hartford Financial Services Group Inc.	94	7 829	7 934	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Home Bancorp Inc.	14	634	616	
Huntington Bancshares Inc.	410	7 770	6 362	
Interactive Brokers Group Inc.	4	367	284	
Intercontinental Exchange Inc.	158	22 626	19 167	
JPMorgan Chase & Co.	833	127 403	121 003	
Kemper Corp.	6	346	371	
KeyCorp	257	8 206	5 712	
LendingClub Corp.	686	15 460	10 345	
Lincoln National Corp.	45	3 706	2 715	
Loews Corp.	61	3 743	4 663	
LPL Financial Holdings Inc.	23	5 679	5 473	
M&T Bank Corp.	50	10 234	10 280	
MainStreet Bancshares Inc.	16	479	470	
Market Corp.	4	6 320	6 673	
MarketAxess Holdings Inc.	11	7 398	3 633	
Marsh & McLennan Cos Inc.	142	21 498	28 438	
Medallion Financial Corp.	49	365	405	
MetLife Inc.	197	12 756	15 956	
Metropolitan Bank Holding Corp.	3	357	269	
Middlefield Banc Corp.	38	1 182	1 235	
Moody's Corp.	47	18 138	16 489	
Morgan Stanley	378	39 647	37 087	
Morningstar Inc.	1	292	312	
MSCI Inc.	23	10 927	12 228	
Nasdaq Inc.	33	6 588	6 493	
Northern Trust Corp.	57	7 921	7 094	
PNC Financial Services Group Inc.	118	26 702	24 015	
Primerica Inc.	2	392	309	
Principal Financial Group Inc.	75	4 894	6 462	
PROG Holdings Inc.	15	539	319	
Progressive Corp.	223	28 785	33 446	
Prudential Financial Inc.	106	14 369	13 083	
Pzena Investment Management Inc.	33	420	281	
Raymond James Financial Inc.	54	3 780	6 228	
Redwood Trust Inc.	36	357	358	
Regions Financial Corp.	265	7 959	6 409	
RLI Corp.	3	394	451	
S&P Global Inc.	94	38 529	40 871	
Sculptor Capital Management Inc.	679	20 791	7 314	
SEI Investments Co.	33	2 455	2 300	
Shore Bancshares Inc.	14	367	334	
Signature Bank	18	6 919	4 161	
State Street Corp.	103	12 312	8 191	
SVB Financial Group	18	12 956	9 171	
Synchrony Financial	145	8 701	5 166	
T Rowe Price Group Inc.	64	9 527	9 379	
Tiptree Inc.	88	1 345	1 206	
Tradeweb Markets Inc.	29	2 474	2 553	
Travelers Cos Inc.	68	10 099	14 836	
Truist Financial Corp.	376	28 267	23 005	
Trupanion Inc.	40	5 243	3 109	
United Insurance Holdings Corp.	132	677	266	
Unum Group	13	383	571	
Upstart Holdings Inc.	12	2 580	489	
US Bancorp	398	25 992	23 627	
Voya Financial Inc.	124	9 557	9 522	
W R Berkley Corp.	58	3 060	5 107	
Webster Financial Corp.	51	3 142	2 773	
Wells Fargo & Co.	1 073	78 229	54 216	
Western New England Bancorp Inc.	113	1 159	1 087	
		1 379 201	1 272 811	6,29
Technologies de l'information (31 décembre 2021: 17,72 %)				
Adobe Inc.	133	78 739	62 803	
Affirm Holdings Inc.	47	4 857	1 095	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Akamai Technologies Inc.	45	6 327	5 302	
Alteryx Inc.	373	30 209	23 297	
Amphenol Corp.	170	16 342	14 118	
Amtech Systems Inc.	34	401	320	
Analog Devices Inc.	147	29 761	27 702	
ANSYS Inc.	25	10 721	7 717	
Apple Inc.	4 600	547 855	811 276	
Applied Materials Inc.	249	34 206	29 223	
AppLovin Corp.	33	1 688	1 466	
Arista Networks Inc.	69	12 096	8 344	
Arrow Electronics Inc.	19	2 916	2 747	
Asana Inc.	21	2 030	476	
Autodesk Inc.	62	21 637	13 753	
Automatic Data Processing Inc.	118	25 347	31 971	
Avalara Inc.	105	12 721	9 562	
Bentley Systems Inc.	53	3 932	2 277	
Black Knight Inc.	44	4 547	3 711	
Blackline Inc.	99	9 697	8 505	
Block Inc.	10	1 605	793	
Box Inc.	208	7 513	6 745	
Broadcom Inc.	115	81 728	72 067	
Broadridge Financial Solutions Inc.	33	6 188	6 068	
Cadence Design Systems Inc.	78	15 796	15 096	
Casa Systems Inc.	67	509	340	
CDW Corp.	38	9 174	7 723	
Ceva Inc.	16	900	693	
Cisco Systems Inc.	1 170	83 506	64 354	
Citrix Systems Inc.	35	4 321	4 387	
Cognex Corp.	49	3 528	2 688	
Cognizant Technology Solutions Corp.	147	11 780	12 798	
Corning Inc.	227	10 350	9 227	
Coupa Software Inc.	459	50 058	33 808	
CrowdStrike Holdings Inc.	55	13 337	11 959	
Daktronics Inc.	72	456	280	
DocuSign Inc.	303	27 338	22 427	
Dropbox Inc.	87	2 549	2 356	
DXC Technology Co.	15	588	586	
Dynatrace Inc.	57	2 607	2 900	
Enphase Energy Inc.	38	7 614	9 570	
Envestnet Inc.	10	770	681	
EPAM Systems Inc.	16	6 704	6 084	
Everbridge Inc.	107	5 523	3 850	
F5 Inc.	17	3 393	3 356	
Fidelity National Information Services Inc.	172	30 731	20 339	
Fiserv Inc.	174	23 428	19 970	
FleetCor Technologies Inc.	22	7 351	5 963	
FormFactor Inc.	6	338	300	
Fortinet Inc.	195	16 105	14 232	
Gartner Inc.	23	7 486	7 175	
Global Payments Inc.	79	14 814	11 275	
GoDaddy Inc.	47	5 098	4 217	
GSI Technology Inc.	332	2 113	1 478	
GTY Technology Holdings Inc.	261	2 312	2 108	
Guidewire Software Inc.	55	6 677	5 037	
Hewlett Packard Enterprise Co.	367	7 550	6 277	
HP Inc.	297	13 812	12 559	
HubSpot Inc.	37	18 541	14 350	
Infinera Corp.	205	1 560	1 417	
Intel Corp.	1 145	62 358	55 255	
International Business Machines Corp.	254	44 831	46 261	
International Money Express Inc.	41	931	1 083	
Intuit Inc.	76	37 524	37 787	
Jack Henry & Associates Inc.	21	5 183	4 877	
Juniper Networks Inc.	90	2 895	3 309	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
KLA Corp.	43	18 623	17 699	
LivePerson Inc.	214	7 263	3 903	
LiveRamp Holdings Inc.	85	3 808	2 830	
Magnachip Semiconductor Corp.	15	366	281	
Marvell Technology Inc.	238	19 751	13 364	
Mastercard Inc.	245	105 807	99 704	
Microchip Technology Inc.	158	14 994	11 837	
Micron Technology Inc.	315	33 712	22 462	
Microsoft Corp.	2 004	533 134	663 934	
Momentive Global Inc.	956	17 300	10 852	
MongoDB Inc.	45	17 145	15 063	
Monolithic Power Systems Inc.	12	6 494	5 945	
Motorola Solutions Inc.	47	13 620	12 708	
NetApp Inc.	62	4 968	5 218	
New Relic Inc.	209	14 032	13 494	
NortonLifeLock Inc.	162	4 586	4 589	
Nutanix Inc.	325	8 086	6 133	
NVE Corp.	4	322	241	
NVIDIA Corp.	639	145 176	124 953	
Okta Inc.	53	9 086	6 180	
ON Semiconductor Corp.	121	8 150	7 853	
OneSpan Inc.	20	349	307	
Oracle Corp.	451	45 134	40 648	
Pagerduty Inc.	104	3 768	3 324	
Palantir Technologies Inc.	470	13 778	5 499	
Palo Alto Networks Inc.	136	83 594	86 654	
Paychex Inc.	92	9 931	13 514	
Paycom Software Inc.	14	7 574	5 059	
PayPal Holdings Inc.	352	73 995	31 712	
Pegasystems Inc.	50	3 277	3 086	
Ping Identity Holding Corp.	215	6 306	5 031	
PTC Inc.	31	4 727	4 252	
Pure Storage Inc.	1 169	37 116	38 770	
Q2 Holdings Inc.	14	1 090	697	
Qorvo Inc.	31	6 378	3 772	
QUALCOMM Inc.	318	50 689	52 400	
Quantum Corp.	147	360	269	
Rapid7 Inc.	203	27 386	17 492	
RingCentral Inc.	22	3 934	1 483	
Roper Technologies Inc.	30	15 805	15 272	
Sabre Corp.	1 777	22 119	13 364	
Salesforce Inc.	277	72 278	58 972	
SecureWorks Corp.	19	345	266	
ServiceNow Inc.	51	30 868	31 283	
Skyworks Solutions Inc.	46	7 718	5 497	
Smartsheet Inc.	810	47 071	32 840	
Snowflake Inc.	60	23 929	10 763	
SolarWinds Corp.	1 351	27 974	17 863	
Splunk Inc.	327	41 365	37 314	
SS&C Technologies Holdings Inc.	64	6 217	4 794	
StarTek Inc.	56	375	209	
Synopsys Inc.	41	11 229	16 062	
TD Synnex Corp.	2	381	235	
Teledyne Technologies Inc.	13	6 538	6 290	
Tenable Holdings Inc.	532	35 445	31 163	
Teradata Corp.	36	1 661	1 719	
Teradyne Inc.	45	6 119	5 198	
Texas Instruments Inc.	260	56 825	51 532	
Trade Desk Inc.	125	7 451	6 755	
Trimble Inc.	71	7 818	5 333	
Twilio Inc.	47	6 555	5 081	
Unity Software Inc.	54	4 897	2 565	
Upland Software Inc.	12	560	225	
Varonis Systems Inc.	124	6 847	4 690	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
VeriSign Inc.	28	7 618	6 044	
Visa Inc.	467	124 474	118 608	
VMware Inc.	58	9 001	8 528	
Western Digital Corp.	90	6 437	5 205	
Western Union Co.	113	2 593	2 401	
Wex Inc.	13	2 675	2 609	
Workday Inc.	57	19 076	10 263	
Yext Inc.	121	1 029	746	
Zebra Technologies Corp.	15	5 871	5 688	
Zendesk Inc.	67	7 600	6 402	
Zscaler Inc.	24	5 680	4 629	
		3 531 755	3 541 390	17,52
Services de communication (31 décembre 2021: 6,97 %)				
Activision Blizzard Inc.	216	22 149	21 694	
Alphabet Inc., cat. A	66	116 421	185 536	
Alphabet Inc., cat. C	99	233 644	279 350	
Altice USA Inc.	45	591	537	
AMC Entertainment Holdings Inc.	152	8 376	2 657	
Angi Inc.	1 472	17 542	8 697	
AT&T Inc.	2 019	54 285	54 589	
Bandwidth Inc.	40	1 576	971	
Cable One Inc.	2	3 546	3 326	
Charter Communications Inc.	34	23 296	20 549	
Comcast Corp.	1 273	72 042	64 437	
comScore Inc.	549	2 602	1 459	
DHI Group Inc.	100	664	641	
DISH Network Corp.	70	2 766	1 619	
Electronic Arts Inc.	213	35 041	33 425	
Fox Corp., cat. A	715	31 501	29 662	
Gaia Inc.	62	811	340	
Interpublic Group of Cos Inc.	111	4 367	3 942	
JOYY Inc.	15	1 033	578	
Liberty Broadband Corp.	38	7 125	5 668	
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	164	8 339	7 626	
Live Nation Entertainment Inc.	48	6 008	5 113	
Lumen Technologies Inc.	420	5 673	5 911	
Match Group Inc.	36	3 317	3 236	
Meta Platforms Inc.	652	218 957	135 620	
News Corp., NAS	70	1 653	1 407	
News Corp., NASD	38	894	779	
NII Holdings Inc.	500	1 424	168	
Omnicom Group Inc.	60	5 019	4 923	
Paramount Global	340	13 237	10 824	
Pinterest Inc.	569	17 717	13 329	
ROBLOX Corp.	99	3 994	4 196	
Roku Inc.	33	5 595	3 497	
Sinclair Broadcast Group Inc.	18	575	474	
Sirius XM Holdings Inc.	223	1 743	1 763	
Snap Inc.	39	720	661	
Spok Holdings Inc.	314	3 894	2 552	
T-Mobile US Inc.	176	25 970	30 545	
TripAdvisor Inc.	1 156	42 962	26 543	
TrueCar Inc.	107	579	357	
Twitter Inc.	223	12 039	10 756	
Verizon Communications Inc.	1 185	77 340	77 576	
Walt Disney Co.	514	92 189	62 591	
Warner Bros Discovery Inc.	608	19 557	10 525	
Yelp Inc.	82	3 290	2 937	
ZoomInfo Technologies Inc.	71	5 617	3 044	
		1 217 680	1 146 630	5,67
Services publics (31 décembre 2021: 1,51 %)				
AES Corp.	186	5 639	5 041	
Alliant Energy Corp.	70	5 129	5 292	
Ameren Corp.	74	8 219	8 625	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
American Electric Power Co Inc.	142	15 510	17 574	
American Water Works Co Inc.	52	9 935	9 979	
Atmos Energy Corp.	39	5 020	5 640	
CenterPoint Energy Inc.	176	5 716	6 716	
CMS Energy Corp.	81	6 343	7 053	
Constellation Energy Corp.	93	4 333	6 869	
Dominion Energy Inc.	196	19 927	20 178	
DTE Energy Co.	54	6 762	8 829	
Duke Energy Corp.	217	25 420	30 010	
Edison International	106	7 964	8 647	
Entergy Corp.	58	7 407	8 427	
Essential Utilities Inc.	66	3 953	3 904	
Eversource Energy	64	5 373	5 387	
Exelon Corp.	97	10 545	10 569	
Exelco Corp.	275	10 981	16 077	
FirstEnergy Corp.	152	6 609	7 527	
New Jersey Resources Corp.	6	339	345	
NextEra Energy Inc.	553	50 455	55 256	
NextEra Energy Partners LP	12	1 223	1 148	
NiSource Inc.	118	4 359	4 489	
NRG Energy Inc.	68	2 646	3 348	
OGE Energy Corp.	35	1 778	1 741	
PG&E Corp.	414	4 968	5 330	
PPL Corp.	212	7 575	7 419	
Public Service Enterprise Group Inc.	141	9 893	11 510	
Sempra Energy	89	15 112	17 252	
Southern Co.	299	25 967	27 504	
Sunnova Energy International Inc.	23	552	547	
UGI Corp.	59	2 891	2 939	
Vistra Corp.	123	3 226	3 625	
WEC Energy Group Inc.	88	11 087	11 424	
Xcel Energy Inc.	154	13 278	14 057	
		326 134	360 278	1,78
Immobilier (31 décembre 2021: 1,92 %)				
Alexandria Real Estate Equities Inc.	149	27 880	27 875	
American Homes 4 Rent	88	4 160	4 023	
American Tower Corp.	129	38 870	42 531	
Anywhere Real Estate Inc.	804	14 940	10 195	
AvalonBay Communities Inc.	39	12 198	9 772	
Boston Properties Inc.	42	6 568	4 821	
Braemar Hotels & Resorts Inc.	57	413	315	
Camden Property Trust	27	5 675	4 684	
CatchMark Timber Trust Inc.	73	808	947	
CBRE Group Inc.	93	11 711	8 831	
Cedar Realty Trust Inc.	15	442	557	
Crown Castle International Corp.	122	30 819	26 499	
Digital Realty Trust Inc.	81	17 095	13 565	
Duke Realty Corp.	110	5 590	7 797	
Equinix Inc.	26	24 633	22 036	
Equity Lifestyle Properties Inc.	49	4 039	4 454	
Equity Residential	99	7 695	9 223	
Essex Property Trust Inc.	18	5 634	6 072	
Extra Space Storage Inc.	38	5 643	8 339	
Gaming and Leisure Properties Inc.	25	1 408	1 479	
Geo Group Inc.	342	3 004	2 912	
Healthcare Realty Trust Inc.	9	342	316	
Healthpeak Properties Inc.	278	10 649	9 292	
Host Hotels & Resorts Inc.	201	4 480	4 066	
Independence Realty Trust Inc.	959	28 342	25 644	
Invitation Homes Inc.	169	6 552	7 757	
Iron Mountain Inc.	80	4 809	5 025	
Kimco Realty Corp.	175	5 266	4 463	
Medical Properties Trust Inc.	167	3 910	3 290	
Mid-America Apartment Communities Inc.	32	5 475	7 210	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Prologis Inc.	439	63 542	66 624	
Public Storage	44	12 652	17 747	
Realty Income Corp.	167	13 281	14 705	
Redfin Corp.	140	2 793	1 488	
Regency Centers Corp.	42	2 772	3 213	
SBA Communications Corp.	30	12 778	12 386	
Service Properties Trust	271	1 852	1 828	
Simon Property Group Inc.	93	16 306	11 387	
Sun Communities Inc.	32	6 399	6 578	
UDR Inc.	87	5 318	5 167	
Uniti Group Inc.	53	712	644	
Ventas Inc.	114	7 346	7 563	
VICI Properties Inc.	272	10 056	10 452	
Vornado Realty Trust	46	2 556	1 696	
Welltower Inc.	126	13 542	13 385	
Weyerhaeuser Co.	210	8 979	8 972	
WP Carey Inc.	54	5 103	5 772	
		485 037	473 597	2,34
Total des actions américaines – position acheteur		13 436 268	12 903 215	63,82
Actions américaines – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2021: -1,16 %)				
Aemetis Inc.	(473)	(3 701)	(2 996)	
APA Corp.	(972)	(35 028)	(43 759)	
Beam Global	(34)	(501)	(681)	
ChampionX Corp.	(159)	(4 731)	(4 071)	
Comstock Resources Inc.	(57)	(977)	(888)	
Diamondback Energy Inc.	(7)	(1 282)	(1 094)	
EOG Resources Inc.	(18)	(2 583)	(2 564)	
EQT Corp.	(732)	(34 055)	(32 482)	
Gevo Inc.	(1 021)	(3 435)	(3 095)	
Helmerich & Payne Inc.	(127)	(6 449)	(7 054)	
Hess Corp.	(40)	(5 637)	(5 466)	
Magnolia Oil & Gas Corp.	(13)	(368)	(352)	
Marathon Oil Corp.	(468)	(11 384)	(13 571)	
Occidental Petroleum Corp.	(672)	(52 066)	(51 040)	
Ovintiv Inc.	(1 100)	(72 513)	(62 634)	
Patterson-UTI Energy Inc.	(600)	(12 027)	(12 198)	
Range Resources Corp.	(348)	(14 340)	(11 110)	
RPC Inc.	(1 717)	(12 903)	(15 305)	
SM Energy Co.	(92)	(4 262)	(4 058)	
TETRA Technologies Inc.	(1 345)	(6 701)	(7 044)	
		(284 943)	(281 462)	(1,39)
Matières premières (31 décembre 2021: -0,11 %)				
Alcoa Corp.	(12)	(1 246)	(706)	
Ampco-Pittsburgh Corp.	(95)	(733)	(474)	
Amyris Inc.	(1 708)	(5 718)	(4 076)	
Aspen Aerogels Inc.	(9)	(346)	(115)	
Balchem Corp.	(2)	(439)	(335)	
Century Aluminum Co.	(44)	(417)	(418)	
Ecovyst Inc.	(35)	(444)	(445)	
Flotek Industries Inc.	(374)	(551)	(479)	
Freeport-McMoRan Inc.	(7)	(337)	(264)	
GCP Applied Technologies Inc.	(10)	(347)	(404)	
HB Fuller Co.	(4)	(324)	(311)	
Mativ Inc.	(6)	(343)	(194)	
Quaker Chemical Corp.	(1)	(328)	(193)	
RPM International Inc.	(15)	(1 520)	(1 523)	
Scotts Miracle-Gro Co.	(3)	(350)	(306)	
Sonoco Products Co.	(5)	(376)	(368)	
Southern Copper Corp.	(443)	(30 219)	(28 464)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Stepan Co.	(7)	(1 016)	(915)	
Tredegar Corp.	(25)	(363)	(322)	
United States Steel Corp.	(9)	(426)	(208)	
		(45 843)	(40 520)	(0,20)
Industries (31 décembre 2021: -0,91 %)				
AAON Inc.	(34)	(2 337)	(2 402)	
ACCO Brands Corp.	(50)	(420)	(421)	
Advent Technologies Holdings Inc.	(289)	(1 617)	(939)	
Aerovironment Inc.	(38)	(3 057)	(4 029)	
Air Transport Services Group Inc.	(10)	(380)	(371)	
Albany International Corp.	(24)	(2 421)	(2 439)	
AO Smith Corp., cat. B	(7)	(538)	(494)	
API Group Corp.	(22)	(485)	(425)	
Apogee Enterprises Inc.	(15)	(886)	(759)	
Arcosa Inc.	(5)	(332)	(299)	
Argan Inc.	(8)	(371)	(385)	
Astec Industries Inc.	(41)	(3 662)	(2 157)	
Avis Budget Group Inc.	(28)	(9 634)	(5 312)	
Axon Enterprise Inc.	(20)	(3 213)	(2 404)	
Babcock & Wilcox Enterprises Inc.	(116)	(839)	(902)	
Boeing Co.	(12)	(2 084)	(2 116)	
Brady Corp.	(143)	(8 392)	(8 714)	
Brink's Co.	(4)	(392)	(313)	
ChargePoint Holdings Inc.	(1 514)	(30 951)	(26 736)	
CRA International Inc.	(82)	(8 825)	(9 448)	
Custom Truck One Source Inc.	(78)	(560)	(563)	
Daseke Inc.	(437)	(2 930)	(3 602)	
Desktop Metal Inc.	(2 701)	(19 204)	(7 665)	
Douglas Dynamics Inc.	(7)	(374)	(260)	
Energous Corp.	(275)	(367)	(355)	
ESCO Technologies Inc.	(9)	(1 000)	(794)	
Franklin Electric Co Inc.	(11)	(995)	(1 040)	
FuelCell Energy Inc.	(833)	(3 869)	(4 030)	
Gencor Industries Inc.	(28)	(355)	(367)	
Gibraltar Industries Inc.	(53)	(2 802)	(2 649)	
Greenbrier Cos Inc.	(138)	(7 298)	(6 407)	
Helios Technologies Inc.	(3)	(417)	(256)	
Hillenbrand Inc.	(187)	(9 855)	(9 880)	
HNI Corp.	(18)	(854)	(805)	
Hyllion Holdings Corp.	(536)	(2 938)	(2 226)	
Hyster-Yale Materials Handling Inc.	(6)	(709)	(249)	
Ideanomics Inc.	(5 551)	(13 417)	(4 745)	
INNOVATE Corp.	(73)	(192)	(163)	
Interface Inc.	(90)	(1 640)	(1 456)	
KAR Auction Services Inc.	(75)	(1 342)	(1 429)	
Kelly Services Inc.	(32)	(711)	(819)	
Kimball International Inc.	(73)	(728)	(722)	
Lindsay Corp.	(2)	(384)	(343)	
Manitex International Inc.	(499)	(4 747)	(4 178)	
Matson Inc.	(4)	(468)	(376)	
Mueller Industries Inc.	(8)	(595)	(550)	
MYR Group Inc.	(2)	(301)	(227)	
Odyssey Marine Exploration Inc.	(49)	(358)	(216)	
Orbital Energy Group Inc.	(768)	(1 244)	(624)	
Orion Energy Systems Inc.	(65)	(262)	(169)	
Orion Group Holdings Inc.	(96)	(611)	(282)	
Otis Worldwide Corp.	(10)	(896)	(912)	
Park Aerospace Corp.	(22)	(359)	(362)	
Parsons Corp.	(12)	(559)	(626)	
RBC Bearings Inc.	(2)	(453)	(477)	
Shyft Group Inc.	(7)	(370)	(168)	
Skillsoft Corp.	(318)	(3 499)	(1 444)	
Snap-on Inc.	(14)	(3 627)	(3 558)	
Spirit Aerosystems Holdings Inc.	(520)	(22 676)	(19 654)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
SPX Corp.	(19)	(1 223)	(1 295)	
Standex International Corp.	(5)	(652)	(547)	
Stanley Black & Decker Inc.	(10)	(1 346)	(1 353)	
Tennant Co.	(4)	(320)	(306)	
Titan International Inc.	(294)	(4 214)	(5 727)	
TrueBlue Inc.	(13)	(457)	(300)	
Twin Disc Inc.	(33)	(633)	(386)	
Watts Water Technologies Inc.	(4)	(705)	(634)	
Willdan Group Inc.	(515)	(18 809)	(18 322)	
		(223 161)	(184 583)	(0,91)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021: -0,87 %)				
Acushnet Holdings Corp.	(30)	(1 591)	(1 613)	
AMMO Inc.	(1 300)	(10 501)	(6 456)	
Build-A-Bear Workshop Inc.	(16)	(380)	(339)	
Caesars Entertainment Inc.	(24)	(1 365)	(1 186)	
Callaway Golf Co.	(27)	(706)	(711)	
CarLotz Inc.	(449)	(2 225)	(228)	
Chico's FAS Inc.	(1 517)	(9 969)	(9 726)	
China Automotive Systems Inc.	(874)	(4 127)	(3 044)	
Crocs Inc.	(198)	(14 197)	(12 431)	
Culp Inc.	(41)	(410)	(227)	
Deckers Outdoor Corp.	(2)	(661)	(659)	
Denny's Corp.	(57)	(794)	(638)	
Drive Shack Inc.	(369)	(734)	(652)	
Ethan Allen Interiors Inc.	(91)	(2 925)	(2 372)	
Fiesta Restaurant Group Inc.	(30)	(366)	(276)	
Flexsteel Industries Inc.	(26)	(745)	(604)	
Fossil Group Inc.	(611)	(10 029)	(4 075)	
Full House Resorts Inc.	(113)	(1 106)	(886)	
Genesco Inc.	(10)	(815)	(644)	
Gentherm Inc.	(9)	(794)	(725)	
G-III Apparel Group Ltd.	(15)	(465)	(391)	
GoPro Inc.	(165)	(1 386)	(1 177)	
Graham Holdings Co.	(1)	(737)	(731)	
GrowGeneration Corp.	(649)	(26 445)	(3 005)	
Hamilton Beach Brands Holding Co., cat. A	(19)	(362)	(304)	
Haverty Furniture Cos Inc.	(10)	(341)	(299)	
Horizon Global Corp.	(100)	(887)	(210)	
Inspired Entertainment Inc.	(54)	(814)	(600)	
Kandi Technologies Group Inc.	(283)	(2 181)	(876)	
Lear Corp.	(2)	(435)	(325)	
Lifetime Brands Inc.	(19)	(437)	(271)	
LL Flooring Holdings Inc.	(46)	(748)	(556)	
Lordstown Motors Corp.	(323)	(743)	(658)	
Lovesac Co.	(106)	(7 939)	(3 760)	
Luminar Technologies Inc.	(443)	(6 312)	(3 389)	
MDC Holdings Inc.	(5)	(316)	(208)	
Motorcar Parts of America Inc.	(778)	(18 792)	(13 167)	
Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc.	(5)	(330)	(379)	
Party City Holdco Inc.	(659)	(1 127)	(1 122)	
Patrick Industries Inc.	(18)	(1 358)	(1 204)	
Peloton Interactive Inc.	(1 654)	(27 392)	(19 586)	
Pool Corp.	(1)	(432)	(453)	
Purple Innovation Inc.	(1 146)	(34 827)	(4 524)	
RealReal Inc.	(336)	(1 767)	(1 079)	
Rent-A-Center Inc.	(16)	(512)	(401)	
Revolve Group Inc.	(10)	(423)	(334)	
RH	(1)	(321)	(274)	
SeaWorld Entertainment Inc.	(10)	(870)	(570)	
Shift Technologies Inc.	(1 704)	(10 395)	(1 480)	
Skechers USA Inc.	(137)	(6 269)	(6 288)	
Smith & Wesson Brands Inc.	(14)	(436)	(237)	
Sportsman's Warehouse Holdings Inc.	(78)	(997)	(965)	
Stoneridge Inc.	(21)	(520)	(465)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Strattec Security Corp.	(24)	(1 108)	(1 026)	
Terminix Global Holdings Inc.	(7)	(373)	(367)	
Visteon Corp.	(31)	(4 306)	(4 142)	
Winnebago Industries Inc.	(6)	(408)	(376)	
XL Fleet Corp.	(1 925)	(15 926)	(2 856)	
XPEL Inc.	(28)	(1 963)	(1 659)	
		(245 840)	(127 206)	(0,63)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021: -0,45 %)				
22nd Century Group Inc.	(121)	(347)	(332)	
Alico Inc.	(14)	(648)	(643)	
Calavo Growers Inc.	(59)	(3 052)	(3 175)	
Celsius Holdings Inc.	(689)	(60 910)	(58 002)	
Chefs' Warehouse Inc.	(517)	(11 591)	(25 936)	
Embotelladora Andina SA	(23)	(351)	(330)	
Freshpet Inc.	(43)	(3 631)	(2 878)	
John B Sanfilippo & Son Inc.	(3)	(338)	(281)	
Landec Corp.	(226)	(2 921)	(2 907)	
LifeMD Inc.	(404)	(2 213)	(1 063)	
Lifeway Foods Inc.	(100)	(741)	(641)	
MedAvail Holdings Inc.	(324)	(674)	(639)	
Medifast Inc.	(11)	(2 751)	(2 561)	
Natural Health Trends Corp.	(64)	(576)	(443)	
Nu Skin Enterprises Inc.	(7)	(406)	(391)	
SpartanNash Co.	(8)	(348)	(311)	
Utz Brands Inc.	(23)	(420)	(410)	
Vector Group Ltd.	(19)	(364)	(257)	
WD-40 Co.	(2)	(472)	(519)	
Whole Earth Brands Inc.	(205)	(2 520)	(1 640)	
		(95 274)	(103 359)	(0,51)
Soins de santé (31 décembre 2021: -1,82 %)				
9 Meters Biopharma Inc.	(890)	(687)	(299)	
Accelerate Diagnostics Inc.	(345)	(345)	(442)	
Accuray Inc.	(244)	(723)	(617)	
AdaptHealth Corp.	(562)	(16 474)	(13 078)	
Agenus Inc.	(438)	(917)	(1 096)	
Alaunos Therapeutics Inc.	(2 872)	(11 659)	(4 594)	
Alphatec Holdings Inc.	(965)	(12 750)	(8 141)	
ANI Pharmaceuticals Inc.	(23)	(1 073)	(880)	
Apellis Pharmaceuticals Inc.	(7)	(340)	(408)	
AquaBounty Technologies Inc.	(1 011)	(3 498)	(2 230)	
Ardelyx Inc.	(508)	(471)	(387)	
Artivion Inc.	(14)	(356)	(341)	
Asensus Surgical Inc.	(1 965)	(2 663)	(1 009)	
Aspira Women's Health Inc.	(1 282)	(1 515)	(972)	
Atossa Therapeutics Inc.	(313)	(512)	(440)	
AVEO Pharmaceuticals Inc.	(113)	(494)	(956)	
Avid Bioservices Inc.	(323)	(7 074)	(6 358)	
Axsome Therapeutics Inc.	(110)	(3 283)	(5 435)	
Beam Therapeutics Inc.	(321)	(34 326)	(16 029)	
BioLife Solutions Inc.	(404)	(11 763)	(7 197)	
Bionano Genomics Inc.	(5 877)	(22 765)	(10 462)	
Cardiff Oncology Inc.	(739)	(3 986)	(2 097)	
Celcuity Inc.	(208)	(2 669)	(2 442)	
Cerus Corp.	(56)	(357)	(382)	
Checkpoint Therapeutics Inc.	(594)	(2 339)	(789)	
Clearside Biomedical Inc.	(54)	(376)	(102)	
ContraFect Corp.	(69)	(338)	(273)	
CorMedix Inc.	(267)	(1 350)	(1 385)	
Cue Biopharma Inc.	(85)	(391)	(273)	
CytoSorbents Corp.	(59)	(345)	(167)	
Deciphera Pharmaceuticals Inc.	(48)	(597)	(814)	
DermTech Inc.	(627)	(7 049)	(4 481)	
Epizyme Inc.	(249)	(360)	(472)	
Evelo Biosciences Inc.	(114)	(399)	(310)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Evolus Inc.	(444)	(6 205)	(6 644)	
Fulgent Genetics Inc.	(11)	(798)	(774)	
Galectin Therapeutics Inc.	(105)	(345)	(177)	
Geron Corp.	(636)	(1 160)	(1 272)	
Haemonetics Corp.	(10)	(714)	(841)	
HealthEquity Inc.	(8)	(717)	(634)	
iBio Inc.	(4 529)	(7 039)	(1 542)	
Ideaya Biosciences Inc.	(23)	(699)	(409)	
IGM Biosciences Inc.	(55)	(1 273)	(1 279)	
Immunic Inc.	(353)	(4 406)	(1 580)	
ImmunityBio Inc.	(1 092)	(6 108)	(5 240)	
Immunogen Inc.	(1 626)	(9 766)	(9 439)	
Immune Bio Inc.	(30)	(370)	(342)	
Inovio Pharmaceuticals Inc.	(835)	(2 032)	(1 863)	
Insulet Corp.	(1)	(299)	(281)	
Integer Holdings Corp.	(3)	(321)	(273)	
Integra LifeSciences Holdings Corp.	(4)	(359)	(279)	
Invitae Corp.	(1 184)	(13 652)	(3 727)	
iRhythm Technologies Inc.	(27)	(3 768)	(3 763)	
KORU Medical Systems Inc.	(269)	(782)	(878)	
Kura Oncology Inc.	(11)	(372)	(260)	
La Jolla Pharmaceutical Co.	(172)	(883)	(708)	
Lantheus Holdings Inc.	(25)	(2 030)	(2 129)	
Ligand Pharmaceuticals Inc., cat. B	(26)	(4 372)	(2 992)	
MannKind Corp.	(1 868)	(9 687)	(9 181)	
Marinus Pharmaceuticals Inc.	(269)	(3 027)	(1 679)	
MediciNova Inc.	(121)	(372)	(395)	
Merit Medical Systems Inc.	(4)	(323)	(280)	
Merrimack Pharmaceuticals Inc.	(147)	(1 221)	(1 128)	
Mersana Therapeutics Inc.	(491)	(2 758)	(2 926)	
Milestone Scientific Inc.	(572)	(1 458)	(676)	
MiMedx Group Inc.	(372)	(2 554)	(1 665)	
Moderna Inc.	(202)	(40 765)	(37 223)	
Mustang Bio Inc.	(200)	(362)	(151)	
National Research Corp.	(100)	(4 515)	(4 938)	
NightHawk Biosciences Inc.	(149)	(1 161)	(490)	
Ocugen Inc.	(1 137)	(5 424)	(3 329)	
Omeros Corp.	(91)	(346)	(323)	
Oncocyte Corp.	(761)	(1 563)	(883)	
OptimizeRx Corp.	(67)	(6 870)	(2 367)	
Oramed Pharmaceuticals Inc.	(234)	(1 366)	(1 382)	
OraSure Technologies Inc.	(201)	(1 129)	(703)	
Organogenesis Holdings Inc.	(217)	(1 367)	(1 366)	
Otonomy Inc.	(287)	(725)	(770)	
Outlook Therapeutics Inc.	(1 907)	(3 829)	(2 509)	
Pacific Biosciences of California Inc.	(772)	(5 334)	(4 402)	
Palatin Technologies Inc.	(1 146)	(925)	(415)	
PAVmed Inc.	(1 002)	(2 709)	(1 208)	
Pennant Group Inc.	(40)	(1 240)	(661)	
Pieris Pharmaceuticals Inc.	(232)	(494)	(560)	
Precision BioSciences Inc.	(336)	(731)	(693)	
Progyny Inc.	(29)	(1 261)	(1 087)	
QuidelOrtho Corp.	(8)	(914)	(1 003)	
Revance Therapeutics Inc.	(82)	(1 485)	(1 462)	
Rigel Pharmaceuticals Inc.	(258)	(804)	(376)	
Scholar Rock Holding Corp.	(40)	(785)	(283)	
SCYNEXIS Inc.	(547)	(2 874)	(1 312)	
Seagen Inc.	(2)	(456)	(456)	
Seelos Therapeutics Inc.	(550)	(858)	(483)	
Sesen Bio Inc.	(275)	(315)	(287)	
Solid Biosciences Inc.	(27)	(343)	(21)	
Spectrum Pharmaceuticals Inc.	(1 000)	(1 552)	(1 006)	
Staar Surgical Co.	(10)	(723)	(915)	
Standard BioTools Inc.	(229)	(890)	(473)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Stereotaxis Inc.	(111)	(364)	(263)	
Surgery Partners Inc.	(26)	(959)	(970)	
TG Therapeutics Inc.	(737)	(6 194)	(4 040)	
Tilray Brands Inc.	(700)	(4 499)	(2 807)	
Tricida Inc.	(51)	(643)	(637)	
Vapotherm Inc.	(286)	(1 285)	(933)	
Vaxart Inc.	(477)	(3 179)	(2 154)	
Veracyte Inc.	(209)	(7 389)	(5 365)	
Vericel Corp.	(9)	(569)	(292)	
Verrica Pharmaceuticals Inc.	(35)	(350)	(87)	
Vir Biotechnology Inc.	(23)	(663)	(756)	
Viracta Therapeutics Inc.	(61)	(367)	(305)	
VistaGen Therapeutics Inc.	(1 087)	(2 304)	(1 234)	
VolitionRX Ltd.	(164)	(707)	(434)	
West Pharmaceutical Services Inc.	(1)	(544)	(390)	
Xencor Inc.	(31)	(1 540)	(1 094)	
Xeris Biopharma Holdings Inc.	(192)	(527)	(381)	
XOMA Corp.	(67)	(1 473)	(1 926)	
Zentalis Pharmaceuticals Inc.	(108)	(3 178)	(3 915)	
		(374 963)	(262 134)	(1,30)
Services financiers (31 décembre 2021: -0,17 %)				
ACNB Corp.	(50)	(2 204)	(1 915)	
AG Mortgage Investment Trust Inc.	(99)	(986)	(862)	
Alerus Financial Corp.	(100)	(2 998)	(3 071)	
Amalgamated Financial Corp.	(50)	(1 085)	(1 276)	
Ambac Financial Group Inc.	(1 182)	(12 139)	(17 306)	
Annaly Capital Management Inc.	(1)	(11)	(8)	
Ares Commercial Real Estate Corp.	(19)	(359)	(300)	
Arlington Asset Investment Corp.	(347)	(1 543)	(1 455)	
ARMOUR Residential REIT Inc.	(185)	(1 945)	(1 680)	
Banc of California Inc.	(34)	(796)	(773)	
Bancorp Inc.	(12)	(379)	(302)	
BankFinancial Corp.	(28)	(365)	(339)	
Berkshire Hills Bancorp Inc.	(12)	(369)	(383)	
BrightSphere Investment Group Inc.	(12)	(369)	(279)	
BrightSpire Capital Inc.	(206)	(2 109)	(2 006)	
Business First Bancshares Inc.	(13)	(369)	(357)	
Capital City Bank Group Inc.	(100)	(3 382)	(3 598)	
Cherry Hill Mortgage Investment Corp.	(323)	(2 664)	(2 667)	
Columbia Financial Inc.	(89)	(2 219)	(2 504)	
Community Bank System Inc.	(11)	(898)	(898)	
CVB Financial Corp.	(13)	(354)	(416)	
First Community Bankshares Inc.	(10)	(351)	(379)	
First Interstate Bancsystem Inc.	(14)	(651)	(688)	
First Northwest Bancorp	(100)	(2 108)	(2 012)	
First Savings Financial Group Inc.	(100)	(3 058)	(3 088)	
Flushing Financial Corp.	(42)	(1 166)	(1 152)	
Franklin Resources Inc.	(23)	(741)	(692)	
FS Bancorp Inc.	(10)	(374)	(370)	
Greene County Bancorp Inc.	(50)	(3 180)	(2 921)	
HCI Group Inc.	(3)	(383)	(262)	
Hingham Institution For Savings The	(1)	(407)	(366)	
Invesco Mortgage Capital Inc.	(217)	(10 338)	(4 109)	
Lakeland Financial Corp.	(4)	(336)	(343)	
Live Oak Bancshares Inc.	(74)	(5 005)	(3 235)	
Lument Finance Trust Inc.	(101)	(364)	(310)	
Maiden Holdings Ltd.	(669)	(2 132)	(1 674)	
MBIA Inc.	(163)	(2 777)	(2 597)	
Nicolet Bankshares Inc.	(2)	(196)	(187)	
Northfield Bancorp Inc.	(60)	(951)	(1 008)	
Orchid Island Capital Inc.	(644)	(2 904)	(2 368)	
Origin Bancorp Inc.	(21)	(1 050)	(1 051)	
Palomar Holdings Inc.	(5)	(542)	(415)	
Park National Corp.	(4)	(650)	(626)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Primis Financial Corp.	(49)	(825)	(862)	
Provident Financial Holdings Inc.	(18)	(349)	(344)	
RBB Bancorp	(50)	(1 332)	(1 333)	
Republic First Bancorp Inc.	(101)	(495)	(496)	
Silvergate Capital Corp.	(39)	(4 523)	(2 693)	
Simmons First National Corp.	(5)	(123)	(137)	
Southern Missouri Bancorp Inc.	(100)	(5 754)	(5 838)	
TPG RE Finance Trust Inc.	(23)	(364)	(267)	
Trico Bancshares	(44)	(2 556)	(2 590)	
Valley National Bancorp	(60)	(934)	(806)	
Washington Federal Inc.	(12)	(479)	(465)	
Waterstone Financial Inc.	(17)	(354)	(374)	
Westamerica BanCorp	(5)	(364)	(359)	
Western Asset Mortgage Capital Corp.	(707)	(1 913)	(1 104)	
WisdomTree Investments Inc.	(1 144)	(8 435)	(7 482)	
World Acceptance Corp.	(9)	(2 615)	(1 303)	
		(108 622)	(98 701)	(0,49)
Technologies de l'information (31 décembre 2021: -0,70 %)				
Akoustis Technologies Inc.	(193)	(1 862)	(921)	
Arlo Technologies Inc.	(31)	(346)	(251)	
Atomera Inc.	(449)	(8 017)	(5 433)	
Avnet Inc.	(7)	(351)	(387)	
AXT Inc.	(36)	(360)	(272)	
Badger Meter Inc.	(9)	(1 111)	(939)	
Bill.Com Holdings Inc.	(53)	(7 967)	(7 516)	
BTRS Holdings Inc.	(600)	(5 196)	(3 854)	
Cleantech Inc.	(366)	(6 181)	(1 851)	
Comtech Telecommunications Corp.	(34)	(1 137)	(398)	
CTS Corp.	(21)	(959)	(922)	
Digimarc Corp.	(51)	(1 687)	(930)	
Digital Turbine Inc.	(915)	(43 514)	(20 620)	
Eastman Kodak Co.	(113)	(564)	(676)	
Ebix Inc.	(8)	(382)	(174)	
Entegris Inc.	(5)	(672)	(594)	
Fabrinet	(2)	(301)	(209)	
FARO Technologies Inc.	(5)	(357)	(199)	
Fastly Inc.	(937)	(15 791)	(14 033)	
Identiv Inc.	(46)	(1 406)	(687)	
Immersion Corp.	(902)	(7 095)	(6 213)	
Impinj Inc.	(41)	(1 203)	(3 103)	
Intevac Inc.	(115)	(704)	(718)	
Iteris Inc.	(450)	(1 749)	(1 678)	
Kaleyra Inc.	(210)	(2 240)	(553)	
Kopin Corp.	(605)	(1 921)	(874)	
Lam Research Corp.	(1)	(611)	(550)	
Littelfuse Inc.	(37)	(11 986)	(12 125)	
MACOM Technology Solutions Holdings Inc.	(4)	(331)	(238)	
Marathon Digital Holdings Inc.	(814)	(18 792)	(5 607)	
Meta Materials Inc.	(4 935)	(12 414)	(6 557)	
Methode Electronics Inc.	(19)	(1 110)	(908)	
MicroStrategy Inc.	(7)	(1 617)	(1 484)	
MICT Inc.	(732)	(1 328)	(537)	
Mitek Systems Inc.	(244)	(3 261)	(2 908)	
Napco Security Technologies Inc.	(254)	(4 941)	(6 746)	
Onto Innovation Inc.	(12)	(1 197)	(1 080)	
OSI Systems Inc.	(3)	(357)	(331)	
PAR Technology Corp.	(135)	(6 184)	(6 529)	
Park City Group Inc.	(150)	(1 189)	(851)	
PDF Solutions Inc.	(141)	(3 373)	(3 912)	
PFSweb Inc.	(47)	(727)	(713)	
Photronics Inc.	(49)	(1 111)	(1 231)	
Plexus Corp.	(3)	(362)	(304)	
Powerfleet Inc.	(510)	(1 951)	(1 428)	
Rekor Systems Inc.	(645)	(4 066)	(1 464)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Repay Holdings Corp.	(545)	(12 614)	(9 034)	
Riot Blockchain Inc.	(1 256)	(37 436)	(6 789)	
ShotSpotter Inc.	(247)	(13 574)	(8 574)	
SiTime Corp.	(17)	(5 034)	(3 575)	
Smith Micro Software Inc.	(946)	(3 879)	(3 014)	
SolarEdge Technologies Inc.	(2)	(705)	(706)	
Super Micro Computer Inc.	(7)	(463)	(364)	
Turtle Beach Corp.	(118)	(4 699)	(1 862)	
Velodyne Lidar Inc.	(2 766)	(24 402)	(3 408)	
Veritone Inc.	(399)	(12 164)	(3 361)	
Wrap Technologies Inc.	(381)	(1 376)	(914)	
		(306 327)	(171 109)	(0,85)
Services de communication (31 décembre 2021: -0,19 %)				
ATN International Inc.	(100)	(5 369)	(6 051)	
Cardlytics Inc.	(64)	(5 933)	(1 842)	
Cinedigm Corp.	(2 984)	(5 930)	(1 894)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	(756)	(2 914)	(1 043)	
CuriosityStream Inc.	(483)	(1 716)	(1 053)	
Entravision Communications Corp.	(118)	(792)	(694)	
EW Scripps Co.	(294)	(5 541)	(4 729)	
Gannett Co Inc.	(286)	(1 425)	(1 070)	
Globalstar Inc.	(1 789)	(3 010)	(2 839)	
Hemisphere Media Group Inc.	(23)	(343)	(226)	
IAC/InterActiveCorp	(5)	(565)	(490)	
Liberty Media Corp-Liberty Formula One	(10)	(762)	(819)	
Magnite Inc.	(53)	(637)	(607)	
Marchex Inc., cat. B	(112)	(369)	(191)	
Marcus Corp.	(24)	(526)	(457)	
National CineMedia Inc.	(237)	(363)	(280)	
New York Times Co.	(21)	(778)	(756)	
Reading International Inc.	(168)	(882)	(782)	
Travelzoo	(150)	(1 527)	(1 173)	
World Wrestling Entertainment Inc.	(6)	(487)	(484)	
		(39 869)	(27 480)	(0,14)
Services publics (31 décembre 2021: -0,03 %)				
Artesian Resources Corp.	(100)	(6 048)	(6 343)	
Cadiz Inc.	(204)	(2 192)	(613)	
Pure Cycle Corp.	(92)	(1 370)	(1 251)	
		(9 610)	(8 207)	(0,04)
Immobilier (31 décembre 2021: -0,18 %)				
Apartment Investment and Management Co.	(129)	(964)	(1 065)	
Armada Hoffler Properties Inc.	(46)	(831)	(762)	
Caretrust REIT Inc.	(17)	(383)	(404)	
Douglas Elliman Inc.	(9)	(115)	(56)	
eXp World Holdings Inc.	(1 022)	(40 710)	(15 517)	
Global Net Lease Inc.	(33)	(574)	(603)	
Innovative Industrial Properties Inc.	(9)	(2 212)	(1 276)	
LXP Industrial Trust	(192)	(2 656)	(2 660)	
Macerich Co.	(5)	(111)	(56)	
Maui Land & Pineapple Co Inc.	(33)	(480)	(403)	
MFA Financial Inc.	(35)	(500)	(485)	
Plymouth Industrial REIT Inc.	(48)	(1 110)	(1 086)	
Postal Realty Trust Inc.	(79)	(1 670)	(1 518)	
Stratus Properties Inc.	(17)	(918)	(707)	
Tanger Factory Outlet Centers Inc.	(21)	(522)	(385)	
Veris Residential Inc.	(67)	(1 186)	(1 144)	
Whitestone REIT	(261)	(3 538)	(3 619)	
Zillow Group Inc.	(2)	(302)	(82)	
		(58 782)	(31 828)	(0,16)
Total des actions américaines – position vendeur		(1 793 234)	(1 336 589)	(6,62)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Actions étrangères – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2021: 1,91 %)				
Adaro Energy Indonesia Tbk PT	12 300	1 684	3 046	
Aker Bp ASA	53	2 362	2 367	
Aker Solutions ASA	4 484	11 905	15 667	
Borr Drilling Ltd.	623	1 791	3 579	
Boss Energy Ltd.	1 194	1 947	1 875	
BP PLC	1 850	70 073	67 655	
BW Energy Ltd.	285	1 060	951	
BW LPG Ltd.	285	1 716	2 713	
BW Offshore Ltd.	307	1 399	1 066	
Capricorn Energy PLC	153	534	523	
DCC Plc	13	1 311	1 038	
Delek Group Ltd.	79	13 759	13 237	
DHT Holdings Inc.	309	2 181	2 443	
DNO ASA	878	1 587	1 566	
Dorian LPG Ltd.	363	6 486	7 117	
ENEOS Holdings Inc.	2 900	13 514	14 145	
ENI SpA	40	697	611	
Enquest PLC	3 647	1 829	1 337	
Equinor ASA, CAAE	1 295	58 819	58 066	
Établissements Maurel et Prom SA	560	3 051	3 364	
FLEX LNG Ltd.	211	5 695	7 504	
Frontline Ltd., NYSE	159	1 817	1 817	
Harbour Energy PLC	3 365	22 845	19 178	
Harum Energy TBK PT	45 500	888	6 087	
Indo Tambangraya Megah Tbk PT	300	398	797	
International Seaways Inc.	179	4 064	4 895	
Japan Petroleum Exploration Co., Ltd.	600	13 075	18 259	
Magnora ASA	405	1 244	920	
MOL Hungarian Oil & Gas PLC	343	3 500	3 402	
Nabors Industries Ltd.	62	11 244	10 709	
Nabors Industries Ltd., bons de souscription, éch. le 11 juin 2026	32	-	1 320	
Nippon Coke & Engineering Co., Ltd.	400	472	441	
Nordic American Tankers Ltd.	3 077	10 408	8 454	
OMV AG	49	3 054	2 958	
Panoro Energy ASA	94	289	344	
Pantheon Resources PLC	358	787	501	
PetroChina Co., Ltd., CAAE	29	1 852	1 745	
Petrofac Ltd.	260	496	457	
Petroleo Brasileiro SA, parts	2 518	44 572	37 938	
PGS ASA	781	786	678	
Polski Koncern Naftowy Orlen SA	40	885	786	
Santos Ltd.	2 219	15 734	14 605	
Saras SpA	9 547	9 760	17 857	
Schlumberger NV	698	35 613	32 198	
Scorpio Tankers Inc.	123	4 217	5 476	
Semirara Mining & Power Corp.	2 600	1 928	2 135	
SFL Corp. Ltd.	1 133	10 833	13 870	
Shell PLC, CAAE	56	3 776	3 777	
Teekay Corp.	553	2 325	2 054	
TORM PLC	71	979	1 237	
TotalEnergies SE	1 669	112 480	113 372	
Transocean Ltd.	4 832	22 519	20 756	
Vallourec SA	644	8 459	9 888	
Whitehaven Coal Ltd.	1 381	6 518	5 929	
YPF SA	5 085	30 067	21 384	
		591 284	596 094	2,95
Matières premières (31 décembre 2021: 3,59 %)				
Amcor PLC	428	6 572	6 863	
Angang Steel Co., Ltd.	2 000	1 141	963	
Anglo American PLC	1 018	65 380	46 839	
Antofagasta PLC	89	2 311	1 610	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
APERAM SA	13	982	465	
Arafura Resources Ltd.	1 397	388	353	
Asahi Kasei Corp.	2 700	33 297	26 560	
Aurelia Metals Ltd.	925	729	209	
Bekaert SA	29	1 190	1 215	
BillerudKorsnas AB	145	3 417	2 178	
BlueScope Steel Ltd.	24	457	338	
Borregaard ASA	196	3 140	4 100	
Brickworks Ltd.	33	623	543	
Cementir Holding NV	37	352	309	
Centamin PLC	1 863	3 263	2 292	
China Hongqiao Group Ltd.	1 999	3 407	2 915	
Ciech SA	93	1 269	1 001	
Croda International PLC	386	56 208	39 136	
D&L Industries Inc.	3 300	519	528	
Dai Nippon Toryo Co., Ltd.	300	2 221	2 020	
Dongyue Group Ltd.	1	2	2	
Ferroglobe PLC	38	398	291	
Firefinch Ltd.	2 091	2 355	371	
Fresnillo PLC	2 785	32 587	33 455	
Fufeng Group Ltd.	1 000	490	827	
Fujikura Kasei Co., Ltd.	300	2 182	1 316	
Geostr Corp.	100	427	281	
Glencore PLC	6 638	53 165	46 286	
Gun-Ei Chemical Industry Co., Ltd.	100	2 499	2 434	
H&R GmbH & Co KGaA	36	377	278	
Hexpol AB	22	355	241	
Hokkan Holdings Ltd.	100	1 198	1 165	
Holcim AG	1 097	65 975	60 381	
Iluka Resources Ltd.	154	1 374	1 290	
Incitec Pivot Ltd.	157	541	461	
Israel Corp. Ltd.	22	13 312	12 439	
Johnson Matthey PLC	394	11 977	11 885	
KH Neochem Co., Ltd.	200	7 031	4 723	
Krakatau Steel Persero Tbk PT	142 700	4 035	4 374	
Kunimine Industries Co., Ltd.	100	1 144	884	
Lanxess AG	11	557	507	
Leo Lithium Ltd.	1 493	-	735	
Linde PLC	144	51 130	53 410	
Liontown Resources Ltd.	3 836	5 958	3 590	
LyondellBasell Industries NV	75	10 351	8 461	
Mitsubishi Gas Chemical Co Inc.	500	10 940	9 281	
Mount Gibson Iron Ltd.	3 475	2 092	1 665	
New Century Resources Ltd.	383	771	567	
Newcrest Mining Ltd., TSE	100	2 237	1 804	
Nickel Asia Corp.	5 100	801	754	
Nickel Industries Ltd.	3 460	4 613	2 992	
Nihon Parkerizing Co., Ltd.	100	1 173	846	
Nippon Kayaku Co., Ltd.	400	4 192	4 170	
Nippon Sanso Holdings Corp.	100	2 446	2 054	
Nissan Chemical Corp.	400	28 473	23 738	
NOF Corp.	200	12 384	9 552	
Norsk Hydro ASA	2 286	25 388	16 464	
Norske Skog ASA	489	3 871	3 492	
Orica Ltd.	797	11 624	11 149	
Outokumpu OYJ	1 605	9 801	8 541	
OZ Minerals Ltd.	187	3 982	2 946	
Perseus Mining Ltd.	557	988	783	
Philex Mining Corp.	5 100	662	410	
Philex Mining Corp., droits, éch. le 25 juill. 2022	869	-	6	
POSCO Holdings Inc.	4	378	230	
Rio Tinto PLC	402	38 049	31 632	
Salzgitter AG	8	398	251	
Sandfire Resources Ltd.	2 396	11 727	9 458	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Sasa Polyester Sanayi AS	706	1 352	2 228	
SGL Carbon SE	1 234	12 222	9 960	
Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	300	58 048	43 583	
Sims Ltd.	162	2 839	1 970	
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	515	58 070	55 491	
Soken Chemical & Engineering Co., Ltd.	100	1 835	1 862	
South Manganese Investment Ltd.	7 000	1 295	1 001	
Stora Enso OYJ	78	1 910	1 574	
Suzano SA	44	544	538	
Svenska Cellulosa AB SCA	30	740	577	
Takasago International Corp.	100	3 144	2 311	
Tokuyama Corp.	300	6 111	4 917	
Tokyo Steel Manufacturing Co., Ltd.	200	2 869	2 841	
Toray Industries Inc.	2 200	14 938	15 901	
Tosoh Corp.	1 100	22 256	17 599	
Toyo Seikan Group Holdings Ltd.	1 000	15 212	13 474	
Tronox Holdings PLC	170	4 329	3 684	
Umicore SA	371	19 288	16 671	
Vale SA	2 920	68 188	55 106	
Venator Materials PLC	162	366	435	
Voestalpine AG	19	778	520	
Zeon Corp.	1 000	18 784	12 477	
		948 394	798 029	3,95
Industries (31 décembre 2021: 10,39 %)				
2020 Bulkers Ltd.	23	364	338	
Aalberts NV	427	27 540	21 416	
AddTech AB	700	6 490	11 755	
ALD SA	271	4 728	4 064	
Alfa Laval AB	415	18 844	12 883	
Alfen Beheer BV	145	17 335	17 239	
Alinco Inc.	100	1 120	813	
Allegion PLC	25	3 579	3 157	
Alstom SA	64	2 493	1 863	
Amadeus Fire AG	1	277	160	
ANA Holdings Inc.	1 200	34 935	28 480	
Andritz AG	77	4 408	3 992	
AP Moller - Maersk A/S	1	3 526	3 002	
Arcadis NV	37	1 994	1 602	
Asahi Kogyosha Co., Ltd.	100	1 599	1 608	
Aspo OYJ	200	2 808	2 077	
Atlas Arteria Ltd.	1 369	9 901	9 788	
Avon Protection PLC	11	411	169	
Babcock International Group PLC	4 624	24 971	22 369	
BAE Systems PLC	5 072	61 208	65 965	
Balfour Beatty PLC	572	2 659	2 278	
Bando Chemical Industries Ltd.	700	8 067	6 121	
Befesa SA	93	8 544	5 819	
Beijer Alma AB	78	1 951	1 653	
Biffa PLC	1 914	11 888	11 238	
Bobst Group SA	8	871	662	
Bodycote PLC	142	2 193	1 171	
Bossard Holding AG	7	3 044	1 743	
Bystronic AG	15	26 173	14 027	
Capital Environment Holdings Ltd.	11 958	359	366	
Cargotec OYJ	8	364	271	
CEMBRE SPA	100	3 289	3 371	
Ceres Power Holdings PLC	297	3 550	2 550	
Cewe Stiftung & Co KGAA	4	695	434	
Chilled & Frozen Logistics Holdings Co., Ltd.	100	1 017	1 006	
China Merchants Port Holdings Co., Ltd.	2 000	4 405	4 386	
CIR SpA-Compagnie Industriali	735	459	399	
Clarivate PLC	99	3 574	1 770	
CNH Industrial NV	268	5 053	3 983	
Concentric AB	48	1 969	1 066	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Corp America Airports SA	1 587	7 075	11 423	
CTT-Correios de Portugal SA	112	360	471	
D/S Norden A/S	153	7 064	6 825	
Daetwyler Holding AG	2	1 060	531	
Dai Nippon Printing Co., Ltd.	900	28 125	25 004	
Daihatsu Diesel Manufacturing Co., Ltd.	100	576	423	
Dassault Aviation SA	31	6 014	6 225	
Derichebourg SA	1 214	14 865	9 004	
Deutsche Post AG	789	43 379	38 028	
Deutz AG	384	3 881	1 907	
Diploma PLC	117	6 076	4 084	
Duerr AG	540	24 908	15 992	
Eaton Corp. PLC	113	24 302	18 365	
Elanders AB	63	1 662	945	
Elbit Systems Ltd.	43	11 272	12 626	
Elco Ltd.	51	1 976	4 223	
Embraer SA	860	12 070	9 740	
en Japan Inc.	100	3 871	1 683	
Enka Insaat ve Sanayi AS	7 787	10 368	10 372	
Epiroc AB, cat. A	653	19 311	12 984	
Epiroc AB, cat. B	81	2 101	1 409	
Experian PLC	18	873	678	
Fagerhult AB	50	380	286	
Ferguson PLC	80	15 108	11 515	
Firstgroup PLC	757	1 229	1 512	
Flsmidth & Co A/S	197	6 901	6 232	
Flughafen Zurich AG	35	7 786	6 805	
Fluidra SA	34	1 768	887	
FNM SpA	1 955	1 367	1 151	
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	319	24 041	17 853	
Frencken Group Ltd.	2 000	1 284	2 058	
Fugro NV	498	6 449	8 086	
Fuji Electric Co., Ltd.	100	6 327	5 336	
FULLCAST Holdings Co., Ltd.	100	1 996	2 063	
GEA Group AG	14	679	621	
Georg Fischer AG	12	798	759	
Getlink SE	769	16 280	17 454	
GMexico Transportes SAB de CV	200	483	450	
Gol Linhas Aereas Inteligentes SA	132	1 040	581	
Golden Ocean Group Ltd., NASD	1 793	22 624	26 922	
GT Capital Holdings Inc.	50	738	574	
H+H International A/S	7	355	169	
Heidelberger Druckmaschinen AG	2 695	7 085	5 179	
Hexatronic Group AB	305	3 051	2 926	
Hochtief AG	23	1 814	1 441	
IHI Corp.	200	6 178	6 893	
IMCD NV	309	76 747	54 568	
IMI PLC	29	722	533	
Inaba Denki Sangyo Co., Ltd.	200	5 818	5 061	
Inabata & Co., Ltd.	100	2 247	2 104	
Indutrade AB	254	6 809	5 965	
International Container Terminal Services Inc.	450	1 690	1 943	
Intrum AB	56	1 666	1 376	
Investment AB Latour	8	360	204	
Iseki & Co., Ltd.	100	1 707	1 112	
ISS A/S	657	15 521	13 332	
Japan Transcity Corp.	100	748	467	
JGC Holdings Corp.	400	4 708	6 662	
JMT Network Services PCL	500	1 513	1 336	
Johns Lyng Group Ltd.	204	1 393	1 039	
Johnson Controls International PLC	197	16 161	12 167	
Jungheinrich AG, actions priv.	463	29 090	12 987	
Kamei Corp.	100	1 306	998	
Kamigumi Co., Ltd.	900	21 615	22 424	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kawasaki Heavy Industries Ltd.	200	4 650	4 831	
Kingspan Group PLC KION	208	30 228	16 101	
Knorr-Bremse AG	12	974	881	
Konecranes OYJ	9	430	270	
Kongsberg Gruppen ASA	132	5 510	6 084	
Koninklijke BAM Groep NV	2 993	12 189	9 106	
Krones AG	6	725	589	
Kurita Water Industries Ltd.	200	9 626	9 324	
Leonardo SpA	1 247	14 249	16 275	
Lifco AB	1 524	25 584	31 510	
Lindab International AB	127	4 745	2 371	
Lonking Holdings Ltd.	12 000	5 458	3 748	
LT Group Inc.	3 000	892	570	
Maezawa Kyuso Industries Co., Ltd.	200	2 368	1 692	
Marlowe PLC	26	357	301	
Matsuda Sangyo Co., Ltd.	100	2 633	1 905	
Meier Tobler Group AG	64	1 670	2 070	
Meiji Shipping Co., Ltd.	300	2 399	2 868	
Metsa Board OYJ	63	577	675	
Metso Outotec Oyj	2 149	24 618	20 721	
Mirai Industry Co., Ltd.	100	1 469	1 430	
MISUMI Group Inc.	100	4 581	2 716	
Mitie Group PLC	1 698	1 979	1 490	
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	100	4 609	4 505	
Mitsubishi Logistics Corp.	600	19 215	18 487	
Mitsui E&S Holdings Co., Ltd.	400	2 174	1 272	
Mitsui OSK Lines Ltd.	1 600	42 983	47 172	
Mitsui-Soko Holdings Co., Ltd.	200	5 533	5 473	
Monadelphous Group Ltd.	35	357	309	
MTU Aero Engines AG	3	880	703	
Nexans SA	17	1 985	1 695	
Nibe Industrier AB	3 648	56 250	35 268	
Nihon M&A Center Holdings Inc.	1 000	26 660	13 701	
Nippon Concept Corp.	100	1 387	1 360	
Nissin Corp.	100	1 840	1 507	
Nitta Corp.	49	1 779	1 284	
Nitto Kogyo Corp.	900	22 615	20 056	
Nitto Seiko Co., Ltd.	100	612	447	
Nordex SE	1 237	22 203	13 572	
Noritake Co., Ltd.	100	4 671	3 827	
Norma Group SE	14	724	402	
NRW Holdings Ltd.	813	1 280	1 222	
Odakyu Electric Railway Co., Ltd.	100	2 151	1 733	
Onoken Co., Ltd.	400	5 321	5 313	
Openjobmetis Spa agenzia per il lavoro	54	838	655	
Pacific Basin Shipping Ltd.	1 996	1 252	984	
Pegasus Sewing Machine Manufacturing Co., Ltd.	300	1 586	1 701	
Pentair PLC	46	3 893	2 716	
Pfeiffer Vacuum Technology AG	1	246	202	
Phoenix Mecano AG	1	655	485	
PostNL NV	867	3 952	3 385	
PRIMA INDUSTRIE SPA	38	1 208	713	
Prysmian SpA	103	4 342	3 641	
Punch Industry Co., Ltd.	100	578	437	
QinetiQ Group PLC	211	1 123	1 215	
Ras Al Khaimah Ceramics	20 353	11 581	19 871	
Rational AG	18	17 446	13 460	
Recruit Holdings Co., Ltd.	1 200	92 582	45 520	
Redde Northgate PLC	60	367	317	
RELX PLC, CAAE	365	11 935	12 684	
Renewi PLC	92	1 251	1 042	
Rheinmetall AG	20	5 427	5 942	
ROCKWOOL A/S	3	1 333	869	
RS GROUP PLC	599	11 147	8 155	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ryobi Ltd.	100	1 559	984	
Safe Bulkers Inc.	1 270	2 152	6 258	
Salcef Group SpA	70	1 533	1 567	
Sandvik AB	1 678	48 510	35 032	
Sanyo Trading Co., Ltd.	100	1 391	927	
Schneider Electric SE	215	44 814	32 735	
Scope Metals Group Ltd.	30	1 594	1 683	
Senior PLC	264	710	479	
Sensata Technologies Holding PLC	44	2 595	2 345	
SFS Group AG	4	711	520	
Shimizu Corp.	100	829	712	
Siemens AG	45	6 764	5 892	
Siemens Gamesa Renewable Energy SA	47	1 456	1 135	
SIG PLC	441	358	205	
Signify NV	60	3 429	2 559	
Sinotrans Ltd.	16 000	4 594	5 918	
Sinotruk Hong Kong Ltd.	3 499	12 724	6 327	
SKF AB	178	3 929	3 372	
SmartGroup Corp. Ltd.	346	3 539	1 875	
Solar A/S	65	4 621	7 143	
Space Co., Ltd.	100	920	864	
Speedy Hire PLC	317	380	215	
Sthree PLC	45	374	251	
Stolt-Nielsen Ltd.	53	724	1 439	
Sumitomo Corp.	3 000	56 909	52 897	
Thoresen Thai Agencies PCL	5	1	2	
Tianjin Port Development Holdings Ltd.	3 987	413	426	
Tokyo Sangyo Co., Ltd.	100	672	673	
Toli Corp.	600	1 726	1 162	
TOMRA Systems ASA	421	12 722	10 042	
Toyo Engineering Corp.	200	2 321	1 225	
Trane Technologies PLC	66	17 041	11 057	
Travis Perkins PLC	39	870	591	
Tsubaki Nakashima Co., Ltd.	100	896	859	
TTCL PCL	4	1	1	
Turk Hava Yollari AO	3 607	6 940	13 042	
Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS	7 541	11 988	12 526	
Valmet OYJ	75	3 672	2 368	
Veidekke ASA	575	9 776	6 719	
Vinci SA	4	487	458	
Volex PLC	63	416	237	
Volution Group PLC	50	356	264	
Wacker Neuson SE	16	572	356	
Wallenius Wilhelmsen ASA	1 191	9 111	8 249	
Wartsila OYJ Abp	4 082	65 589	40 901	
Weir Group PLC	161	4 299	3 438	
Wienerberger AG	571	19 728	15 770	
Will Group Inc.	100	1 505	1 092	
YAMABIKO Corp.	300	4 791	3 262	
Yaskawa Electric Corp.	100	4 154	4 149	
Yurtec Corp.	100	859	701	
Zehnder Group AG	13	943	990	
ZTO Express Cayman Inc.	107	3 588	3 789	
Zumtobel Group AG	28	364	264	
		1 824 228	1 500 804	7,42
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021: 9,12 %)				
361 Degrees International Ltd.	2 998	744	2 090	
888 Holdings PLC	80	368	210	
ABC-Mart Inc.	300	20 620	17 091	
Abu Dhabi National Oil Co for Distribution PJSC	7 169	10 152	10 625	
Adidas AG	65	15 943	14 793	
Aeffe SpA	274	1 090	539	
Alibaba Group Holding Ltd.	3 496	58 619	64 310	
Alibaba Group Holding Ltd., CAAE	20	2 947	2 933	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Anta Sports Products Ltd.	400	6 477	6 339	
Aptiv PLC	75	15 516	8 617	
Arcos Dorados Holdings Inc.	1 804	12 874	15 685	
Aristocrat Leisure Ltd.	374	11 250	11 406	
Asics Corp.	100	2 345	2 329	
Atsugi Co., Ltd.	100	714	483	
Autogrill SpA	1 600	13 127	13 671	
BAIC Motor Corp. Ltd.	1 500	1 140	644	
Bandai Namco Holdings Inc.	100	8 832	9 095	
Basic-Fit NV	237	14 280	11 532	
Bellway PLC	365	19 741	12 271	
Beneteau SA	52	1 083	675	
Bertrandt AG	6	453	289	
Bloomerry Resorts Corp.	73 200	11 988	9 977	
Bridgestone Corp.	500	24 671	23 500	
Burberry Group PLC	539	15 357	13 856	
Calida Holding AG	100	3 945	5 491	
Card Factory PLC	4 775	4 986	3 452	
Casio Computer Co., Ltd.	100	1 734	1 195	
Cazoo Group Ltd.	69	551	64	
CECONOMY AG	806	3 757	2 891	
Central Automotive Products Ltd.	100	3 250	2 229	
Chaowei Power Holdings Ltd.	4 004	1 704	1 211	
China Dongxiang Group Co., Ltd.	12 981	846	950	
China Evergrande New Energy Vehicle Group Ltd.	3 000	1 558	1 578	
China Meidong Auto Holdings Ltd.	2 000	2 846	8 121	
China Travel International Investment Hong Kong Ltd.	2 000	484	539	
China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd.	21 999	23 254	26 834	
Cleanup Corp.	100	535	544	
Compass Group PLC	2 586	73 774	68 060	
Continental AG	200	17 843	17 936	
Crystal International Group Ltd.	1 000	279	446	
Currys PLC	374	842	399	
Delta Galil Industries Ltd.	28	1 277	1 768	
D'ieteren Group	234	22 878	44 053	
Dometic Group AB	20	367	151	
Dynam Japan Holdings Co., Ltd.	3 600	4 956	4 137	
Electrolux AB	270	4 833	4 679	
Elica SpA	100	420	371	
Elior Group SA	152	713	434	
Farfetch Ltd.	103	1 186	951	
Faurecia SE, PAR	139	6 046	3 546	
Faurecia SE, droits	139	-	310	
Feintool International Holding AG	33	2 656	836	
Fiverr International Ltd.	35	1 865	1 553	
Fleetwood Ltd.	306	507	352	
Flight Centre Travel Group Ltd.	214	3 967	3 295	
Fox Wixel Ltd.	4	868	584	
FuKoKu Co., Ltd.	100	1 029	927	
Gajah Tunggal Tbk PT	1 700	69	101	
Games Workshop Group PLC	7	835	733	
Garmin Ltd.	43	9 639	5 450	
Geely Automobile Holdings Ltd.	10 000	19 250	29 327	
Gestamp Automocion SA	90	556	401	
GLOBERIDE Inc.	100	3 371	2 021	
Great Wall Motor Co., Ltd.	6 500	13 590	17 246	
Greggs PLC	9	339	255	
Guangzhou Automobile Group Co., Ltd.	2 000	2 090	2 495	
H & M Hennes & Mauritz AB	1 164	18 393	17 900	
Haichang Ocean Park Holdings Ltd.	3 000	1 634	3 926	
HelloFresh SE	91	3 778	3 786	
Hermes International	33	68 404	47 485	
Hisense Home Appliances Group Co., Ltd.	4 000	4 935	5 826	
Honda Motor Co., Ltd.	45	1 443	1 402	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Hornbach Baumarkt AG	44	2 321	2 801	
Hornbach Holding AG & Co KGaA	2	362	211	
Hugo Boss AG	5	347	340	
IDP Education Ltd.	82	1 752	1 733	
IJTT Co., Ltd.	200	1 154	995	
Inchcape PLC	663	7 679	7 224	
InterContinental Hotels Group PLC	754	61 459	51 383	
Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd.	300	2 814	3 133	
Izumi Co., Ltd.	100	3 380	2 901	
JANOME Corp.	200	1 339	1 360	
JB Hi-Fi Ltd.	147	6 146	5 015	
JD.com Inc.	59	2 070	2 452	
JD.com Inc., CAAE	169	14 207	14 000	
Joban Kosan Co., Ltd.	100	1 227	1 206	
Joyful Honda Co., Ltd.	100	1 659	1 504	
JVCKenwood Corp.	400	842	672	
Laox Co., Ltd.	500	810	1 253	
Man Wah Holdings Ltd.	5 597	7 124	7 802	
Mazda Motor Corp.	500	5 193	5 270	
Meituan	100	3 400	3 192	
Melia Hotels International SA	46	377	376	
Mercedes-Benz Group AG	99	8 221	7 372	
Mikuni Corp.	400	1 389	1 432	
MIPS AB	8	787	449	
Moncler SpA	55	3 780	3 036	
New Oriental Education & Technology Group Inc.	40	5 786	1 051	
New Wave Group AB	34	362	583	
Nick Scali Ltd.	7	58	51	
Nikon Corp.	4 000	39 567	59 591	
NIO Inc.	363	9 962	10 170	
Nissan Tokyo Sales Holdings Co., Ltd.	300	1 096	749	
Niu Technologies	758	21 599	8 409	
Oriental Land Co., Ltd.	200	35 182	35 929	
Oriental Watch Holdings	2 000	662	1 512	
Pandora A/S	505	58 418	40 890	
Pinduoduo Inc.	121	13 598	9 646	
Playtech Plc	1 661	17 936	14 090	
Porsche Automobil Holding SE, actions priv.	136	15 377	11 577	
Press Kogyo Co., Ltd.	300	1 531	1 137	
Rakuten Group Inc.	1 500	11 865	8 717	
Royal Caribbean Cruises Ltd.	64	5 728	2 882	
Ryohin Keikaku Co., Ltd.	300	3 914	3 940	
Sabaf SpA	9	355	285	
Salvatore Ferragamo SpA	58	1 536	1 150	
Sankyo Seiko Co., Ltd.	100	624	603	
Sanlorenzo SpA	8	397	346	
Sandic Hotels Group AB	1 555	8 944	7 728	
Sega Sammy Holdings Inc.	500	10 535	10 340	
Sekisui Chemical Co., Ltd.	700	14 530	12 343	
Shop Apotheke Europe NV	17	1 995	1 945	
Signet Jewelers Ltd.	11	801	759	
SISB PCL	1 600	704	671	
SkiStar AB	23	517	401	
Skyworth Group Ltd.	14 000	5 081	8 930	
SMCP SA	290	3 066	1 954	
Sogefi SpA	494	584	550	
Sony Group Corp.	100	12 816	10 535	
Sony Group Corp., CAAE	119	16 225	12 552	
SSP Group Plc	419	2 092	1 529	
Stella International Holdings Ltd.	16 000	34 564	19 727	
Stellantis NV, PAR	2 096	50 262	33 303	
Subaru Corp.	133	3 126	3 045	
Sumitomo Forestry Co., Ltd.	200	3 761	3 652	
Suzuki Motor Corp.	400	21 708	16 195	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
TAL Education Group	117	475	735	
Texwinca Holdings Ltd.	1 994	463	485	
Thule Group AB	76	3 159	2 404	
Toa Corp.	100	880	715	
Topsports International Holdings Ltd.	1 000	1 024	1 172	
Trip.com Group Ltd.	151	5 062	5 347	
Valeo	2 436	86 835	60 529	
Vipshop Holdings Ltd.	126	1 437	1 607	
Volkswagen AG, priv.	15	2 949	2 578	
WATAMI Co., Ltd.	200	1 743	1 741	
Watches of Switzerland Group PLC	647	14 437	7 794	
Webjet Ltd.	2 949	14 953	13 969	
Weiqiao Textile Co.	1 504	369	460	
WH Smith PLC	59	1 449	1 300	
Whitbread PLC	3	157	116	
Xingda International Holdings Ltd.	6 000	1 639	1 450	
XPeng Inc., CAAE	108	3 873	4 422	
XTEP International Holdings Ltd.	500	953	1 167	
Yachiyo Industry Co., Ltd.	100	729	604	
Yamada Holdings Co., Ltd.	200	929	927	
Yamaha Motor Co., Ltd.	500	12 175	11 802	
Zalando SE	151	6 159	5 083	
		1 352 965	1 214 187	6,00
Biens de consommation de base (31 décembre 2021: 2,35 %)				
a2 Milk Co., Ltd.	789	3 211	3 120	
Adecoagro SA	143	2 252	1 561	
Agthia Group PJSC	6 189	12 820	11 498	
Ajinomoto Co Inc.	100	3 020	3 133	
Ambev SA	2 548	8 842	8 250	
Anheuser-Busch InBev SA	741	54 078	51 569	
Artnature Inc.	100	777	684	
Aryzta AG	9 435	14 117	13 488	
Austevoll Seafood ASA	67	1 122	1 009	
Australian Agricultural Co., Ltd.	800	1 317	1 533	
Beiersdorf AG	14	1 799	1 840	
Bell Food Group AG	2	755	680	
BRF SA	202	718	667	
Bunge Ltd.	39	5 823	4 562	
Carlsberg AS	126	19 514	20 656	
Cia Cervecerias Unidas SA	20	357	326	
Coca-Cola Icecek AS	2 216	16 980	22 120	
Costa Group Holdings Ltd.	879	2 388	2 230	
Danone SA	679	47 421	48 769	
Davide Campari-Milano NV	47	670	636	
Emperador Inc.	2 200	594	983	
Fancl Corp.	100	2 083	2 357	
Feed One Co., Ltd.	500	3 205	3 238	
Fevertree Drinks PLC	17	691	325	
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	23	2 061	2 002	
Glanbia PLC, ISE	256	5 026	3 566	
Grieg Seafood ASA	21	392	384	
Henkel AG & Co KGaA, actions priv.	221	17 971	17 519	
Honworld Group Ltd.	1 000	475	252	
Japan Tobacco Inc.	452	10 379	10 069	
Jeronimo Martins SGPS SA	222	6 598	6 209	
Kerry Group PLC	39	5 611	4 804	
Kesko OYJ	48	1 648	1 457	
L'Oréal SA	186	95 168	82 600	
Lucas Bols NV	100	1 395	1 362	
Mandom Corp.	100	1 363	1 513	
Medical System Network Co., Ltd.	100	683	411	
Mitsubishi Shokuhin Co., Ltd.	100	3 113	3 613	
Mowi ASA	228	6 880	6 671	
Naked Wines PLC	618	8 878	1 658	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Nestlé SA	366	57 123	54 957	
Nippon Beet Sugar Manufacturing Co., Ltd.	100	1 594	1 624	
NVC International Holdings Ltd.	4 000	752	84	
Orior AG	6	728	645	
Pigeon Corp.	500	8 756	8 835	
Prima Meat Packers Ltd.	100	2 088	2 162	
Rami Levy Chain Stores Hashikma Marketing 2006 Ltd.	4	399	368	
Rémy Cointreau SA	108	29 645	24 279	
Riken Vitamin Co., Ltd.	400	6 460	6 457	
S&B Foods Inc.	100	3 507	3 475	
San Miguel Food and Beverage Inc.	410	744	433	
Scandinavian Tobacco Group A/S	17	470	428	
Starzen Co., Ltd.	100	1 891	1 890	
Takara Holdings Inc.	300	4 531	2 863	
Torigoe Co., Ltd.	100	619	610	
Tsingtao Brewery Co., Ltd.	2 000	19 935	26 828	
Uni-President China Holdings Ltd.	1 000	1 130	1 106	
Yokorei Co., Ltd.	300	2 446	2 507	
Zhou Hei Ya International Holdings Co., Ltd.	2 500	1 777	2 219	
		516 790	491 094	2,43
Soins de santé (31 décembre 2021: 5,50 %)				
Abcam PLC	383	8 519	7 068	
Affimed NV	913	8 271	3 262	
AGFA-Gevaert NV	75	400	356	
Alkermes PLC	154	5 672	5 918	
Ambu A/S	176	3 018	2 200	
Arjo AB	33	355	269	
Astellas Pharma Inc.	700	13 977	14 057	
AstraZeneca PLC, CAAE	1 195	98 161	101 847	
Austar Lifesciences Ltd.	6	3	2	
Bachem Holding AG	315	35 316	28 161	
Bayer AG	213	18 322	16 293	
BioArctic AB	127	1 275	1 238	
Biotage AB	51	1 189	1 162	
Bumrungrad Hospital PCL	700	4 341	4 572	
Calliditas Therapeutics AB	149	2 198	1 732	
Carl Zeiss Meditec AG	242	41 941	37 172	
Chemometec A/S	55	8 116	7 550	
China Pioneer Pharma Holdings Ltd.	2 000	753	917	
China Shineway Pharmaceutical Group Ltd.	10 000	12 698	11 031	
Chularat Hospital PCL, CRAE	6 900	962	931	
Consun Pharmaceutical Group Ltd.	3 000	1 740	2 061	
CRISPR Therapeutics AG	192	15 422	15 051	
CSL Ltd.	215	51 515	51 313	
CVS Group PLC	70	2 625	1 816	
Daiichi Sankyo Co., Ltd.	500	13 868	16 317	
Daito Pharmaceutical Co., Ltd.	100	3 782	2 643	
Ebos Group Ltd.	547	19 055	17 114	
Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	20	2 095	982	
Eisai Co., Ltd.	700	74 445	38 052	
El.En. SpA	435	7 280	7 245	
Elekta AB	373	3 987	3 318	
EMIS Group PLC	31	762	905	
Euroapi SA	25	426	508	
Evotec SE	373	15 465	11 569	
Fagron	21	446	437	
Galapagos NV	12	896	858	
Genmab A/S	23	9 172	9 581	
Genus PLC	438	31 906	17 209	
Gerresheimer AG	22	1 980	1 839	
Grifols SA	141	2 150	2 161	
H Lundbeck A/S, cat. B	5 110	30 806	31 942	
Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc.	200	8 882	6 637	
Horizon Therapeutics Plc	61	7 474	6 276	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Hoya Corp.	200	40 811	22 000	
Humana AB	65	541	365	
Indivior PLC	3 681	10 055	17 830	
Innovent Biologics Inc.	1 000	4 832	5 737	
Integral Diagnostics Ltd.	511	1 703	1 373	
Jazz Pharmaceuticals PLC	57	9 970	11 471	
Jeol Ltd.	500	42 176	24 830	
Koninklijke Philips NV	468	13 139	12 973	
Koninklijke Philips NV, NYSE	1 089	37 955	30 245	
Lonza Group AG	72	52 101	49 380	
Mediclinic International PLC	74	366	531	
Medicover AB	23	762	386	
Medtronic PLC	376	49 788	43 531	
Merck KGaA	188	51 717	40 819	
Metall Zug AG	2	4 026	5 147	
Mettler-Toledo International Inc.	6	9 791	8 891	
Modern Dental Group Ltd.	4 000	1 008	2 078	
Myovant Sciences Ltd.	298	6 279	4 778	
Novartis AG, CAAE	148	15 922	16 138	
Novo Nordisk A/S	499	62 159	71 234	
Novo Nordisk A/S, CAAE	496	55 820	71 295	
Novocure Ltd.	36	4 368	3 227	
Orexo AB	101	493	241	
Orpea SA	10	612	313	
Pharming Group NV	2 066	2 172	2 095	
Pro Medicus Ltd.	17	730	637	
PW Medtech Group Ltd.	14 000	3 325	1 772	
Ramsay Health Care Ltd.	45	3 020	2 923	
RaySearch Laboratories AB	77	764	527	
Roche Holding AG, EBS	46	25 192	22 834	
Roche Holding AG, ZUR	229	110 600	98 291	
Royalty Pharma PLC	108	5 671	5 857	
Sanofi	403	53 055	52 359	
Sanofi, CAAE	550	36 441	35 495	
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co., Ltd.	500	2 425	2 388	
Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd.	200	3 492	3 756	
Siemens Healthineers AG	885	78 483	57 873	
Solasto Corp.	200	1 234	1 384	
Sonova Holding AG	31	13 075	12 698	
Sosei Group Corp.	200	3 165	2 146	
Spire Healthcare Group PLC	59	230	217	
STERIS PLC	28	8 132	7 446	
Sumitomo Pharma Co., Ltd.	100	1 065	1 036	
Surgical Science Sweden AB	54	1 968	1 039	
Swedish Orphan Biovitrum AB	112	3 077	3 119	
Synairgen PLC	151	475	71	
Tecan Group AG	37	27 491	13 820	
Thonburi Healthcare Group PCL	400	1 053	898	
UCB SA	337	43 781	36 649	
Uniphar PLC	74	345	289	
uniQure NV	47	1 050	1 130	
Valneva SE	942	15 696	13 790	
WIN-Partners Co., Ltd.	100	954	952	
Zai Lab Ltd.	266	45 557	11 900	
		1 541 778	1 331 776	6,58
Services financiers (31 décembre 2021: 4,05 %)				
ABG Sundal Collier Holding ASA	1 421	1 455	1 093	
Admiral Group PLC	9	389	316	
AIB Group PLC	3 988	13 234	11 692	
Alior Bank SA	194	2 889	1 514	
Allianz SE	251	66 289	61 647	
Aon PLC	60	22 254	20 873	
Ashmore Group PLC	128	495	445	
Assicurazioni Generali SpA	2 040	52 230	41 886	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
ASX Ltd.	51	3 795	3 696	
Avanza Bank Holding AB	1 060	30 126	22 904	
AXA SA	2 766	108 032	80 796	
Banca Generali SpA	79	3 558	2 872	
Banca IFIS SpA	177	3 460	3 225	
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, CAAE	10 219	84 444	59 583	
Banco BPM SpA	2 377	8 503	8 706	
Banco Bradesco SA	5 912	31 263	24 861	
Banco de Sabadell SA	276	368	283	
Banco Santander SA, CAAE	4 913	19 771	17 745	
Bank Leumi Le-Israel BM	39	361	446	
Bank Millennium SA	715	1 240	797	
Bank of Georgia Group PLC	30	704	614	
Bank of Ireland Group PLC	2 931	22 099	23 843	
Bank Polska Kasa Opieki SA	504	18 642	11 791	
BAWAG Group AG	69	4 590	3 737	
Beazley PLC	2 069	16 907	16 174	
Berner Kantonalbank AG	1	279	291	
BFF Bank SpA	297	3 249	2 569	
BNP Paribas SA	37	2 567	2 264	
BOC Hong Kong Holdings Ltd.	500	2 495	2 548	
BPER Banca	11 860	34 119	25 071	
Chiba Bank Ltd.	500	3 737	3 518	
Chiba Kogyo Bank Ltd.	200	737	488	
China Merchants Bank Co., Ltd.	2 500	21 206	21 576	
China Merchants Securities Co., Ltd.	400	583	560	
China Pacific Insurance Group Co., Ltd.	2 200	7 071	6 937	
China Taiping Insurance Holdings Co., Ltd.	200	316	318	
Chubb Ltd.	120	22 138	30 430	
CMC Markets PLC	121	555	519	
Coface SA	33	417	443	
Commercial International Bank Egypt SAE	197	808	422	
Commerzbank AG	2 395	27 286	21 595	
CSC Financial Co., Ltd.	1 000	1 213	1 368	
Daiwa Securities Group Inc.	800	4 986	4 603	
DBS Group Holdings Ltd.	700	20 354	19 257	
Deutsche Bank AG	2 134	31 266	23 938	
DNB Bank ASA	1 517	41 787	34 969	
DWS Group GmbH & Co KGaA	783	40 094	26 356	
Erste Group Bank AG	8	357	261	
Everest Re Group Ltd.	11	3 646	3 977	
FIBI Holdings Ltd.	82	4 526	4 422	
FinecoBank Banca Fineco SpA	168	2 857	2 587	
First International Bank Of Israel Ltd.	222	11 271	10 638	
flatexDEGIRO AG	604	19 613	7 396	
Gjensidige Forsikring ASA	11	355	287	
Grupo Aval Acciones y Valores SA	200	1 701	916	
Grupo Financiero Banorte SAB de CV	100	872	717	
Hannover Rueck SE	17	3 430	3 175	
Hargreaves Lansdown PLC	117	2 537	1 444	
Hiscox Ltd.	88	1 345	1 299	
Hong Leong Finance Ltd.	800	1 820	1 794	
HUB24 Ltd.	93	2 412	1 672	
ICICI Bank Ltd.	16	416	366	
Impax Asset Management Group PLC	6	123	57	
ING Groep NV	954	13 044	12 133	
International Personal Finance PLC	745	1 984	893	
Intesa Sanpaolo SpA	18 509	48 386	44 430	
Invesco Ltd.	97	2 406	2 018	
Investec PLC	3 220	21 126	22 438	
ISX Financial EU Ltd.	185	-	-	
Itau Unibanco Holding SA	1 169	7 141	6 454	
J Trust Co., Ltd.	100	343	419	
KB Financial Group Inc., CAAE	258	13 073	12 380	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
KBC Ancora	10	668	472	
KBC Group NV	132	10 517	9 531	
Krung Thai Bank PCL	1 600	898	905	
Lancashire Holdings Ltd.	242	1 910	1 529	
Liontrust Asset Management PLC	41	1 491	586	
Lloyds Banking Group PLC	30 017	27 037	19 896	
London Stock Exchange Group PLC	300	39 367	35 869	
Macquarie Group Ltd.	48	7 923	7 004	
mBank SA	37	4 851	2 384	
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	277	3 260	3 085	
Mitsubishi HC Capital Inc.	100	683	594	
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	2	609	605	
New China Life Insurance Co., Ltd.	200	696	725	
Ninety One PLC	442	1 629	1 369	
Nordea Bank Abp	109	1 474	1 235	
Olav Thon Eiendomsselskap ASA	13	355	283	
OSB Group PLC	40	379	301	
OTP Bank Nyrt	456	26 779	13 053	
Phoenix Holdings Ltd.	167	2 638	2 120	
Ping An Insurance Group Co of China Ltd.	3 000	26 254	26 311	
Pinnacle Investment Management Group Ltd.	153	1 462	954	
Polar Capital Holdings PLC	23	352	184	
Provident Financial PLC	142	855	444	
Raiffeisen Bank International AG	719	13 294	10 026	
Resona Holdings Inc.	1 400	7 137	6 754	
Santander Bank Polska SA	155	15 438	10 362	
Schroders PLC	26	1 327	1 088	
SCOR SE	392	15 874	10 837	
Seven Bank Ltd.	1 500	3 657	3 689	
Shizuoka Bank Ltd.	700	6 377	5 417	
Societe Generale SA	17	510	479	
Standard Chartered PLC	30	250	291	
Steadfast Group Ltd.	216	931	962	
Suruga Bank Ltd.	700	3 457	2 439	
Swiss Life Holding AG	98	71 593	61 402	
Swissquote Group Holding SA	76	16 683	9 918	
Sydbank AS	8	386	315	
T&D Holdings Inc.	1 200	20 548	18 504	
Tamburi Investment Partners SpA	294	3 665	2 906	
TBC Bank Group PLC	324	9 231	6 416	
Tisco Financial Group PCL	100	342	323	
Tryg A/S	210	6 372	6 068	
Turkiye Garanti Bankasi AS	723	937	776	
UBS Group AG	463	10 532	9 601	
Unicaja Banco SA	890	1 211	1 120	
UniCredit SpA	6 042	84 199	73 863	
Willis Towers Watson PLC	33	9 947	8 403	
Yiren Digital Ltd.	154	369	358	
ZhongAn Online P&C Insurance Co., Ltd.	700	3 064	2 940	
Zurich Insurance Group AG	42	24 984	23 497	
		1 443 547	1 201 945	5,94
Technologies de l'information (31 décembre 2021: 9,09 %)				
A&D HOLON Holdings Co., Ltd.	300	3 668	2 569	
Accenture PLC	178	56 124	63 752	
Adesso SE	2	591	395	
Adyen NV	40	107 409	74 873	
Allgeier SE	4	345	182	
Alps Alpine Co., Ltd.	100	1 240	1 307	
Anritsu Corp.	400	7 636	5 576	
ASE Technology Holding Co., Ltd.	2 611	18 583	17 413	
ASML Holding NV	95	77 848	58 401	
ASML Holding NV, NASD	4	3 148	2 455	
Asseco Poland SA	25	650	542	
AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	417	11 046	28 680	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Barco NV	92	2 761	2 501	
BASE Inc.	100	492	308	
Brother Industries Ltd.	100	2 336	2 265	
BYD Electronic International Co., Ltd.	500	1 488	2 034	
Capgemini SE	146	38 569	32 182	
Capita PLC	1 740	1 434	696	
Cheetah Mobile Inc.	1 225	3 662	1 091	
Chinasoft International Ltd.	4 000	4 381	5 280	
Citizen Watch Co., Ltd.	1 100	5 871	5 765	
Cliq Digital AG	33	1 254	1 206	
Comet Holding AG	2	926	405	
Computershare Ltd.	904	19 488	19 758	
Crayon Group Holding ASA	21	435	343	
CyberArk Software Ltd.	278	54 448	45 887	
Disco Corp.	200	81 357	61 148	
DiscoverIE Group PLC	17	351	165	
Econocom Group SA	98	350	441	
Elmos Semiconductor SE	4	343	196	
Esker SA	35	12 860	6 009	
Forth Smart Service PCL	4	1	3	
Future Corp.	200	4 101	2 643	
GFT Technologies SE	14	800	715	
GL Sciences Inc.	100	1 898	2 284	
Halma PLC	211	8 371	6 641	
Hexagon AB	1 331	20 943	17 802	
Hi Sun Technology China Ltd.	6 000	1 374	967	
Hochiki Corp.	100	1 579	1 223	
Inari Amertron Bhd	1	1	1	
Infineon Technologies AG	15	501	467	
Infomedia Ltd.	325	584	481	
Infosys Ltd., CAAE	108	2 614	2 579	
Iress Ltd.	102	979	1 041	
Itfor Inc.	300	2 175	2 168	
JBCC Holdings Inc.	100	2 036	1 502	
JinkoSolar Holding Co., Ltd.	320	18 740	28 557	
Kaga Electronics Co., Ltd.	100	3 495	2 877	
Kainos Group PLC	179	4 544	3 110	
Keywords Studios PLC	39	1 971	1 340	
Kingboard Holdings Ltd.	2 500	9 760	12 206	
Kitron ASA	159	372	364	
Kudelski SA	100	668	340	
Kyoden Co., Ltd.	700	2 895	3 695	
Kyowa Electronic Instruments Co., Ltd.	400	1 896	1 185	
Lagercrantz Group AB	560	5 160	5 840	
Landis+Gyr Group AG	99	6 850	6 676	
Lasertec Corp.	100	14 399	15 335	
Lem Holding SA	4	9 859	9 831	
Marubun Corp.	300	2 286	2 065	
Megaport Ltd.	167	822	807	
Mensch und Maschine Software SE	5	387	321	
Micro Focus International PLC	339	2 537	1 486	
MIMAKI Engineering Co., Ltd.	200	1 995	995	
NCC Group PLC	98	493	287	
Nemetschek SE	231	27 548	17 994	
Nihon Denkei Co., Ltd.	100	1 363	1 334	
Nokia OYJ	1 605	10 338	9 609	
Nordic Semiconductor ASA	218	5 133	4 349	
Nova Ltd.	177	11 868	19 793	
Novonix Ltd.	30	140	61	
NXP Semiconductors NV	73	16 535	13 940	
Ordina NV	87	456	558	
Oxford Instruments PLC	20	599	619	
PAX Global Technology Ltd.	4 000	2 226	4 018	
QT Group Oyj	22	3 648	2 089	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Radware Ltd.	326	13 982	9 113	
Renesas Electronics Corp.	600	8 250	7 024	
Renishaw PLC	113	8 644	6 316	
Reply SpA	65	14 388	10 142	
Samsung Electronics Co., Ltd., CIAE	11	22 955	15 481	
Sanken Electric Co., Ltd.	400	13 258	17 889	
SAP SE	51	6 421	5 968	
Seagate Technology Holdings PLC	60	5 205	5 529	
Seiko Epson Corp.	100	2 050	1 823	
Sensirion Holding AG	111	11 311	14 478	
Sesa SpA	39	3 097	6 385	
SMA Solar Technology AG	380	24 255	19 853	
Software AG	7	376	298	
Southern Cross Payments Ltd.	1 850	1 362	1 756	
Sumco Corp.	2 300	57 247	38 414	
Suzuki Co., Ltd.	100	855	743	
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	2 029	262 108	213 966	
TDK Corp.	300	13 155	11 935	
TE Connectivity Ltd.	93	16 967	13 574	
TeamViewer AG	48	679	615	
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	40	426	384	
Tobii AB	1 295	6 846	2 879	
Tokyo Electron Ltd.	100	70 996	42 063	
TomTom NV	374	4 136	3 561	
Tongda Group Holdings Ltd.	50 000	4 257	1 241	
Truly International Holdings Ltd.	10 000	1 671	3 945	
u-blox Holding AG	54	4 827	7 036	
Unisem M Bhd	2	2	1	
Vitec Software Group AB	95	5 457	5 303	
Wasion Holdings Ltd.	12 000	6 005	5 070	
Weimob Inc.	5 000	4 232	4 406	
WiiT SpA	27	1 216	634	
Wix.com Ltd.	260	31 114	21 985	
X-Fab Silicon Foundries SE	160	1 616	1 341	
Yokogawa Electric Corp.	600	14 566	12 767	
ZTE Corp.	1 199	3 266	3 603	
		1 385 232	1 173 544	5,80
Services de communication (31 décembre 2021: 3,33 %)				
Airtel Africa PLC	2 609	6 622	5 526	
Alma Media OYJ	100	926	1 328	
America Movil SAB de CV	433	11 222	11 411	
Asahi Net Inc.	300	1 830	1 652	
Ascom Holding AG	23	363	208	
Auto Trader Group PLC	1 710	20 409	14 868	
Autohome Inc.	21	873	1 065	
Baidu Inc.	80	14 166	15 348	
Bilibili Inc.	53	1 871	1 750	
Bolloré SE	248	1 726	1 478	
Bushiroad Inc.	300	4 244	4 256	
Cairo Communication SpA	2 024	4 384	4 706	
Chunghwa Telecom Co., Ltd.	1 404	71 713	74 708	
Cineworld Group PLC	8 399	12 849	2 763	
CTS Eventim AG & Co KGaA	74	6 036	4 990	
Cyfrowy Polsat SA	37	360	225	
Deutsche Telekom AG	1 963	48 706	50 155	
Digital Bros SpA	10	609	341	
Euromoney Institutional Investor Plc	45	717	947	
Freenet AG	13	356	415	
G5 Entertainment AB	11	315	264	
IMAGICA Group Inc.	100	614	711	
Informa PLC	2 029	19 911	16 808	
IPSOS	10	495	611	
iQIYI Inc.	96	504	520	
Kin & Carta PLC	372	1 646	1 022	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kinepolis Group NV	10	752	618	
Konami Group Corp.	100	7 187	7 131	
Liberty Global PLC, série A	141	4 065	3 829	
Millicom International Cellular SA	20	401	368	
NetEase Inc.	100	2 301	2 369	
NetEase Inc., CAAE	94	11 342	11 320	
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	1 800	64 940	66 587	
Otello Corp. ASA	224	1 081	747	
Partner Communications Co., Ltd., TLV	73	831	667	
PLDT Inc.	57	2 774	2 237	
Proximus SADP	20	500	379	
Reach PLC	106	717	167	
Rightmove PLC	93	1 057	828	
Rovio Entertainment Oyj	34	370	302	
Sanoma OYJ	123	2 535	2 206	
Schibsted ASA	224	6 695	5 145	
Schibsted ASA, cat. B	98	2 071	2 054	
SK Telecom Co., Ltd., CAAE	1 376	58 480	39 618	
Sky Network Television Ltd.	651	1 352	1 232	
Sohu.com Ltd.	314	6 128	6 712	
Technicolor SA	105	486	400	
Telecom Italia SpA	36 527	15 924	12 300	
Telecom Plus PLC	14	346	429	
Telefonica Brasil SA	2 812	37 138	32 864	
Telefonica Deutschland Holding AG	296	1 042	1 094	
Telefonica SA	67	372	443	
Telkom Indonesia Persero Tbk PT, CAAE	1 873	68 840	65 331	
Tencent Music Entertainment Group	109	672	706	
TIM SA	355	6 277	5 564	
Tobii Dynavox AB	125	611	378	
TX Group AG	11	2 108	1 704	
Ubisoft Entertainment SA	531	32 903	30 004	
Viaplay Group AB	48	2 300	1 268	
		578 065	525 077	2,60
Services publics (31 décembre 2021: 2,30 %)				
ACEA SpA	14	374	266	
Amaysim Australia Ltd.	742	297	138	
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC	468	21 220	19 475	
Beijing Enterprises Holdings Ltd.	500	2 423	2 293	
Centrica PLC	349	437	437	
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	54	664	557	
Cia Energetica de Minas Gerais, CAAE	1 067	2 313	2 780	
Cia Paranaense de Energia, CAAE	540	4 525	4 430	
CLP Holdings Ltd.	1 000	10 850	10 702	
Contact Energy Ltd.	657	4 379	3 836	
ContourGlobal PLC	114	369	449	
Drax Group PLC	2 094	23 337	21 093	
EDP - Energias de Portugal SA	3 936	23 380	23 631	
EDP Renovaveis SA	924	30 282	28 062	
Electric Power Development Co., Ltd.	1 000	17 828	21 307	
Elia Group SA	10	2 025	1 823	
Encavis AG	409	10 016	9 639	
Enea SA	232	432	649	
ENN Energy Holdings Ltd.	500	9 734	10 595	
EVN AG	29	952	790	
Hiroshima Gas Co., Ltd.	500	2 167	1 543	
Infratil Ltd.	5 836	39 888	35 947	
Kenon Holdings Ltd.	735	25 749	37 874	
Kunlun Energy Co., Ltd.	32 000	31 472	33 825	
National Grid PLC	1 224	24 426	20 172	
National Grid PLC, CAAE	159	15 258	13 268	
OPC Energy Ltd.	132	1 982	1 665	
Origin Energy Ltd.	6 395	39 218	32 504	
Osaka Gas Co., Ltd.	100	2 163	2 465	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Pampa Energia SA	12	374	317	
PGE Polska Grupa Energetyczna SA	2 847	8 653	8 704	
Rubis SCA	1 066	47 642	32 029	
Snam SpA	166	1 236	1 119	
Tauron Polska Energia SA	2 487	1 999	2 457	
Toell Co., Ltd.	100	897	875	
Tohoku Electric Power Co Inc.	700	5 214	4 832	
Veolia Environnement SA	482	21 522	15 139	
		435 697	407 687	2,02
Immobilier (31 décembre 2021: 1,80 %)				
Agile Group Holdings Ltd.	8 000	13 647	4 129	
Airport City Ltd.	503	14 523	11 038	
Azrieli Group Ltd.	123	11 433	11 073	
China Overseas Land & Investment Ltd.	2 500	9 566	10 192	
China Resources Land Ltd.	4 000	22 521	24 067	
China Vanke Co., Ltd.	1 900	5 434	6 159	
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	4 160	2 861	2 694	
Civitas Social Housing PLC	537	991	661	
Country Garden Holdings Co., Ltd.	10 996	8 935	8 785	
Country Garden Services Holdings Co., Ltd.	1 000	5 570	5 745	
Derwent London PLC	700	41 217	28 644	
Fibra Uno Administracion SA de CV	700	1 010	896	
G City Ltd.	267	3 394	1 955	
Goodman Property Trust	169	362	271	
Greentown China Holdings Ltd.	500	1 085	1 336	
Growthpoint Properties Australia Ltd.	100	390	302	
Hammerson PLC	11 222	7 171	3 335	
HKR International Ltd.	4 000	2 261	1 907	
Investis Holding SA	76	7 010	10 496	
KE Holdings Inc.	88	1 356	2 038	
Lar Espana Real Estate Socimi SA	175	2 098	1 119	
Lendlease Corp. Ltd.	1 630	16 533	13 172	
Lifestyle Communities Ltd.	136	2 167	1 637	
Logan Group Co., Ltd.	3 000	1 174	1 075	
Mivne Real Estate KD Ltd.	-	-	-	
Montea NV	36	3 588	4 433	
Nexity SA	13	723	447	
Nisshin Group Holdings Co., Ltd.	200	1 125	836	
NP3 Fastigheter AB	16	260	407	
NSI NV	61	3 170	2 702	
Orix JREIT Inc.	2	3 674	3 498	
Peach Property Group AG	54	4 247	2 572	
Poly Property Services Co., Ltd.	200	1 828	1 644	
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	34 996	30 150	7 536	
Safestore Holdings PLC	700	14 956	11 635	
Sagax AB, cat. B	961	35 171	22 827	
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, cat. B	567	1 824	1 216	
Sankyo Frontier Co., Ltd.	100	4 081	3 808	
Savills PLC	34	803	539	
Selvaag Bolig ASA	235	1 781	1 091	
Shimao Group Holdings Ltd.	2 003	2 309	1 455	
Shurgard Self Storage SA	56	3 308	3 357	
Sirius Real Estate Ltd.	180	368	252	
Sunac China Holdings Ltd.	1 000	882	753	
Supermarket Income Reit PLC	421	870	788	
Swire Pacific Ltd.	3 500	25 051	26 898	
Target Healthcare REIT PLC	1 075	2 250	1 826	
Unibail-Rodamco-Westfield	42	3 718	2 756	
VGP NV	48	9 151	9 839	
Warehouse Reit PLC	1 485	4 277	3 429	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Wihlborgs Fastigheter AB	46	668	414	
YH Dimri Construction & Development Ltd.	3	367	294	
		343 309	269 978	1,33
Total des actions étrangères – position acheteur		10 961 289	9 510 215	47,02
Actions étrangères – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2021 : -0,86 %)				
Akastor ASA	(225)	(360)	(245)	
Beach Energy Ltd.	(470)	(516)	(719)	
CropEnergies AG	(1 459)	(26 102)	(24 988)	
Ecopetrol SA	(43)	(615)	(602)	
Equital Ltd.	(747)	(26 118)	(30 293)	
ERG SpA	(123)	(4 872)	(4 917)	
Euronav NV	(9)	(124)	(139)	
Galp Energia SGPS SA	(177)	(2 883)	(2 670)	
Odfjell Drilling Ltd.	(251)	(751)	(760)	
Pharos Energy PLC	(3 419)	(3 742)	(1 173)	
Sala Corp.	(100)	(639)	(669)	
SBM Offshore NV	(253)	(4 969)	(4 413)	
Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	(74)	(4 368)	(5 359)	
Subsea 7 SA	(575)	(6 282)	(5 911)	
Tenaris SA	(1 914)	(73 754)	(63 428)	
TGS ASA	(712)	(13 747)	(12 857)	
Ultrapar Participacoes SA	(93)	(359)	(282)	
Woodside Energy Group Ltd., CAAE	(28)	(812)	(779)	
Worley Ltd.	(1 533)	(16 024)	(19 364)	
		(187 037)	(179 568)	(0,89)
Matières premières (31 décembre 2021 : -2,12 %)				
Akzo Nobel NV	(99)	(10 865)	(8 360)	
Allkem Ltd.	(5)	(50)	(46)	
Aluflexpack AG	(89)	(2 943)	(1 919)	
AMG Advanced Metallurgical Group NV	(33)	(1 450)	(1 095)	
AngloGold Ashanti Ltd.	(1 495)	(37 149)	(28 522)	
ArcelorMittal SA, NYSE	(120)	(4 088)	(3 498)	
Aurubis AG	(4)	(603)	(349)	
BASF SE	(104)	(6 973)	(5 824)	
Bellevue Gold Ltd.	(1 048)	(734)	(595)	
BHP Group Ltd.	(101)	(7 258)	(7 319)	
BRAIN Biotech AG	(29)	(363)	(313)	
Buzzi Unicem SpA	(95)	(2 298)	(2 000)	
Cemex SAB de CV	(9 643)	(64 261)	(48 761)	
Chr Hansen Holding A/S	(30)	(2 772)	(2 810)	
Cia de Minas Buenaventura SAA	(3 006)	(32 898)	(25 592)	
Cia Siderurgica Nacional SA	(4 764)	(25 946)	(18 006)	
Clariant AG	(63)	(1 712)	(1 543)	
Corbion NV	(15)	(756)	(584)	
Covestro AG	(371)	(24 180)	(16 501)	
CRH PLC	(12)	(625)	(539)	
Daiichi Kigenso Kagaku-Kogyo Co., Ltd.	(100)	(1 051)	(1 121)	
Evonik Industries AG	(86)	(3 077)	(2 361)	
Fortescue Metals Group Ltd.	(53)	(941)	(824)	
Fuchs Petrolub SE, priv.	(6)	(387)	(356)	
GCC SAB de CV	(20)	(146)	(161)	
Gold Fields Ltd.	(4 939)	(66 393)	(58 104)	
Gold Road Resources Ltd.	(103)	(133)	(103)	
Harmony Gold Mining Co., Ltd.	(1 288)	(7 017)	(5 200)	
Humble Group AB	(188)	(472)	(343)	
Imdex Ltd.	(540)	(1 184)	(884)	
James Hardie Industries Plc	(13)	(503)	(366)	
K+S AG	(78)	(2 963)	(2 439)	
Kemira OYJ	(144)	(2 345)	(2 264)	
Kobe Steel Ltd.	(500)	(3 191)	(2 929)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Lenzing AG	(2)	(340)	(208)	
Loma Negra Cia Industrial Argentina SA	(131)	(1 029)	(858)	
MACA Ltd.	(2 256)	(1 441)	(1 321)	
Mineral Resources Ltd.	(615)	(28 557)	(26 333)	
Mitsubishi Chemical Group Corp.	(400)	(3 053)	(2 799)	
Mitsui Mining & Smelting Co., Ltd.	(100)	(3 556)	(3 010)	
Nihon Nohyaku Co., Ltd.	(200)	(1 162)	(1 318)	
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	(4 800)	(71 447)	(46 078)	
Novozymes A/S	(5)	(409)	(386)	
OCI NV	(69)	(3 171)	(2 929)	
Oji Holdings Corp.	(300)	(1 859)	(1 675)	
Perenti Global Ltd.	(3 224)	(2 020)	(1 873)	
Ramelius Resources Ltd.	(302)	(422)	(233)	
Showa Denko KK	(400)	(11 020)	(8 758)	
Sibanye Stillwater Ltd.	(157)	(2 166)	(2 019)	
SIG Group AG	(11)	(352)	(312)	
Sinopec Shanghai Petrochemical Co., Ltd., CAAE	(75)	(2 206)	(1 637)	
Solvay SA	(31)	(3 922)	(3 232)	
SSAB AB, série B	(1 864)	(14 366)	(9 930)	
Swiss Steel Holding AG	(865)	(352)	(277)	
Symrise AG	(14)	(1 937)	(1 961)	
Syrah Resources Ltd.	(5 693)	(6 873)	(6 237)	
Takemoto Yohki Co., Ltd.	(200)	(1 873)	(1 496)	
ThyssenKrupp AG	(1 817)	(22 257)	(13 257)	
UBE Corp.	(100)	(2 366)	(1 915)	
Wacker Chemie AG	(9)	(1 860)	(1 670)	
		(507 743)	(393 353)	(1,94)
Industries (31 décembre 2021 : -2,61 %)				
Ackermans & van Haaren NV	(16)	(3 591)	(3 075)	
ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	(9)	(362)	(281)	
Adecco Group AG	(1 024)	(66 084)	(44 759)	
Advan Group Co., Ltd.	(100)	(1 011)	(750)	
AerCap Holdings NV	(1 335)	(90 141)	(70 502)	
Aeroporto Guglielmo Marconi Di Bologna SpA	(87)	(1 244)	(986)	
AFRY AB	(17)	(448)	(300)	
Air New Zealand Ltd.	(1 093)	(789)	(500)	
Aker Carbon Capture ASA	(88)	(56)	(191)	
Alliance Aviation Services Ltd.	(762)	(2 635)	(2 413)	
ALS Ltd.	(49)	(571)	(464)	
Amada Co., Ltd.	(400)	(4 420)	(3 787)	
Atlantia SpA	(2 194)	(52 958)	(66 218)	
Atlas Corp.	(66)	(999)	(912)	
Auckland International Airport Ltd.	(52)	(343)	(299)	
Azelio AB	(274)	(366)	(195)	
Balco Group AB	(100)	(1 134)	(890)	
Belimo Holding AG	(1)	(667)	(453)	
Benefit One Inc.	(200)	(7 687)	(3 464)	
BeNext-Yumeshin Group Co.	(100)	(1 961)	(1 423)	
Besterra Co., Ltd.	(200)	(3 756)	(2 199)	
Bilfinger SE	(64)	(2 786)	(2 406)	
bpost SA	(327)	(3 061)	(2 485)	
Br Holdings Corp.	(400)	(1 557)	(1 215)	
Bufab Ab	(227)	(9 709)	(7 572)	
Burckhardt Compression Holding AG	(4)	(2 495)	(2 159)	
Caverion OYJ	(910)	(7 468)	(5 418)	
Cleanaway Waste Management Ltd.	(128)	(361)	(286)	
Climeon AB	(51)	(29)	(28)	
Controladora Vuela Cia de Aviacion SAB de CV, NYSE	(767)	(14 813)	(10 161)	
Copa Holdings SA	(4)	(323)	(327)	
CTT Systems AB	(50)	(1 096)	(1 246)	
Dfds A/S	(263)	(16 826)	(10 235)	
DMG Mori Co., Ltd.	(300)	(5 018)	(4 786)	
DO & CO AG	(76)	(9 106)	(8 148)	
dormakaba Holding AG	(15)	(10 319)	(8 418)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
DSV A/S	(54)	(9 848)	(9 706)	
Electro Optic Systems Holdings Ltd.	(876)	(4 491)	(808)	
Enav SpA	(302)	(1 685)	(1 623)	
Enento Group Oyj	(92)	(4 307)	(2 574)	
Energiekontor AG	(3)	(344)	(312)	
Eolus Vind AB	(20)	(491)	(195)	
Ferrovial SA	(1)	(35)	(33)	
Fila SpA	(271)	(3 641)	(3 037)	
Fletcher Building Ltd.	(135)	(886)	(546)	
Freightways Ltd.	(252)	(2 681)	(1 849)	
Furukawa Electric Co., Ltd.	(200)	(5 011)	(4 231)	
Grafton Group PLC	(22)	(444)	(268)	
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV, CAAE	(2)	(560)	(507)	
GWA Group Ltd.	(418)	(944)	(729)	
HeidelbergCement AG	(4)	(375)	(247)	
Hexagon Composites ASA	(100)	(371)	(352)	
Hitachi Construction Machinery Co., Ltd.	(200)	(6 928)	(5 707)	
Hitachi Zosen Corp.	(400)	(3 660)	(3 244)	
Huber + Suhner AG	(5)	(609)	(513)	
Huhtamaki OYJ	(141)	(6 805)	(7 188)	
Indus Holding AG	(100)	(3 797)	(2 994)	
Instalco AB	(80)	(977)	(426)	
Intertrust NV	(261)	(7 046)	(6 737)	
IPH Ltd.	(118)	(867)	(854)	
JDC Corp.	(300)	(1 729)	(1 487)	
JET2 PLC	(153)	(3 124)	(2 171)	
JOST Werke AG	(45)	(3 021)	(2 160)	
Kanagawa Chuo Kotsu Co., Ltd.	(100)	(4 728)	(3 300)	
Keikyu Corp.	(100)	(1 313)	(1 412)	
Kelsian Group Ltd.	(56)	(351)	(283)	
King Jim Co., Ltd.	(300)	(2 960)	(2 495)	
Kloeckner & Co SE	(68)	(1 026)	(667)	
Kobe Electric Railway Co., Ltd.	(100)	(3 698)	(3 086)	
Komatsu Wall Industry Co., Ltd.	(100)	(1 849)	(1 821)	
Komax Holding AG	(54)	(18 884)	(17 026)	
Kone OYJ	(4)	(357)	(245)	
Kornit Digital Ltd.	(81)	(4 370)	(3 312)	
Kosaido Holdings Co., Ltd.	(200)	(1 814)	(2 093)	
Kubota Corp.	(200)	(4 325)	(3 849)	
Kuehne + Nagel International AG	(173)	(66 165)	(52 681)	
Link And Motivation Inc.	(200)	(1 107)	(906)	
Loomis AB	(211)	(7 410)	(6 608)	
Mabuchi Motor Co., Ltd.	(100)	(4 419)	(3 319)	
Maire Tecnimont SpA	(387)	(1 569)	(1 430)	
Makita Corp.	(200)	(9 761)	(6 422)	
Maruwa Unyu Kikan Co., Ltd.	(200)	(5 663)	(2 543)	
MBB SE	(2)	(351)	(275)	
Midac Holdings Co., Ltd.	(100)	(4 767)	(2 652)	
Mitsubishi Electric Corp.	(600)	(8 567)	(8 266)	
Mitsui Matsushima Holdings Co., Ltd.	(100)	(2 943)	(2 814)	
Mpac Group PLC	(72)	(675)	(398)	
NCC AB	(361)	(7 858)	(4 676)	
NEL ASA	(8 544)	(18 117)	(13 348)	
NHOA	(42)	(871)	(555)	
Nippon Aqua Co., Ltd.	(100)	(698)	(556)	
Nippon Yusen KK	(500)	(56 332)	(44 010)	
Nisshinbo Holdings Inc.	(100)	(1 127)	(969)	
Nolato AB	(30)	(383)	(208)	
NSK Ltd.	(500)	(4 394)	(3 466)	
NTN Corp.	(500)	(1 308)	(1 230)	
OC Oerlikon Corp. AG	(50)	(619)	(448)	
Oesterreichische Post AG	(36)	(1 696)	(1 321)	
OHB SE	(418)	(20 968)	(19 561)	
Okada Aiyon Corp.	(100)	(1 464)	(1 394)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Outsourcing Inc.	(500)	(10 324)	(4 914)	
Park24 Co., Ltd.	(200)	(4 095)	(3 564)	
Peab AB	(24)	(357)	(181)	
Penta-Ocean Construction Co., Ltd.	(100)	(851)	(695)	
PNE AG	(1 012)	(11 738)	(18 124)	
Porr Ag	(21)	(356)	(347)	
Port of Tauranga Ltd.	(68)	(369)	(339)	
Powerhouse Energy Group PLC	(5 373)	(366)	(137)	
Raiznext Corp.	(100)	(1 254)	(1 086)	
Randstad NV	(268)	(21 853)	(16 698)	
Reece Ltd.	(832)	(12 723)	(10 170)	
Reliance Worldwide Corp. Ltd.	(6 247)	(25 238)	(22 387)	
Rheon Automatic Machinery Co., Ltd.	(100)	(1 422)	(1 198)	
SAS AB	(27 062)	(6 918)	(2 205)	
SATS Ltd.	(140)	(518)	(506)	
Schindler Holding AG	(2)	(683)	(469)	
Secom Co., Ltd.	(100)	(8 940)	(7 960)	
Seikitokyu Kogyo Co., Ltd.	(100)	(968)	(772)	
Senko Group Holdings Co., Ltd.	(600)	(6 102)	(5 002)	
Service Stream Ltd.	(580)	(494)	(450)	
Shikun & Binui Ltd.	(217)	(1 595)	(1 137)	
Shikun & Binui Ltd., droits, éch. le 5 juill. 2022	(1)	-	(8)	
Shinmaywa Industries Ltd.	(100)	(1 073)	(1 025)	
SHO-BOND Holdings Co., Ltd.	(100)	(5 239)	(5 669)	
Singapore Airlines Ltd.	(700)	(3 210)	(3 309)	
SMS Co., Ltd.	(300)	(13 679)	(7 617)	
Stabilus SE	(22)	(2 066)	(1 384)	
Tadano Ltd.	(100)	(1 074)	(848)	
Takamiya Co., Ltd.	(200)	(975)	(746)	
Talenom Oyj	(76)	(1 161)	(994)	
TClarke PLC	(303)	(734)	(726)	
Textainer Group Holdings Ltd.	(35)	(1 274)	(1 238)	
THK Co., Ltd.	(400)	(12 674)	(9 674)	
TKH Group NV	(28)	(1 950)	(1 362)	
Tomoe Corp.	(100)	(459)	(427)	
Traton SE	(51)	(1 315)	(960)	
UT Group Co., Ltd.	(300)	(12 817)	(6 366)	
Vestas Wind Systems A/S	(41)	(1 309)	(1 115)	
Vossloh AG	(89)	(5 627)	(3 643)	
Vow ASA	(169)	(988)	(503)	
Yahagi Construction Co., Ltd.	(100)	(833)	(718)	
Yamashina Corp.	(400)	(331)	(262)	
		(861 726)	(696 029)	(3,44)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021: -3,36 %)				
AB Dynamics PLC	(11)	(347)	(200)	
AcadeMedia AB	(504)	(3 675)	(2 892)	
Adairs Ltd.	(1 344)	(2 759)	(2 277)	
Aisin Corp.	(200)	(9 292)	(7 976)	
ARB Corp. Ltd.	(333)	(13 083)	(8 342)	
ASKUL Corp.	(200)	(3 699)	(3 073)	
Aston Martin Lagonda Global Holdings PLC	(233)	(6 329)	(1 613)	
Autoneum Holding AG	(2)	(454)	(244)	
Avantia Co., Ltd.	(400)	(3 743)	(3 164)	
Azorim-Investment Development & Construction Co., Ltd.	(186)	(881)	(898)	
B&S Group Sarl	(200)	(1 767)	(1 349)	
Bapcor Ltd.	(1 679)	(10 588)	(9 055)	
Bayerische Motoren Werke AG	(30)	(3 241)	(2 972)	
Benesse Holdings Inc.	(200)	(5 500)	(4 172)	
Betsson AB	(25)	(167)	(195)	
BHG Group AB	(382)	(5 672)	(1 559)	
Bic Camera Inc.	(300)	(3 381)	(3 338)	
BIT Mining Ltd.	(370)	(591)	(296)	
Boozt AB	(15)	(353)	(127)	
Brembo SpA	(149)	(2 011)	(1 863)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Broccoli Co., Ltd.	(100)	(1 224)	(1 095)	
Brunello Cucinelli SpA	(6)	(362)	(348)	
Bulten AB	(100)	(823)	(806)	
Carnival Corp.	(392)	(4 718)	(4 374)	
CHIMNEY Co., Ltd.	(100)	(1 476)	(1 189)	
Cie Automotive SA	(10)	(347)	(319)	
Cie Financière Richemont SA	(47)	(7 429)	(6 437)	
Collins Foods Ltd.	(289)	(3 481)	(2 540)	
Colowide Co., Ltd.	(300)	(5 513)	(5 230)	
Corporate Travel Management Ltd.	(18)	(349)	(296)	
Daimler Truck Holding AG	(21)	(845)	(705)	
DD Holdings Co., Ltd.	(400)	(2 451)	(2 294)	
De' Longhi SpA	(8)	(352)	(191)	
Delivery Hero SE	(22)	(1 117)	(1 061)	
Demae-Can Co., Ltd.	(200)	(3 472)	(817)	
Despegar.com Corp.	(841)	(12 643)	(8 787)	
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	(118)	(9 039)	(7 118)	
Dufry AG	(220)	(14 018)	(9 148)	
Eagers Automotive Ltd.	(518)	(6 313)	(4 466)	
EDION Corp.	(500)	(6 306)	(6 044)	
ES-Con Japan Ltd.	(800)	(6 768)	(5 811)	
Eslead Corp.	(200)	(3 729)	(3 162)	
Ferrari NV	(1)	(337)	(236)	
Fielmann AG	(21)	(1 445)	(1 345)	
Finnair OYJ	(1 238)	(1 104)	(683)	
Food & Life Cos Ltd.	(200)	(10 849)	(5 500)	
Fuji Corp. Ltd.	(400)	(3 044)	(2 488)	
Fujio Food Group Inc.	(200)	(3 085)	(2 493)	
Furukawa Battery Co., Ltd.	(100)	(1 782)	(1 156)	
Gakkyusha Co., Ltd.	(100)	(1 610)	(1 506)	
Gfoot Co., Ltd.	(300)	(1 368)	(974)	
Golf Digest Online Inc.	(400)	(4 109)	(5 219)	
GUD Holdings Ltd.	(461)	(5 022)	(3 267)	
Harvey Norman Holdings Ltd.	(119)	(644)	(392)	
Hella GmbH & Co KGaA	(224)	(18 020)	(19 439)	
Home24 SE	(100)	(684)	(484)	
Hoteles City Express SAB de CV	(2 390)	(670)	(617)	
IBJ Inc.	(400)	(4 612)	(2 871)	
Iida Group Holdings Co., Ltd.	(200)	(6 104)	(3 967)	
International Game Technology PLC	(13)	(371)	(311)	
Isuzu Motors Ltd.	(400)	(6 883)	(5 701)	
Iveco Group NV	(112)	(1 808)	(762)	
JTEKT Corp.	(500)	(5 758)	(4 843)	
Just Eat Takeaway.com NV	(264)	(13 653)	(5 364)	
Kambi Group PLC	(232)	(8 970)	(4 889)	
Kappa Create Co., Ltd.	(100)	(1 536)	(1 364)	
Kendrion NV	(100)	(2 364)	(2 112)	
Kindred Group PLC	(169)	(2 085)	(1 810)	
KMD Brands Ltd.	(6 542)	(6 205)	(5 772)	
Kojima Co., Ltd.	(900)	(7 088)	(5 589)	
Konaka Co., Ltd.	(100)	(341)	(316)	
Kongsberg Automotive ASA	(628)	(268)	(195)	
Kourakuen Holdings Corp.	(200)	(3 284)	(2 469)	
K's Holdings Corp.	(200)	(2 760)	(2 511)	
Kura Sushi Inc.	(100)	(4 888)	(3 005)	
Landi Renzo SpA	(297)	(360)	(296)	
Lovisa Holdings Ltd.	(48)	(807)	(588)	
Matas A/S	(107)	(1 602)	(1 437)	
Matsuya Co., Ltd.	(200)	(2 025)	(1 766)	
Maytronics Ltd.	(107)	(2 638)	(1 937)	
Media Do Co., Ltd.	(100)	(7 910)	(1 589)	
Mekonomen AB	(420)	(7 783)	(5 816)	
Melco Resorts & Entertainment Ltd.	(421)	(3 127)	(3 123)	
Mercari Inc.	(200)	(12 302)	(3 703)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Mitsubishi Motors Corp.	(400)	(1 770)	(1 743)	
Morito Co., Ltd.	(200)	(1 527)	(1 453)	
MOS Food Services Inc.	(100)	(3 366)	(2 962)	
Musti Group Oyj	(53)	(1 795)	(1 218)	
Neinor Homes SA	(75)	(1 241)	(1 210)	
Nextage Co., Ltd.	(200)	(5 657)	(4 434)	
Nihon Trim Co., Ltd.	(100)	(4 279)	(2 392)	
Nishimatsuya Chain Co., Ltd.	(200)	(2 981)	(2 714)	
Nobia AB	(100)	(407)	(345)	
Nokian Renkaat OYJ	(391)	(8 216)	(5 500)	
Open Door Inc.	(200)	(4 419)	(3 500)	
Ozu Corp.	(100)	(2 158)	(1 799)	
PC Depot Corp.	(200)	(636)	(600)	
Piaggio & C SpA	(100)	(412)	(301)	
Pirelli & C SpA	(174)	(1 123)	(910)	
POLYTEC Holding AG	(317)	(3 464)	(2 565)	
Puma SE	(29)	(2 490)	(2 458)	
Resorttrust Inc.	(500)	(10 343)	(10 540)	
Riso Kyoiku Co., Ltd.	(400)	(1 583)	(1 212)	
Round One Corp.	(100)	(1 467)	(1 450)	
Royal Holdings Co., Ltd.	(200)	(4 269)	(4 531)	
Sanoh Industrial Co., Ltd.	(100)	(1 415)	(621)	
Seiko Holdings Corp.	(200)	(4 908)	(5 503)	
SFP Holdings Co., Ltd.	(400)	(6 130)	(6 141)	
Sharp Corp.	(1 500)	(27 568)	(14 941)	
Shimajima Co., Ltd.	(100)	(1 216)	(912)	
SKYCITY Entertainment Group Ltd.	(201)	(579)	(469)	
Sprix Ltd.	(100)	(1 577)	(909)	
Sumitomo Electric Industries Ltd.	(1 000)	(16 378)	(14 233)	
Sumitomo Rubber Industries Ltd.	(300)	(3 991)	(3 301)	
Super Retail Group Ltd.	(951)	(10 154)	(7 162)	
Syuppin Co., Ltd.	(200)	(2 910)	(2 757)	
Taiho Kogyo Co., Ltd.	(200)	(1 707)	(1 269)	
TCM Group A/S	(14)	(373)	(186)	
Ten Allied Co., Ltd.	(100)	(374)	(292)	
Tokmanni Group Corp.	(46)	(1 130)	(697)	
Tokyo Individualized Educational Institute Inc.	(100)	(582)	(592)	
Toyoda Gosei Co., Ltd.	(100)	(2 623)	(2 035)	
Tsukada Global Holdings Inc.	(400)	(1 323)	(1 322)	
Universal Entertainment Corp.	(100)	(2 815)	(1 382)	
Uxin Ltd.	(2 281)	(4 759)	(1 236)	
VT Holdings Co., Ltd.	(100)	(469)	(458)	
Watts Co., Ltd.	(300)	(2 325)	(2 082)	
Wesfarmers Ltd.	(6)	(335)	(223)	
Westwing Group SE	(28)	(1 647)	(268)	
XXL ASA	(1 457)	(2 705)	(1 123)	
Yakiniku Sakai Holdings Inc.	(500)	(339)	(313)	
Zeal Network SE	(35)	(1 814)	(1 770)	
Zensho Holdings Co., Ltd.	(100)	(2 964)	(3 095)	
ZOZO Inc.	(300)	(11 752)	(6 965)	
		(522 078)	(383 842)	(1,90)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -1,42 %)				
111 Inc.	(436)	(2 280)	(1 159)	
Accrol Group Holdings PLC	(988)	(357)	(378)	
Aeon Co., Ltd.	(100)	(2 373)	(2 235)	
Agrana Beteiligungs AG	(102)	(2 613)	(2 338)	
Bakkafrost P/F	(378)	(32 231)	(31 093)	
BrasilAgro - Co Brasileira de Propriedades Agricolas	(596)	(4 953)	(3 644)	
Cia Brasileira de Distribuicao	(119)	(639)	(476)	
Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc.	(100)	(1 374)	(1 538)	
Coca-Cola Europacific Partners PLC	(182)	(11 098)	(12 117)	
Cosmos Pharmaceutical Corp.	(100)	(16 809)	(12 372)	
Etablissements Franz Colruyt NV	(36)	(1 860)	(1 260)	
GrainCorp Ltd.	(349)	(2 267)	(2 944)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Heineken Holding NV	(75)	(7 041)	(7 024)	
Heineken NV	(239)	(28 341)	(28 041)	
HKScan OYJ	(402)	(974)	(636)	
Inageya Co., Ltd.	(100)	(1 646)	(1 175)	
Kagome Co., Ltd.	(100)	(3 204)	(3 143)	
Kansai Food Market Ltd.	(100)	(1 223)	(1 127)	
Kirin Holdings Co., Ltd.	(200)	(4 071)	(4 059)	
Kobe Bussan Co., Ltd.	(600)	(26 603)	(18 943)	
Kotobuki Spirits Co., Ltd.	(200)	(12 935)	(14 034)	
KWS Saat SE & Co KGaA	(125)	(13 983)	(9 524)	
Kyokuyo Co., Ltd.	(100)	(3 575)	(3 281)	
Lion Corp.	(100)	(2 113)	(1 420)	
MatsukiyoCocokara & Co.	(300)	(14 036)	(15 638)	
McPherson's Ltd.	(470)	(367)	(273)	
MELJI Holdings Co., Ltd.	(100)	(7 578)	(6 324)	
Natori Co., Ltd.	(100)	(2 232)	(1 917)	
Newlat Food SpA	(100)	(778)	(762)	
NH Foods Ltd.	(100)	(4 739)	(4 031)	
Nichirei Corp.	(100)	(2 868)	(2 240)	
Nippon Corp.	(500)	(9 272)	(7 748)	
Nippon Suisan Kaisha Ltd.	(300)	(1 828)	(1 632)	
Nisshin Oillio Group Ltd.	(100)	(3 566)	(2 977)	
Norway Royal Salmon ASA	(107)	(2 787)	(3 507)	
Oeon Holdings Inc.	(300)	(1 091)	(857)	
Okuwa Co., Ltd.	(300)	(3 874)	(2 407)	
Ontex Group NV	(110)	(1 030)	(1 108)	
Raisio Oyj	(437)	(2 443)	(1 143)	
Rohto Pharmaceutical Co., Ltd.	(200)	(7 895)	(7 444)	
Salmar ASA	(4)	(367)	(362)	
Sanford Ltd.	(579)	(2 351)	(1 909)	
Savencia SA	(16)	(1 349)	(1 295)	
Schouw & Co A/S	(17)	(1 827)	(1 524)	
Suominen OYJ	(123)	(821)	(496)	
Synlait Milk Ltd.	(136)	(362)	(340)	
Treasury Wine Estates Ltd.	(73)	(782)	(735)	
Uoriki Co., Ltd.	(100)	(2 166)	(2 284)	
Welcia Holdings Co., Ltd.	(300)	(12 120)	(7 748)	
Zur Rose Group AG	(36)	(8 184)	(3 476)	
		(281 276)	(244 138)	(1,21)
Soins de santé (31 décembre 2021 : -1,81 %)				
3-D Matrix Ltd.	(100)	(397)	(295)	
Addlife AB	(13)	(389)	(251)	
Atrys Health SA	(76)	(1 119)	(672)	
Bactiguard Holding AB	(159)	(3 541)	(2 242)	
Basilea Pharmaceutica AG	(52)	(3 187)	(2 705)	
Bavarian Nordic A/S	(335)	(10 936)	(14 209)	
Bergenbio ASA	(720)	(1 034)	(1 055)	
BICO Group AB	(702)	(26 710)	(7 840)	
Biocartis Group NV	(1 027)	(3 236)	(2 645)	
Carmat SA	(42)	(533)	(595)	
Clinuvel Pharmaceuticals Ltd.	(43)	(828)	(566)	
Cochlear Ltd.	(3)	(626)	(529)	
Coloplast A/S	(143)	(21 536)	(20 963)	
Compugen Ltd.	(294)	(1 828)	(702)	
CompuGroup Medical SE & Co KGaA	(105)	(8 518)	(5 755)	
DiaSorin SPA	(155)	(26 604)	(26 171)	
Eurobio Scientific SA	(50)	(1 391)	(1 436)	
Eurofins Scientific SE	(6)	(810)	(608)	
Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.	(38)	(698)	(609)	
Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	(5)	(427)	(321)	
Fuso Pharmaceutical Industries Ltd.	(100)	(2 828)	(2 037)	
GN Store Nord AS	(76)	(3 485)	(3 428)	
GSK PLC	(11)	(621)	(618)	
Idorsia Ltd.	(22)	(484)	(405)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Inmode Ltd.	(141)	(4 562)	(4 076)	
JMDC Inc.	(100)	(6 359)	(5 612)	
JMS Co., Ltd.	(300)	(2 834)	(1 584)	
Koa Shoji Holdings Co., Ltd.	(300)	(2 134)	(2 045)	
KYORIN Holdings Inc.	(200)	(4 373)	(3 369)	
M1 Kliniken AG	(34)	(355)	(238)	
M3 Inc.	(500)	(23 724)	(18 506)	
Medical Data Vision Co., Ltd.	(100)	(1 132)	(961)	
Medios AG	(171)	(8 782)	(6 042)	
Merus NV	(40)	(1 364)	(1 168)	
Mithra Pharmaceuticals SA	(393)	(3 491)	(3 853)	
Molecular Partners AG	(49)	(964)	(435)	
Morphosys AG	(84)	(3 952)	(2 127)	
Nexus AG	(59)	(5 105)	(3 978)	
Nicox	(353)	(877)	(818)	
Nipro Corp.	(300)	(3 695)	(3 039)	
Nissui Pharmaceutical Co., Ltd.	(100)	(1 245)	(1 625)	
Olympus Corp.	(800)	(18 258)	(20 711)	
OncTherapy Science Inc.	(300)	(379)	(182)	
Orion OYJ	(187)	(10 255)	(10 743)	
Pharma Foods International Co., Ltd.	(600)	(19 836)	(8 027)	
PolyNovo Ltd.	(2 672)	(6 035)	(3 212)	
QIAGEN NV	(28)	(1 618)	(1 688)	
Q-Linea AB	(29)	(373)	(283)	
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	(50)	(2 755)	(2 799)	
Sartorius AG	(5)	(2 314)	(2 248)	
Scancell Holdings PLC	(2 967)	(585)	(598)	
Ship Healthcare Holdings Inc.	(200)	(6 158)	(4 582)	
Siegfried Holding AG	(1)	(1 070)	(822)	
Smith & Nephew PLC	(35)	(1 443)	(1 261)	
Starpharma Holdings Ltd.	(312)	(360)	(205)	
Summerset Group Holdings Ltd.	(42)	(425)	(323)	
SwedenCare AB	(141)	(1 421)	(1 541)	
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	(100)	(3 521)	(3 625)	
Terumo Corp.	(100)	(3 876)	(3 882)	
Teva Pharmaceutical Industries Ltd.	(2 586)	(29 949)	(25 085)	
Tsumura & Co.	(200)	(7 486)	(5 783)	
UroGen Pharma Ltd.	(62)	(2 081)	(655)	
		(316 912)	(254 388)	(1,26)
Services financiers (31 décembre 2021 : -1,05 %)				
Aareal Bank AG	(36)	(1 362)	(1 388)	
ABC Arbitrage	(112)	(1 218)	(1 060)	
Aegon NV, AMS	(3 400)	(22 005)	(18 928)	
Ageas SA	(218)	(13 316)	(12 342)	
Aiful Corp.	(100)	(382)	(332)	
Akatsuki Corp.	(300)	(968)	(926)	
Alm Brand A/S	(942)	(1 919)	(1 778)	
ASR Nederland NV	(73)	(4 046)	(3 797)	
Axactor ASA	(447)	(550)	(347)	
Azimut Holding SpA	(49)	(1 329)	(1 096)	
Baloise Holding AG	(106)	(21 400)	(22 267)	
Banca Popolare di Sondrio SPA	(410)	(1 826)	(1 817)	
Banco Macro SA	(111)	(2 134)	(1 604)	
Banco Santander Chile, NYSE	(178)	(4 652)	(3 740)	
Bank Hapoalim BM	(387)	(4 546)	(4 157)	
Bank of Queensland Ltd.	(1 350)	(9 698)	(7 987)	
Barclays PLC	(1 063)	(14 130)	(10 421)	
Bendigo & Adelaide Bank Ltd.	(3)	(27)	(24)	
CA Immobilien Anlagen AG	(37)	(1 719)	(1 509)	
Challenger Ltd.	(2 217)	(12 594)	(13 451)	
Clal Insurance Enterprises Holdings Ltd.	(100)	(2 282)	(2 288)	
CNFinance Holdings Ltd.	(18)	(59)	(59)	
Cofinimmo SA	(97)	(17 787)	(13 552)	
Concordia Financial Group Ltd.	(100)	(446)	(446)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Credicorp Ltd.	(11)	(2 077)	(1 701)	
Credit Saison Co., Ltd.	(800)	(10 916)	(11 842)	
Danske Bank A/S	(323)	(7 077)	(5 875)	
Deutsche Boerse AG	(14)	(2 983)	(3 013)	
Deutsche Pfandbriefbank AG	(89)	(1 343)	(1 030)	
Fanhua Inc.	(83)	(1 339)	(554)	
Fintech Global Inc.	(1 700)	(950)	(678)	
Flow Traders	(296)	(12 961)	(10 906)	
Greenlight Capital Re Ltd.	(247)	(2 157)	(2 463)	
Grupo Financiero Galicia SA	(1 014)	(11 505)	(9 038)	
Grupo Supervielle SA	(1 428)	(3 466)	(2 505)	
Gruppo MutuiOnline SpA	(100)	(3 421)	(3 253)	
Harel Insurance Investments & Financial Services Ltd.	(385)	(4 519)	(4 824)	
HDFC Bank Ltd.	(54)	(4 383)	(3 828)	
Hirose Tusyo Inc.	(100)	(2 325)	(2 318)	
HSBC Holdings PLC	(280)	(11 907)	(11 800)	
Humm Group Ltd.	(442)	(361)	(161)	
Hypoport SE	(4)	(2 064)	(1 020)	
Illimity Bank SpA	(386)	(6 779)	(5 414)	
Immobel SA	(233)	(24 574)	(18 947)	
Insignia Financial Ltd.	(118)	(374)	(282)	
Isracard Ltd.	(100)	(482)	(459)	
Japan Investment Adviser Co., Ltd.	(300)	(3 586)	(3 663)	
Japan Post Insurance Co., Ltd.	(200)	(4 591)	(4 123)	
Julius Baer Group Ltd.	(14)	(950)	(831)	
Jyske Bank A/S	(67)	(4 527)	(4 210)	
Migdal Insurance & Financial Holdings Ltd.	(936)	(1 124)	(1 788)	
Minkabu The Infonoid Inc.	(100)	(2 259)	(2 572)	
Monex Group Inc.	(600)	(4 422)	(2 404)	
Morningstar Japan KK	(400)	(2 646)	(1 941)	
Netwealth Group Ltd.	(236)	(3 134)	(2 546)	
Nomura Holdings Inc.	(100)	(572)	(471)	
ORIX Corp.	(200)	(4 917)	(4 322)	
Protector Forsikring ASA	(229)	(2 112)	(3 062)	
Prudential PLC	(32)	(1 535)	(1 037)	
Resurs Holding AB	(191)	(795)	(488)	
Ringkjoebing Landbobank A/S	(4)	(560)	(561)	
Shinsei Bank Ltd.	(100)	(2 418)	(1 942)	
SiriusPoint Ltd.	(214)	(2 135)	(1 496)	
St Galler Kantonalbank AG	(1)	(592)	(592)	
Storebrand ASA	(2 154)	(26 477)	(19 715)	
Swiss Re AG	(3)	(400)	(299)	
TAG Immobilien AG	(172)	(5 654)	(2 526)	
Talanx AG	(7)	(339)	(343)	
Topdanmark AS	(68)	(4 803)	(4 555)	
Toyo Securities Co., Ltd.	(200)	(361)	(370)	
Unipol Gruppo SpA	(116)	(691)	(678)	
Zip Co., Ltd.	(799)	(4 874)	(312)	
		(344 832)	(294 074)	(1,45)
Technologies de l'information (31 décembre 2021: -1,65 %)				
Access Co., Ltd.	(100)	(605)	(705)	
Ad-sol Nissin Corp.	(100)	(2 636)	(1 447)	
All for One Group SE	(61)	(4 953)	(4 524)	
Alpha Systems Inc.	(100)	(4 242)	(4 050)	
ams-OSRAM AG	(1 206)	(27 461)	(13 972)	
Appen Ltd.	(373)	(2 558)	(1 856)	
Argo Graphics Inc.	(100)	(3 562)	(3 043)	
Ascentech KK	(200)	(2 303)	(1 177)	
Asetek A/S	(85)	(462)	(220)	
AudioCodes Ltd.	(259)	(7 308)	(7 263)	
BE Semiconductor Industries NV	(367)	(38 220)	(22 702)	
Bechtel AG	(42)	(3 489)	(2 210)	
Bell System24 Holdings Inc.	(100)	(1 527)	(1 315)	
Bravura Solutions Ltd.	(1 626)	(4 305)	(2 041)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
CAICA DIGITAL Inc.	(300)	(569)	(430)	
Carel Industries SpA	(32)	(1 086)	(818)	
Codan Ltd.	(395)	(2 778)	(2 439)	
Cube System Inc.	(100)	(922)	(858)	
Cybozu Inc.	(400)	(11 543)	(3 563)	
DKK-Toa Corp.	(200)	(1 892)	(1 643)	
eSOL Co., Ltd.	(300)	(1 802)	(1 723)	
Fortnox AB	(398)	(2 066)	(2 355)	
Freee KK	(500)	(36 688)	(15 572)	
Gilat Satellite Networks Ltd.	(268)	(2 107)	(2 066)	
GMO internet Inc.	(300)	(9 802)	(6 626)	
ITbook Holdings Co., Ltd.	(1 300)	(8 109)	(6 752)	
Ituran Location and Control Ltd.	(230)	(8 202)	(7 266)	
IVU Traffic Technologies AG	(188)	(4 969)	(3 874)	
Japan Cash Machine Co., Ltd.	(100)	(667)	(633)	
Japan Display Inc.	(1 000)	(372)	(655)	
Jenoptik AG	(104)	(3 712)	(2 985)	
Kapsch TrafficCom AG	(21)	(421)	(357)	
Konica Minolta Inc.	(1 200)	(6 526)	(5 162)	
Kyosan Electric Manufacturing Co., Ltd.	(200)	(947)	(820)	
Lime Technologies AB	(48)	(1 964)	(1 355)	
Link Administration Holdings Ltd.	(94)	(373)	(316)	
Manz AG	(100)	(6 540)	(5 327)	
Matrix IT Ltd.	(111)	(3 077)	(3 310)	
Meyer Burger Technology AG	(24 346)	(13 967)	(13 273)	
Netcompany Group A/S	(420)	(39 242)	(29 536)	
Nexi SpA	(4 041)	(62 412)	(43 074)	
NEXTDC Ltd.	(39)	(359)	(368)	
Nice Ltd., CAAE	(36)	(11 179)	(8 937)	
Pexip Holding ASA	(1 043)	(5 255)	(1 847)	
Pricer AB	(497)	(1 445)	(963)	
Pushpay Holdings Ltd.	(931)	(1 124)	(948)	
PVA TePla AG	(8)	(342)	(197)	
Rakus Co., Ltd.	(500)	(20 545)	(7 591)	
Restar Holdings Corp.	(100)	(2 101)	(1 811)	
RTX A/S	(240)	(8 559)	(6 006)	
SAES Getters SpA	(100)	(3 549)	(2 859)	
Sakura Internet Inc.	(500)	(4 460)	(2 554)	
Samco Inc.	(100)	(2 427)	(2 522)	
Sansan Inc.	(100)	(1 324)	(874)	
Secunet Security Networks AG	(6)	(3 816)	(2 286)	
SHIFT Inc.	(100)	(19 968)	(16 768)	
Siltronic AG	(9)	(1 122)	(861)	
SimCorp A/S	(360)	(45 228)	(33 634)	
Sinch AB	(3 326)	(51 476)	(13 940)	
Smart Eye AB	(12)	(325)	(91)	
Softwareone Holding AG	(127)	(2 454)	(1 958)	
Solxyz Co., Ltd.	(300)	(1 274)	(1 054)	
Systemsoft Corp.	(2 300)	(5 407)	(2 271)	
Techno Horizon Co., Ltd.	(300)	(4 352)	(1 658)	
Technology One Ltd.	(44)	(436)	(418)	
TietoEVERY Oyj	(282)	(10 262)	(8 960)	
Tyro Payments Ltd.	(609)	(826)	(324)	
UMC Electronics Co., Ltd.	(100)	(936)	(420)	
User Local inc	(100)	(1 659)	(1 491)	
Wallix Group	(100)	(2 108)	(1 937)	
Xero Ltd.	(14)	(1 310)	(956)	
		(552 014)	(355 817)	(1,76)
Services de communication (31 décembre 2021 : -1,54 %)				
1&1 AG	(22)	(721)	(534)	
Adevinta ASA	(2 175)	(26 495)	(20 205)	
Ateam Inc.	(100)	(709)	(694)	
Bambuser AB	(279)	(532)	(137)	
Bittium Oyj	(136)	(1 291)	(939)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Borussia Dortmund GmbH & Co KGaA	(57)	(440)	(275)	
Chorus Ltd.	(224)	(1 295)	(1 297)	
COLOPL Inc.	(300)	(2 225)	(1 866)	
COOKPAD Inc.	(100)	(285)	(192)	
CyberAgent Inc.	(600)	(10 490)	(7 697)	
Dena Co., Ltd.	(300)	(7 005)	(5 381)	
Domain Holdings Australia Ltd.	(291)	(1 160)	(777)	
Drecom Co., Ltd.	(400)	(1 764)	(2 461)	
FAN Communications Inc.	(100)	(421)	(366)	
Gree Inc.	(1 200)	(12 572)	(9 389)	
Grupo Televisa SAB	(1 891)	(22 722)	(19 954)	
Imagineer Co., Ltd.	(100)	(1 219)	(856)	
Infrastrutture Wireless Italiane SpA	(959)	(12 143)	(12 524)	
Japan Communications Inc.	(200)	(375)	(382)	
J-Stream Inc.	(200)	(4 458)	(1 337)	
Juventus Football Club SPA	(342)	(165)	(167)	
Kadokawa Corp.	(400)	(13 780)	(11 102)	
Kahoot! ASA	(2 060)	(10 564)	(4 821)	
Kakaku.com Inc.	(100)	(2 881)	(2 125)	
KDDI Corp.	(400)	(16 936)	(16 290)	
KLab Inc.	(100)	(466)	(569)	
Koei Tecmo Holdings Co., Ltd.	(300)	(19 176)	(12 477)	
Link-U Inc.	(200)	(1 695)	(1 331)	
MFE-MediaForEurope NV	(307)	(367)	(278)	
Mixi Inc.	(300)	(7 543)	(6 415)	
Mobile TeleSystems PJSC	(1 375)	(12 856)	-	
Modern Times Group MTG AB	(342)	(3 844)	(3 537)	
Modern Times Group MTG AB, droits	(342)	(1 081)	(1 076)	
MTI Ltd.	(300)	(2 268)	(1 399)	
NOS SGPS SA	(3 166)	(16 087)	(16 378)	
Orange SA	(2 712)	(36 776)	(41 176)	
ProSiebenSat.1 Media SE	(562)	(7 323)	(6 677)	
q.beyond AG	(674)	(1 174)	(1 016)	
RPA Holdings Inc.	(1 600)	(6 630)	(5 029)	
RTL Group SA	(39)	(2 686)	(2 095)	
Seek Ltd.	(944)	(26 789)	(17 585)	
Septeni Holdings Co., Ltd.	(200)	(1 164)	(993)	
Softbank Corp.	(1 700)	(25 532)	(24 317)	
Southern Cross Media Group Ltd.	(221)	(357)	(195)	
Spark New Zealand Ltd.	(602)	(2 452)	(2 318)	
SpeedCast International Ltd.	(1 733)	(1 220)	-	
Stillfront Group AB	(767)	(3 001)	(2 179)	
Storytel AB	(301)	(9 035)	(1 852)	
Stroeer SE & Co KGaA	(15)	(1 382)	(868)	
Tele2 AB	(230)	(4 120)	(3 373)	
Telenor ASA	(793)	(14 636)	(13 564)	
United Internet AG	(46)	(1 866)	(1 689)	
Vodafone Group PLC	(175)	(3 662)	(3 517)	
Z Holdings Corp.	(12 500)	(81 367)	(47 048)	
		(449 203)	(340 719)	(1,68)
Services publics (31 décembre 2021 : -0,61 %)				
APA Group	(16)	(138)	(160)	
Ascopiave SpA	(932)	(5 056)	(3 626)	
Consolidated Water Co., Ltd.	(25)	(371)	(468)	
E.ON SE	(1 752)	(21 607)	(18 921)	
Elmera Group ASA	(125)	(363)	(326)	
Enel Americas SA	(1 912)	(13 267)	(11 222)	
Enel Chile SA	(964)	(2 823)	(1 380)	
Enel SpA	(1 641)	(12 179)	(11 552)	
Genesis Energy Ltd.	(210)	(501)	(446)	
Grenergy Renovables SA	(8)	(339)	(366)	
Hera SpA	(1 567)	(7 355)	(5 833)	
Hokkaido Electric Power Co Inc.	(300)	(1 608)	(1 410)	
Kansai Electric Power Co Inc.	(100)	(1 255)	(1 276)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kyushu Electric Power Co Inc.	(200)	(1 815)	(1 656)	
Meridian Energy Ltd.	(111)	(486)	(417)	
Orsted AS	(94)	(13 314)	(12 647)	
RENOVA Inc.	(100)	(4 041)	(2 324)	
Scatec ASA	(767)	(16 005)	(8 478)	
Shizuoka Gas Co., Ltd.	(200)	(2 760)	(1 726)	
Terna - Rete Elettrica Nazionale	(221)	(2 244)	(2 232)	
Uniper SE	(203)	(6 666)	(3 879)	
Verbund AG	(3)	(406)	(378)	
West Holdings Corp.	(100)	(3 814)	(3 466)	
		(118 413)	(94 189)	(0,47)
Immobilier (31 décembre 2021 : -0,70 %)				
Abacus Property Group	(116)	(364)	(264)	
Aeon Mall Co., Ltd.	(100)	(1 684)	(1 575)	
AEON REIT Investment Corp.	(1)	(1 600)	(1 454)	
AFI Properties Ltd.	(138)	(8 214)	(8 539)	
Altisource Portfolio Solutions SA	(122)	(1 652)	(1 690)	
Amot Investments Ltd.	(394)	(3 059)	(3 045)	
Argosy Property Ltd.	(726)	(902)	(719)	
Aroundtown SA	(479)	(2 717)	(1 959)	
Atenor	(158)	(13 076)	(10 995)	
Big Shopping Centers Ltd.	(74)	(14 645)	(11 718)	
Castellum AB	(19)	(563)	(314)	
Charter Hall Group	(772)	(7 944)	(7 416)	
Charter Hall Long Wale REIT	(1 119)	(5 398)	(4 238)	
CRE Logistics REIT Inc.	(1)	(2 435)	(1 791)	
Cromwell Property Group	(3 063)	(2 693)	(2 051)	
Deutsche Wohnen SE	(286)	(13 449)	(8 462)	
Dexus	(139)	(1 408)	(1 095)	
Goodman Group	(402)	(8 476)	(6 362)	
Grand City Properties SA	(16)	(365)	(278)	
Hamborner REIT AG	(279)	(3 881)	(3 213)	
Hotel Property Investments	(61)	(166)	(168)	
Hulic Co., Ltd.	(200)	(2 195)	(1 994)	
Ichigo Inc.	(100)	(305)	(297)	
Ingenia Communities Group	(516)	(2 290)	(1 822)	
IRSA Inversiones y Representaciones SA	(467)	(2 280)	(2 169)	
JALCO Holdings Inc.	(900)	(1 524)	(1 393)	
LEG Immobilien SE	(29)	(3 712)	(3 094)	
Lippo Malls Indonesia Retail Trust	(93)	(18)	(4)	
Melisron Ltd.	(80)	(6 939)	(6 866)	
Mirvac Group	(13 304)	(33 561)	(23 307)	
Mobimo Holding AG	(10)	(4 067)	(3 126)	
NAM TAI Property Inc.	(67)	(549)	(364)	
National Storage REIT	(6 403)	(7 756)	(12 155)	
Nomura Real Estate Holdings Inc.	(200)	(5 913)	(6 314)	
Palace Capital PLC	(100)	(423)	(421)	
Raysum Co., Ltd.	(100)	(803)	(1 063)	
Renta Corp. Real Estate SA	(160)	(520)	(368)	
Star Asia Investment Corp.	(4)	(2 632)	(2 332)	
Stendorren Fastigheter AB	(11)	(366)	(215)	
Stockland	(93)	(362)	(298)	
Stride Property Group	(203)	(357)	(270)	
Summit Real Estate Holdings Ltd.	(55)	(1 442)	(1 127)	
Takara Leben Real Estate Investment Corp.	(1)	(1 294)	(1 114)	
Tokyo Tatemono Co., Ltd.	(400)	(7 512)	(7 099)	
Tokyu Fudosan Holdings Corp.	(300)	(2 137)	(2 034)	
Tosei Reit Investment Corp.	(2)	(3 187)	(2 569)	
Urbanet Corp. Co., Ltd.	(400)	(1 377)	(1 139)	
Vonovia SE	(315)	(16 869)	(12 490)	
Warehouses De Pauw CVA	(16)	(793)	(647)	
Yoma Strategic Holdings Ltd.	(11 200)	(4 068)	(1 443)	
		(209 942)	(174 880)	(0,86)
Total des actions étrangères – position vendeur		(4 351 176)	(3 410 997)	(16,86)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Commissions de courtage intégrées (note 3)		(16 012)		
Total des placements		18 497 293	18 286 710	90,42
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			24 659	0,12
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			(23 454)	(0,12)
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			709 100	3,51
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			(693 551)	(3,43)
Autres actifs, moins les passifs			1 920 989	9,50
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			20 224 453	100,00

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Contrepartie*	Code de devise	Montant vendu	Code de devise	Montant acheté	Date d'échéance	Plus-value (moins-value) latente \$
Banque Royale du Canada	CAD	(186 000)	USD	147 145	21 sept. 2022	3 764
Banque Royale du Canada	EUR	(275 000)	USD	294 594	21 sept. 2022	6 835
Banque Royale du Canada	GBP	(283 000)	USD	355 144	21 sept. 2022	13 971
Banque Royale du Canada	USD	(107 222)	EUR	102 000	21 sept. 2022	89
						24 659
Banque Royale du Canada	USD	(411 883)	AUD	578 000	21 sept. 2022	(18 147)
Banque Royale du Canada	USD	(386 021)	JPY	51 568 000	21 sept. 2022	(5 307)
						(23 454)
						1 205

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

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

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; Credit Suisse First Boston Corporation, non notée				
Swaps d'actions – position acheteur				
Dollar australien – taux de swap des acceptations bancaires (BBSW) à 1 mois				
5 716	29 juill. 2022	Agl Energy Ltd, swap sur rendement total	41 830	(2 229)
332	29 juill. 2022	Ainsworth Game Technology Lt, swap sur rendement total	283	(36)
3 107	29 juill. 2022	Alumina Ltd, swap sur rendement total	4 038	(652)
641	29 juill. 2022	Ampol Ltd, swap sur rendement total	19 463	(78)
3 900	29 juill. 2022	Arafura Resources Ltd, swap sur rendement total	986	(463)
3 255	29 juill. 2022	Arden Leisure Group Ltd, swap sur rendement total	4 042	141
160	29 juill. 2022	Arena Reit, swap sur rendement total	612	(5)
2 102	29 juill. 2022	Aristocrat Leisure Ltd, swap sur rendement total	64 796	780
58	29 juill. 2022	Asx Ltd, swap sur rendement total	4 204	105
648	29 juill. 2022	Atlas Arteria, swap sur rendement total	4 633	251
82	29 juill. 2022	Australian Unity Office Fund, swap sur rendement total	162	(9)
3 154	29 juill. 2022	Base Resources Ltd, swap sur rendement total	783	(26)
1 117	29 juill. 2022	Beacon Lighting Group Ltd, swap sur rendement total	1 769	(223)
2 078	29 juill. 2022	Bega Cheese Ltd, swap sur rendement total	7 041	(297)
17	29 juill. 2022	Bluescope Steel Ltd, swap sur rendement total	240	(19)
311	29 juill. 2022	Boral Ltd, swap sur rendement total	714	(103)
555	29 juill. 2022	Brickworks Ltd, swap sur rendement total	9 127	(1 070)
254	29 juill. 2022	Bwp Trust, swap sur rendement total	897	(7)
618	29 juill. 2022	Capricorn Metals Ltd, swap sur rendement total	1 716	(341)
5 353	29 juill. 2022	Chalice Mining Ltd, swap sur rendement total	17 949	(11 969)
1 662	29 juill. 2022	Computershare Ltd, swap sur rendement total	36 326	1 958
139	29 juill. 2022	Csl Ltd, swap sur rendement total	33 174	165
327	29 juill. 2022	Data#3 Ltd, swap sur rendement total	1 352	(51)
311	29 juill. 2022	De Grey Mining Ltd, swap sur rendement total	222	(12)
961	29 juill. 2022	Downer Edi Ltd, swap sur rendement total	4 305	(120)
49	29 juill. 2022	Elders Ltd, swap sur rendement total	547	(6)
5 632	29 juill. 2022	Elixir Energy Ltd, swap sur rendement total	674	(47)
183	29 juill. 2022	Eml Payments Ltd, swap sur rendement total	200	(36)
1 081	29 juill. 2022	Estia Health Ltd, swap sur rendement total	1 831	(284)
296	29 juill. 2022	Event Hospitality And Entert, swap sur rendement total	3 426	(384)
276	29 juill. 2022	Evolution Mining Ltd, swap sur rendement total	583	(322)
9 858	29 juill. 2022	Firefinch Ltd, swap sur rendement total	1 749	(1 827)
226	29 juill. 2022	Fleetwood Corp Ltd, swap sur rendement total	260	(68)
673	29 juill. 2022	Flight Centre Travel Group L, swap sur rendement total	10 363	(1 175)
6 139	29 juill. 2022	Grange Resources Ltd, swap sur rendement total	6 889	(2 073)
335	29 juill. 2022	Home Consortium, swap sur rendement total	1 340	(208)
3 328	29 juill. 2022	Horizon Oil Ltd, swap sur rendement total	399	(30)
196	29 juill. 2022	Hub24 Ltd, swap sur rendement total	3 524	68
489	29 juill. 2022	Idp Education Ltd, swap sur rendement total	10 332	477
671	29 juill. 2022	Iluka Resources Ltd, swap sur rendement total	5 619	(727)
425	29 juill. 2022	Infomedia Ltd, swap sur rendement total	630	(4)
649	29 juill. 2022	Inghams Group Ltd, swap sur rendement total	1 485	(107)
223	29 juill. 2022	Invokecare Ltd, swap sur rendement total	2 069	(42)
514	29 juill. 2022	Iress Ltd, swap sur rendement total	5 248	466
187	29 juill. 2022	Ive Group Ltd, swap sur rendement total	285	(3)
176	29 juill. 2022	Jb Hi-Fi Ltd, swap sur rendement total	6 004	(757)
59	29 juill. 2022	Johns Lyng Group Ltd, swap sur rendement total	300	4
127	29 juill. 2022	Jumbo Interactive Ltd, swap sur rendement total	1 602	(116)
890	29 juill. 2022	Karoon Energy Ltd, swap sur rendement total	1 374	(238)
1 014	29 juill. 2022	Lendlease Group, swap sur rendement total	8 194	(1 343)
12 519	29 juill. 2022	Liontown Resources Ltd, swap sur rendement total	11 716	(3 924)
348	29 juill. 2022	Lottery Corp Ltd The, swap sur rendement total	1 395	1 395
488	29 juill. 2022	Macquarie Group Ltd, swap sur rendement total	72 987	(6 805)
347	29 juill. 2022	Metcash Ltd, swap sur rendement total	1 305	(23)
37	29 juill. 2022	Monadelphous Group Ltd, swap sur rendement total	327	(39)
879	29 juill. 2022	Monash Ivf Group Ltd, swap sur rendement total	733	(111)
1 825	29 juill. 2022	Mount Gibson Iron Ltd, swap sur rendement total	874	(235)
213	29 juill. 2022	Nanosonics Ltd, swap sur rendement total	635	21
183	29 juill. 2022	Nearmap Ltd, swap sur rendement total	167	(26)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
1 167	29 juill. 2022	Neometals Ltd, swap sur rendement total	937	(480)
552	29 juill. 2022	Neuren Pharmaceuticals Ltd, swap sur rendement total	1 861	(24)
383	29 juill. 2022	New Century Resources Ltd, swap sur rendement total	567	(154)
1 257	29 juill. 2022	New Hope Corp Ltd, swap sur rendement total	3 858	(261)
86	29 juill. 2022	Nib Holdings Ltd, swap sur rendement total	563	19
16 233	29 juill. 2022	Nickel Mines Ltd, swap sur rendement total	14 039	(4 471)
157	29 juill. 2022	Nitro Software Ltd, swap sur rendement total	187	(1)
1 735	29 juill. 2022	Northern Star Resources Ltd, swap sur rendement total	10 527	(2 891)
191	29 juill. 2022	Novonix Ltd, swap sur rendement total	386	(233)
580	29 juill. 2022	Orica Ltd, swap sur rendement total	8 180	(116)
5 641	29 juill. 2022	Origin Energy Ltd, swap sur rendement total	28 672	(5 030)
1 384	29 juill. 2022	Oz Minerals Ltd, swap sur rendement total	21 803	(7 478)
1 908	29 juill. 2022	Pact Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 055	(553)
1 135	29 juill. 2022	Pantoro Ltd, swap sur rendement total	191	(79)
1 231	29 juill. 2022	Perseus Mining Ltd, swap sur rendement total	1 731	(367)
5 491	29 juill. 2022	Pilbara Minerals Ltd, swap sur rendement total	11 154	(3 208)
3 633	29 juill. 2022	Pinnacle Investment Manageme, swap sur rendement total	22 655	(3 223)
282	29 juill. 2022	Premier Investments Ltd, swap sur rendement total	4 985	(175)
101	29 juill. 2022	Pro Medicus Ltd, swap sur rendement total	3 785	80
117	29 juill. 2022	Pwr Holdings Ltd, swap sur rendement total	656	(155)
2 707	29 juill. 2022	Qantas Airways Ltd, swap sur rendement total	10 733	(304)
1 019	29 juill. 2022	Qube Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 468	(299)
134	29 juill. 2022	Ramsay Health Care Ltd, swap sur rendement total	8 705	166
1 489	29 juill. 2022	Regis Healthcare Ltd, swap sur rendement total	2 443	(525)
625	29 juill. 2022	Ridley Corp Ltd, swap sur rendement total	992	5
1 992	29 juill. 2022	Sandfire Resources NI, swap sur rendement total	7 863	(1 896)
7 749	29 juill. 2022	Santos Ltd, swap sur rendement total	51 002	(4 420)
15 879	29 juill. 2022	Seven West Media Ltd, swap sur rendement total	5 775	(1 272)
654	29 juill. 2022	Sg Fleet Group Ltd, swap sur rendement total	1 247	(149)
18	29 juill. 2022	Sims Metal Management Ltd, swap sur rendement total	219	(52)
1 700	29 juill. 2022	Smartgroup Corp Ltd, swap sur rendement total	9 214	(2 009)
1 767	29 juill. 2022	South32 Ltd, swap sur rendement total	6 176	(827)
4 030	29 juill. 2022	Srg Global Ltd, swap sur rendement total	2 181	(35)
629	29 juill. 2022	Star Entertainment Grp Ltd/T, swap sur rendement total	1 557	43
167	29 juill. 2022	Steadfast Group Ltd, swap sur rendement total	744	(1)
2 055	29 juill. 2022	Tabcorp Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 941	152
466	29 juill. 2022	Ten Sixty Four Ltd, swap sur rendement total	285	(27)
89	29 juill. 2022	Test Local Currency, swap sur rendement total	1 071	31
552	29 juill. 2022	Uniti Group Ltd, swap sur rendement total	2 409	(16)
2 470	29 juill. 2022	Warrego Energy Ltd, swap sur rendement total	241	(44)
139	29 juill. 2022	Webjet Ltd, swap sur rendement total	658	(51)
6 214	29 juill. 2022	Westgold Resources Ltd, swap sur rendement total	6 532	(655)
4 236	29 juill. 2022	Whitehaven Coal Ltd, swap sur rendement total	18 186	(1 621)
				<u>(75 445)</u>
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
270	29 juill. 2022	Abcam Plc, swap sur rendement total	4 983	6
468	29 juill. 2022	Abrdn Plc, swap sur rendement total	1 172	(146)
615	29 juill. 2022	Alfa Financial Software Hold, swap sur rendement total	1 445	(242)
138	29 juill. 2022	Anglo American Plc, swap sur rendement total	6 349	(1 886)
50	29 juill. 2022	Antofagasta Plc, swap sur rendement total	905	(216)
20	29 juill. 2022	Ashtead Group Plc, swap sur rendement total	1 077	(100)
42	29 juill. 2022	Auto Trader Group Plc, swap sur rendement total	365	(17)
444	29 juill. 2022	Aviva Plc, swap sur rendement total	2 791	(87)
647	29 juill. 2022	Bae Systems Plc, swap sur rendement total	8 415	672
857	29 juill. 2022	Bakkavor Group Plc, swap sur rendement total	1 251	(69)
234	29 juill. 2022	Bank Of Georgia Group Plc, swap sur rendement total	4 796	(1 062)
104	29 juill. 2022	Beazley Plc, swap sur rendement total	813	21
112	29 juill. 2022	Bodycote Plc, swap sur rendement total	924	(215)
846	29 juill. 2022	Brown (N) Group Plc, swap sur rendement total	314	(110)
1 518	29 juill. 2022	Bt Group Plc, swap sur rendement total	4 430	37
7	29 juill. 2022	Bunzl Plc, swap sur rendement total	303	17
98	29 juill. 2022	Burberry Group Plc, swap sur rendement total	2 574	-
2 075	29 juill. 2022	Burford Capital Ltd, swap sur rendement total	26 168	3 266
623	29 juill. 2022	Centrica Plc, swap sur rendement total	781	7
717	29 juill. 2022	Ceres Power Holdings Plc, swap sur rendement total	6 155	(1 210)
112	29 juill. 2022	Clipper Logistics Plc, swap sur rendement total	1 469	(1)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
645	29 juill. 2022	Compass Group Plc, swap sur rendement total	17 070	(626)
50	29 juill. 2022	Craneware Plc, swap sur rendement total	1 441	336
34	29 juill. 2022	Croda International Plc, swap sur rendement total	3 447	(182)
29	29 juill. 2022	Cvs Group Plc, swap sur rendement total	752	(56)
47	29 juill. 2022	Dcc Plc, swap sur rendement total	3 842	(252)
912	29 juill. 2022	Devro Plc, swap sur rendement total	2 713	(239)
234	29 juill. 2022	Diageo Plc, swap sur rendement total	12 942	(501)
518	29 juill. 2022	Diploma Plc, swap sur rendement total	18 080	(3 036)
244	29 juill. 2022	Drax Group Plc, swap sur rendement total	2 458	(107)
298	29 juill. 2022	Eco Animal Health Group Plc, swap sur rendement total	528	(33)
55	29 juill. 2022	Entain Plc, swap sur rendement total	1 073	(88)
598	29 juill. 2022	Equals Group Plc, swap sur rendement total	735	(73)
1 327	29 juill. 2022	Essentra Plc, swap sur rendement total	5 166	(602)
30	29 juill. 2022	Experian Plc, swap sur rendement total	1 131	17
116	29 juill. 2022	Fdm Group Holdings Plc, swap sur rendement total	1 543	(125)
160	29 juill. 2022	Ferguson Plc, swap sur rendement total	23 030	(277)
15	29 juill. 2022	Fevertree Drinks Plc, swap sur rendement total	287	(53)
908	29 juill. 2022	Finsbury Food Group Plc, swap sur rendement total	967	(72)
542	29 juill. 2022	Gem Diamonds Ltd, swap sur rendement total	348	(109)
591	29 juill. 2022	Glencore Plc, swap sur rendement total	4 121	(541)
22	29 juill. 2022	Greggs Plc, swap sur rendement total	623	(109)
106	29 juill. 2022	Gulf Keystone Petroleum Ltd, swap sur rendement total	432	(29)
1 505	29 juill. 2022	Halfords Group Plc, swap sur rendement total	3 369	(1 618)
74	29 juill. 2022	Halma Plc, swap sur rendement total	2 329	(173)
15 007	29 juill. 2022	Hammerson Plc, swap sur rendement total	4 460	(1 958)
3 204	29 juill. 2022	Harbour Energy Plc, swap sur rendement total	18 260	(1 025)
1 128	29 juill. 2022	Hargreaves Lansdown Plc, swap sur rendement total	13 921	(1 201)
28	29 juill. 2022	Hikma Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	710	43
64	29 juill. 2022	Inchcape Plc, swap sur rendement total	697	(28)
2 979	29 juill. 2022	Informa Plc, swap sur rendement total	24 678	(342)
60	29 juill. 2022	Intercontinental Hotels Grou, swap sur rendement total	4 089	(487)
25	29 juill. 2022	Intertek Group Plc, swap sur rendement total	1 647	(24)
322	29 juill. 2022	Investec Plc, swap sur rendement total	2 244	(161)
62	29 juill. 2022	Johnson Matthey Plc, swap sur rendement total	1 924	(106)
121	29 juill. 2022	Joules Group Plc, swap sur rendement total	68	(23)
18 402	29 juill. 2022	Just Group Plc, swap sur rendement total	20 569	(2 919)
1 282	29 juill. 2022	Kainos Group Plc, swap sur rendement total	22 273	(3 072)
567	29 juill. 2022	Keller Group Plc, swap sur rendement total	6 638	(278)
9	29 juill. 2022	Keywords Studios Plc, swap sur rendement total	309	(20)
67	29 juill. 2022	Land Securities Group Plc, swap sur rendement total	711	(61)
2 409	29 juill. 2022	Learning Technologies Group, swap sur rendement total	4 261	(744)
14	29 juill. 2022	Liontrust Asset Management, swap sur rendement total	211	(23)
128	29 juill. 2022	London Stock Exchange Group, swap sur rendement total	15 304	876
100	29 juill. 2022	Lsl Property Services Plc, swap sur rendement total	525	7
376	29 juill. 2022	Man Group Plc/Jersey, swap sur rendement total	1 471	6
264	29 juill. 2022	Marston'S Plc, swap sur rendement total	213	(13)
1 695	29 juill. 2022	Micro Focus International, swap sur rendement total	7 430	(2 419)
1 193	29 juill. 2022	Mitchells & Butlers Plc, swap sur rendement total	3 443	(439)
38	29 juill. 2022	Mondi Plc, swap sur rendement total	866	(33)
1 887	29 juill. 2022	Morgan Advanced Materials Pl, swap sur rendement total	8 129	(1 338)
601	29 juill. 2022	Morgan Sindall Group Plc, swap sur rendement total	17 154	(2 444)
139	29 juill. 2022	National Grid Plc, swap sur rendement total	2 364	(188)
428	29 juill. 2022	Oxford Instruments Plc, swap sur rendement total	13 249	(1 655)
258	29 juill. 2022	Pantheon Resources Plc, swap sur rendement total	361	(45)
3 527	29 juill. 2022	Pendragon Plc, swap sur rendement total	1 155	(106)
5 801	29 juill. 2022	Premier Foods Plc, swap sur rendement total	10 360	(407)
530	29 juill. 2022	Provident Financial Plc, swap sur rendement total	1 657	(442)
965	29 juill. 2022	Rank Group Plc, swap sur rendement total	1 294	(352)
58	29 juill. 2022	Reach Plc, swap sur rendement total	91	(20)
251	29 juill. 2022	Redde Plc, swap sur rendement total	1 325	(158)
132	29 juill. 2022	Renewi Plc, swap sur rendement total	1 495	77
139	29 juill. 2022	Rightmove Plc, swap sur rendement total	1 238	(76)
3 424	29 juill. 2022	Rolls-Royce Holdings Plc, swap sur rendement total	4 449	(179)
900	29 juill. 2022	Royal Mail Plc, swap sur rendement total	3 803	(468)
93	29 juill. 2022	Rs Group Plc, swap sur rendement total	1 283	(113)
595	29 juill. 2022	Schroders Plc, swap sur rendement total	24 906	(2 025)
2 204	29 juill. 2022	Serco Group Plc, swap sur rendement total	6 015	(8)
227	29 juill. 2022	Smiths Group Plc, swap sur rendement total	4 977	(357)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
1 167	29 juill. 2022	Solgold Plc, swap sur rendement total	534	(50)
708	29 juill. 2022	Somero Enterprises Inc- actions ord., swap sur rendement total	4 326	(3)
32	29 juill. 2022	Spirax-Sarco Engineering Plc, swap sur rendement total	4 952	(95)
3 443	29 juill. 2022	Spirent Communications Plc, swap sur rendement total	13 409	886
347	29 juill. 2022	Ssp Group Plc, swap sur rendement total	1 266	(159)
238	29 juill. 2022	Stagecoach Group Plc, swap sur rendement total	390	(2)
2 419	29 juill. 2022	Standard Chartered Plc, swap sur rendement total	23 442	625
17	29 juill. 2022	Travis Perkins Plc, swap sur rendement total	258	(47)
8 873	29 juill. 2022	Tullow Oil Plc, swap sur rendement total	6 514	(1 082)
438	29 juill. 2022	Tyman Plc, swap sur rendement total	1 636	(415)
4 335	29 juill. 2022	Vertu Motors Plc, swap sur rendement total	3 739	(241)
108	29 juill. 2022	Weir Group Plc/The, swap sur rendement total	2 306	(394)
412	29 juill. 2022	Whitbread Plc, swap sur rendement total	16 218	(993)
292	29 juill. 2022	Wincanton Plc, swap sur rendement total	1 587	(151)
230	29 juill. 2022	Xp Power Ltd, swap sur rendement total	10 334	(1 374)
				<u>(38 126)</u>
Couronne danoise – taux interbancaire offert à Copenhague (CIBOR) à 1 mois				
4	29 juill. 2022	Nkt A/S, swap sur rendement total	219	(27)
				<u>(27)</u>
Euro – taux à court terme (€STR)				
15	29 juill. 2022	Aalberts Nv, swap sur rendement total	773	(153)
35	29 juill. 2022	Adidas Ag, swap sur rendement total	7 966	(211)
5	29 juill. 2022	Adyen Nv, swap sur rendement total	9 359	(147)
298	29 juill. 2022	Agfa-Gevaert Nv, swap sur rendement total	1 413	(157)
337	29 juill. 2022	Aib Group Plc, swap sur rendement total	988	(147)
457	29 juill. 2022	Air Liquide Sa, swap sur rendement total	78 960	(6 454)
41	29 juill. 2022	Ald Sa, swap sur rendement total	615	(91)
84	29 juill. 2022	Alfen Nv, swap sur rendement total	9 987	(1 367)
70	29 juill. 2022	Allianz Se- actions ord., swap sur rendement total	17 192	(794)
25	29 juill. 2022	Alstom, swap sur rendement total	728	(157)
20	29 juill. 2022	Argenx Se, swap sur rendement total	9 642	1 424
8	29 juill. 2022	Asml Holding Nv, swap sur rendement total	4 918	(650)
179	29 juill. 2022	Axa Sa, swap sur rendement total	5 229	(426)
100	29 juill. 2022	Bank Of Ireland Group Plc, swap sur rendement total	813	(36)
6	29 juill. 2022	Bawag Group Ag, swap sur rendement total	325	(49)
64	29 juill. 2022	Bayer Ag- actions ord., swap sur rendement total	4 895	(176)
276	29 juill. 2022	Bnp Paribas, swap sur rendement total	16 885	(1 653)
33	29 juill. 2022	Cappgemini Se, swap sur rendement total	7 274	(689)
9	29 juill. 2022	Cargotec Oyj- actions, B, swap sur rendement total	304	(78)
587	29 juill. 2022	Carrefour Sa, swap sur rendement total	13 366	(104)
494	29 juill. 2022	Compagnie De Saint Gobain, swap sur rendement total	27 277	(5 825)
25	29 juill. 2022	Continental Ag, swap sur rendement total	2 242	(148)
494	29 juill. 2022	Danone, swap sur rendement total	35 482	(469)
9	29 juill. 2022	Dassault Aviation Sa, swap sur rendement total	1 807	(103)
106	29 juill. 2022	Dassault Systemes Sa, swap sur rendement total	5 020	(54)
52	29 juill. 2022	Deutsche Post Ag- actions ord., swap sur rendement total	2 506	30
366	29 juill. 2022	Deutsche Telekom Ag- actions ord., swap sur rendement total	9 351	217
29	29 juill. 2022	Duerr Ag, swap sur rendement total	859	(147)
23	29 juill. 2022	Esker Sa, swap sur rendement total	3 949	(577)
60	29 juill. 2022	Esso Société Anonyme Française, swap sur rendement total	4 774	250
286	29 juill. 2022	Faurecia, swap sur rendement total	7 295	(986)
17	29 juill. 2022	Flatex Ag, swap sur rendement total	208	(107)
606	29 juill. 2022	F-Secure Oyj, swap sur rendement total	4 086	(95)
72	29 juill. 2022	Groupe Crit, swap sur rendement total	5 729	(540)
5	29 juill. 2022	Groupe Ldlc, swap sur rendement total	196	(7)
33	29 juill. 2022	Henkel Ag & Co KgaA Vorzug, swap sur rendement total	2 616	(147)
27	29 juill. 2022	Hermes International, swap sur rendement total	38 851	(1 105)
12	29 juill. 2022	Hugo Boss Ag - actions ord., swap sur rendement total	815	10
113	29 juill. 2022	Indra Sistemas Sa, swap sur rendement total	1 391	10
1 407	29 juill. 2022	Ing Groep Nv, swap sur rendement total	17 895	(812)
8	29 juill. 2022	Kbc Group Nv, swap sur rendement total	578	(33)
16	29 juill. 2022	Kerry Group Plc-A, swap sur rendement total	1 971	(95)
4	29 juill. 2022	Kinopolis, swap sur rendement total	247	(17)
171	29 juill. 2022	Koninklijke Ahold Delhaize N, swap sur rendement total	5 733	76
178	29 juill. 2022	Koninklijke Philips Nv, swap sur rendement total	4 934	(377)
43	29 juill. 2022	L'Oreal, swap sur rendement total	19 096	227
23	29 juill. 2022	Lvmh Moet Hennessy Louis Vui, swap sur rendement total	18 043	1 105
109	29 juill. 2022	Manitou Bf, swap sur rendement total	2 611	(534)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
25	29 juill. 2022	Mensch Und Maschine Software, swap sur rendement total	1 605	(232)
18	29 juill. 2022	Mercedes-Benz Group Ag, swap sur rendement total	1 340	(181)
3	29 juill. 2022	Merck KgaA, swap sur rendement total	651	(42)
249	29 juill. 2022	Michelin (Cgde), swap sur rendement total	8 722	(1 018)
50	29 juill. 2022	Mlp Se, swap sur rendement total	386	(61)
10	29 juill. 2022	Naturgy Energy Group Sa, swap sur rendement total	370	(6)
62	29 juill. 2022	Nexans Sa, swap sur rendement total	6 183	(1 155)
25	29 juill. 2022	Orpea, swap sur rendement total	784	(29)
214	29 juill. 2022	Permanent Tsb Group Holdings, swap sur rendement total	382	(39)
129	29 juill. 2022	Permod Ricard Sa, swap sur rendement total	30 496	331
13	29 juill. 2022	Porsche Automobil Hldg- actions priv., swap sur rendement total	1 107	(205)
558	29 juill. 2022	Postnl Nv, swap sur rendement total	2 179	(191)
311	29 juill. 2022	Prosus Nv, swap sur rendement total	26 205	2 815
149	29 juill. 2022	Raiffeisen Bank Internationa, swap sur rendement total	2 078	(294)
10	29 juill. 2022	Rémy Cointreau, swap sur rendement total	2 248	(47)
83	29 juill. 2022	Renault Sa, swap sur rendement total	2 663	(162)
1	29 juill. 2022	Rheinmetall Ag, swap sur rendement total	297	21
9	29 juill. 2022	Rothschild & Co, swap sur rendement total	391	(54)
23	29 juill. 2022	Safran Sa, swap sur rendement total	2 922	741
24	29 juill. 2022	Sampo Oyj- actions, A, swap sur rendement total	1 344	16
127	29 juill. 2022	Sanofi, swap sur rendement total	16 500	(149)
170	29 juill. 2022	Schneider Electric Se, swap sur rendement total	25 883	(2 883)
10	29 juill. 2022	Scor Se, swap sur rendement total	276	(44)
17	29 juill. 2022	Siemens Ag- actions ord., swap sur rendement total	2 226	(233)
20	29 juill. 2022	Siemens Gamesa Renewable Ene, swap sur rendement total	483	(1)
2	29 juill. 2022	Sixt Se, swap sur rendement total	264	(48)
391	29 juill. 2022	Smcp Sa, swap sur rendement total	2 634	(669)
584	29 juill. 2022	Societe Generale Sa, swap sur rendement total	16 452	(2 062)
2	29 juill. 2022	Stef, swap sur rendement total	223	(10)
63	29 juill. 2022	Stellantis Nv, swap sur rendement total	1 001	(149)
37	29 juill. 2022	Stmicroelectronics Nv, swap sur rendement total	1 497	(261)
173	29 juill. 2022	Stora Enso Oyj-R Shs, swap sur rendement total	3 491	(531)
16	29 juill. 2022	Suess Microtec Se, swap sur rendement total	291	(71)
12	29 juill. 2022	Synergie Sa, swap sur rendement total	443	(119)
67	29 juill. 2022	Tomtom, swap sur rendement total	638	(60)
49	29 juill. 2022	Ubisoft Entertainment, swap sur rendement total	2 769	(450)
105	29 juill. 2022	Ucb Sa, swap sur rendement total	11 419	(138)
70	29 juill. 2022	Valeo Sa, swap sur rendement total	1 739	(209)
3	29 juill. 2022	Vallourec Sa, swap sur rendement total	46	(6)
50	29 juill. 2022	Valneva Se, swap sur rendement total	732	(58)
57	29 juill. 2022	Veolia Environnement, swap sur rendement total	1 790	(165)
49	29 juill. 2022	Vgp, swap sur rendement total	10 044	(1 686)
370	29 juill. 2022	Vinci Sa, swap sur rendement total	42 393	(1 351)
13	29 juill. 2022	Wacker Neuson Se, swap sur rendement total	289	(60)
134	29 juill. 2022	Wartsila Oyj Abp, swap sur rendement total	1 343	(80)
477	29 juill. 2022	X-Fab Silicon Foundries Se, swap sur rendement total	3 998	(824)
136	29 juill. 2022	Zalando Se, swap sur rendement total	4 578	(864)
				(35 341)
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
1 002	29 juill. 2022	361 Degrees International, swap sur rendement total	698	51
6 000	29 juill. 2022	Agile Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 097	(179)
4 000	29 juill. 2022	Air China Ltd-H, swap sur rendement total	4 485	381
5 000	29 juill. 2022	Ajisen China Holdings Ltd, swap sur rendement total	806	33
600	29 juill. 2022	Alibaba Group Holding Ltd, swap sur rendement total	11 037	1 475
2 000	29 juill. 2022	Alibaba Health Information T, swap sur rendement total	1 775	184
3 000	29 juill. 2022	Anta Sports Products Ltd, swap sur rendement total	47 541	3 569
994	29 juill. 2022	Austar Lifesciences Ltd, swap sur rendement total	410	(16)
20 000	29 juill. 2022	Baic Motor Corp Ltd-H, swap sur rendement total	8 581	294
1 499	29 juill. 2022	Beijing Capital Intl Airpo-H, swap sur rendement total	1 318	185
3 000	29 juill. 2022	Boe Varitronix Ltd, swap sur rendement total	7 772	3 086
1 000	29 juill. 2022	Byd Co Ltd-H, swap sur rendement total	51 635	4 983
500	29 juill. 2022	Byd Electronic Intl Co Ltd, swap sur rendement total	2 043	610
5 996	29 juill. 2022	Chaowei Power Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 899	199
1 000	29 juill. 2022	China Aoyuan Group Ltd, swap sur rendement total	194	-
19	29 juill. 2022	China Dongxiang Group Co, swap sur rendement total	1	-
10 000	29 juill. 2022	China Electronics Huada Tech, swap sur rendement total	1 397	72
11 000	29 juill. 2022	China Evergrande New Energy, swap sur rendement total	5 786	(1)
5 000	29 juill. 2022	China Hanking Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 011	(33)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
3 512	29 juill. 2022	China Hongqiao Group Ltd, swap sur rendement total	5 121	(504)
1 000	29 juill. 2022	China Mengniu Dairy Co, swap sur rendement total	6 436	(69)
1 000	29 juill. 2022	China Merchants Bank-H, swap sur rendement total	8 630	409
1 000	29 juill. 2022	China Modern Dairy Holdings, swap sur rendement total	194	8
4 000	29 juill. 2022	China Oilfield Services-H, swap sur rendement total	5 057	133
1 000	29 juill. 2022	China Overseas Land & Invest, swap sur rendement total	4 202	453
8 000	29 juill. 2022	China Resources Beer Holding, swap sur rendement total	77 331	12 743
1 900	29 juill. 2022	China Vanke Co Ltd-H, swap sur rendement total	6 159	739
1 501	29 juill. 2022	China Yongda Automobiles Ser, swap sur rendement total	1 831	(171)
4 000	29 juill. 2022	China Youzan Ltd, swap sur rendement total	157	81
4 000	29 juill. 2022	Chinasoft International Ltd, swap sur rendement total	5 280	562
1 000	29 juill. 2022	Chongqing Rural Commercial-H, swap sur rendement total	505	43
1 000	29 juill. 2022	Chow Sang Sang Hldg, swap sur rendement total	1 438	43
7 000	29 juill. 2022	Citic Dameng Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 001	(46)
1 000	29 juill. 2022	Clp Holdings Ltd, swap sur rendement total	10 702	(1 439)
2 000	29 juill. 2022	Cogobuy Group, swap sur rendement total	753	22
2 000	29 juill. 2022	Consun Pharmaceutical Group, swap sur rendement total	1 374	36
4 000	29 juill. 2022	Cosco Shipping Ports Ltd, swap sur rendement total	3 643	(244)
4 004	29 juill. 2022	Country Garden Holdings Co, swap sur rendement total	3 266	70
1 000	29 juill. 2022	Country Garden Services Hold, swap sur rendement total	5 795	681
3 000	29 juill. 2022	Crystal International Group, swap sur rendement total	1 385	(46)
800	29 juill. 2022	Dfzq-H, swap sur rendement total	580	30
20 000	29 juill. 2022	Dongfeng Motor Grp Co Ltd-H, swap sur rendement total	19 595	(695)
9 999	29 juill. 2022	Dongyue Group, swap sur rendement total	16 700	308
2 400	29 juill. 2022	Dynam Japan Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	2 758	101
2 000	29 juill. 2022	Fufeng Group Ltd, swap sur rendement total	1 654	444
9 000	29 juill. 2022	Geely Automobile Holdings Lt, swap sur rendement total	26 705	4 479
6 000	29 juill. 2022	Genscript Biotech Corp, swap sur rendement total	28 061	4 650
7 000	29 juill. 2022	Grand Baoxin Auto Group Ltd, swap sur rendement total	667	(23)
5 000	29 juill. 2022	Great Wall Motor Company-H, swap sur rendement total	13 266	1 391
1 000	29 juill. 2022	Greentown China Holdings, swap sur rendement total	2 749	512
2 000	29 juill. 2022	Haichang Ocean Park Holdings, swap sur rendement total	2 617	306
2 000	29 juill. 2022	Harbin Electric Co Ltd-H, swap sur rendement total	750	29
1 000	29 juill. 2022	Hisense Home Appliances Gr-H, swap sur rendement total	1 492	150
700	29 juill. 2022	Hong Kong Exchanges & Clear, swap sur rendement total	44 418	4 830
266	29 juill. 2022	Hopson Development Holdings, swap sur rendement total	530	35
5 000	29 juill. 2022	Inke Ltd, swap sur rendement total	1 151	95
1 000	29 juill. 2022	Innocare Pharma Ltd, swap sur rendement total	2 200	414
3 000	29 juill. 2022	Innovent Biologics Inc, swap sur rendement total	17 212	4 821
164	29 juill. 2022	Jd.Com Inc – cat. A, swap sur rendement total	6 815	601
2 500	29 juill. 2022	Kingboard Holdings Ltd, swap sur rendement total	13 209	(2 249)
5 500	29 juill. 2022	Kingboard Laminates Hldg Ltd, swap sur rendement total	9 837	(2 035)
425	29 juill. 2022	Kingdee International Sftwr, swap sur rendement total	1 286	204
18 000	29 juill. 2022	Kunlun Energy Co Ltd, swap sur rendement total	19 641	(366)
20 000	29 juill. 2022	Lenovo Group Ltd, swap sur rendement total	24 099	(1 352)
7 000	29 juill. 2022	Li Ning Co Ltd, swap sur rendement total	83 658	12 963
1 723	29 juill. 2022	Man Wah Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 402	192
1 100	29 juill. 2022	Meituan Dianping- cat. B, swap sur rendement total	35 117	1 384
2 000	29 juill. 2022	Minth Group Ltd, swap sur rendement total	7 036	(167)
3 000	29 juill. 2022	Modern Dental Group Ltd, swap sur rendement total	1 558	49
6 870	29 juill. 2022	Nvc Lighting Holdings Ltd, swap sur rendement total	145	3
2 000	29 juill. 2022	Oriental Watch Holdings, swap sur rendement total	1 512	116
4	29 juill. 2022	Pacific Basin Shipping Ltd, swap sur rendement total	2	(1)
8 000	29 juill. 2022	Perfect Shape Medical Ltd, swap sur rendement total	5 550	(426)
1 500	29 juill. 2022	Ping An Insurance Group Co-H, swap sur rendement total	13 155	643
13 000	29 juill. 2022	Postal Savings Bank Of Chi-H, swap sur rendement total	13 314	853
4	29 juill. 2022	Powerlong Real Estate Holdin, swap sur rendement total	1	-
4 000	29 juill. 2022	Pw Medtech Group Ltd, swap sur rendement total	506	(19)
13 200	29 juill. 2022	Samsonite International Sa, swap sur rendement total	33 894	(5 030)
4 000	29 juill. 2022	Shanghai Fosun Pharmaceuti-H, swap sur rendement total	19 470	(2 130)
2 000	29 juill. 2022	Shanghai Jin Jiang Capital-H, swap sur rendement total	1 016	-
4 997	29 juill. 2022	Shimao Property Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 631	-
6 000	29 juill. 2022	Sinofert Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 186	(57)
1 000	29 juill. 2022	Sino-Ocean Group Holding Ltd, swap sur rendement total	224	(5)
2 001	29 juill. 2022	Sinotruk Hong Kong Ltd, swap sur rendement total	3 618	(47)
2 800	29 juill. 2022	Sisram Medical Ltd, swap sur rendement total	6 186	2 399
1 000	29 juill. 2022	Site International Holdings, swap sur rendement total	3 649	(1 002)
8 000	29 juill. 2022	Skyworth Group Ltd, swap sur rendement total	5 103	(172)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
500	29 juill. 2022	Stella International, swap sur rendement total	616	(20)
11 000	29 juill. 2022	Sunac China Holdings Ltd, swap sur rendement total	8 282	(2)
4 500	29 juill. 2022	Swire Pacific Ltd - cat. A, swap sur rendement total	34 583	(709)
609	29 juill. 2022	Tencent Holdings Ltd, swap sur rendement total	35 480	(812)
1 000	29 juill. 2022	Texhong Textile Group Ltd, swap sur rendement total	1 364	(32)
6	29 juill. 2022	Texwinca Holdings Ltd, swap sur rendement total	1	-
4 000	29 juill. 2022	Tianjin Development Hldgs Lt, swap sur rendement total	1 134	67
10 013	29 juill. 2022	Tianjin Port Dvlp Hlds Ltd, swap sur rendement total	1 169	103
30 000	29 juill. 2022	Tongda Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	745	54
1 000	29 juill. 2022	Towngas China Co Ltd, swap sur rendement total	712	67
2 000	29 juill. 2022	Truly International Holdings, swap sur rendement total	789	49
4 000	29 juill. 2022	Union Medical Healthcare Ltd, swap sur rendement total	5 208	(185)
8 000	29 juill. 2022	Viva China Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 644	223
5 000	29 juill. 2022	Weimob Inc, swap sur rendement total	4 406	531
4 996	29 juill. 2022	Weiqliao Textile Co Ltd-H, swap sur rendement total	1 528	(91)
1 000	29 juill. 2022	Xin Point Holdings Ltd, swap sur rendement total	463	93
16 000	29 juill. 2022	Xinyi Glass Holdings Ltd, swap sur rendement total	51 500	(956)
8 000	29 juill. 2022	Yadea Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	20 568	3 687
6 000	29 juill. 2022	Yashili International Holdin, swap sur rendement total	1 065	(17)
1 000	29 juill. 2022	Yuzhou Properties Co, swap sur rendement total	76	(1)
200	29 juill. 2022	Zhongan Online P&C Insuran-H, swap sur rendement total	840	(26)
4 000	29 juill. 2022	Zhongsheng Group Holdings, swap sur rendement total	36 948	314
1 000	29 juill. 2022	Zhou Hei Ya International Ho, swap sur rendement total	888	207
18 000	29 juill. 2022	Zijin Mining Group Co Ltd-H, swap sur rendement total	28 436	(3 115)
10 801	29 juill. 2022	Zte Corp-H, swap sur rendement total	32 457	1 764
				<u>55 816</u>
Yen japonais – taux moyen du financement à un jour offert à Tokyo (TONAR)				
100	29 juill. 2022	Ajinomoto Co Inc, swap sur rendement total	3 133	258
300	29 juill. 2022	Allied Telesis Holdings Kk, swap sur rendement total	276	(23)
100	29 juill. 2022	Ana Holdings Inc, swap sur rendement total	2 373	(39)
100	29 juill. 2022	Anest Iwata Corp, swap sur rendement total	860	34
100	29 juill. 2022	Asahi Broadcasting Group Hol, swap sur rendement total	622	(6)
200	29 juill. 2022	Asahi Kasei Corp, swap sur rendement total	1 967	(54)
300	29 juill. 2022	Asahi Yukizai Corp, swap sur rendement total	5 691	(230)
600	29 juill. 2022	Asia Pile Holdings Corp, swap sur rendement total	2 609	(18)
1 400	29 juill. 2022	Astellas Pharma Inc, swap sur rendement total	28 115	497
100	29 juill. 2022	Bandai Namco Holdings Inc, swap sur rendement total	9 095	(43)
200	29 juill. 2022	Bando Chemical Industries, swap sur rendement total	1 749	40
100	29 juill. 2022	Base Inc, swap sur rendement total	308	(35)
800	29 juill. 2022	Chiba Bank Ltd/The, swap sur rendement total	5 629	574
800	29 juill. 2022	Chiyoda Corp, swap sur rendement total	3 251	(141)
1 600	29 juill. 2022	Chubu Electric Power Co Inc, swap sur rendement total	20 752	1 121
100	29 juill. 2022	Chuetsu Pulp & Paper Co Ltd, swap sur rendement total	860	(2)
100	29 juill. 2022	Cti Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	2 462	114
100	29 juill. 2022	Dai Nippon Printing Co Ltd, swap sur rendement total	2 778	(4)
100	29 juill. 2022	Dai-Dan Co Ltd, swap sur rendement total	2 006	53
100	29 juill. 2022	Daihen Corp, swap sur rendement total	3 978	77
2 200	29 juill. 2022	Daiichi Sankyo Co Ltd, swap sur rendement total	71 795	928
100	29 juill. 2022	Daikin Industries Ltd, swap sur rendement total	20 652	1 072
200	29 juill. 2022	Daiwa Securities Group Inc, swap sur rendement total	1 151	(25)
100	29 juill. 2022	Dic Corp, swap sur rendement total	2 284	(98)
100	29 juill. 2022	Eisai Co Ltd, swap sur rendement total	5 436	370
200	29 juill. 2022	Fcc Co Ltd, swap sur rendement total	2 560	16
100	29 juill. 2022	Fujishoji Co Ltd, swap sur rendement total	810	5
200	29 juill. 2022	Furuno Electric Co Ltd, swap sur rendement total	1 918	-
100	29 juill. 2022	Godo Steel Ltd, swap sur rendement total	1 277	44
200	29 juill. 2022	Healios Kk, swap sur rendement total	676	(49)
200	29 juill. 2022	Hino Motors Ltd, swap sur rendement total	1 324	(22)
100	29 juill. 2022	Honda Tsushin Kogyo Co Ltd, swap sur rendement total	506	11
100	29 juill. 2022	H-One Co Ltd, swap sur rendement total	566	(3)
100	29 juill. 2022	Hoya Corp, swap sur rendement total	11 000	(1 530)
700	29 juill. 2022	Iino Kaiun Kaisha Ltd, swap sur rendement total	4 546	150
100	29 juill. 2022	Intelligent Wave Inc, swap sur rendement total	745	45
100	29 juill. 2022	Inui Global Logistics Co Ltd, swap sur rendement total	1 661	(50)
1 000	29 juill. 2022	Itochu Corp, swap sur rendement total	34 818	(265)
2 548	29 juill. 2022	Japan Tobacco Inc, swap sur rendement total	56 757	(1 150)
100	29 juill. 2022	Japan Transcity Corp, swap sur rendement total	467	(37)
100	29 juill. 2022	Jfe Holdings Inc, swap sur rendement total	1 358	(116)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	29 juill. 2022	Jsr Corp, swap sur rendement total	3 342	(478)
1 600	29 juill. 2022	Jvckenwood Corp, swap sur rendement total	2 689	(198)
100	29 juill. 2022	Kakiyasu Honten Co Ltd, swap sur rendement total	2 280	-
100	29 juill. 2022	Kamei Corp, swap sur rendement total	998	(6)
200	29 juill. 2022	Kansai Paint Co Ltd, swap sur rendement total	3 285	90
200	29 juill. 2022	Kikkoman Corp, swap sur rendement total	13 673	647
100	29 juill. 2022	Kyowa Leather Cloth Co Ltd, swap sur rendement total	537	(16)
100	29 juill. 2022	Lec Inc, swap sur rendement total	608	(22)
100	29 juill. 2022	Linical Co Ltd, swap sur rendement total	765	(31)
2 200	29 juill. 2022	Mazda Motor Corp, swap sur rendement total	23 187	437
100	29 juill. 2022	Micronics Japan Co Ltd, swap sur rendement total	1 176	(225)
100	29 juill. 2022	Misumi Group Inc, swap sur rendement total	2 716	(62)
200	29 juill. 2022	Mitsubishi Gas Chemical Co, swap sur rendement total	3 713	(266)
100	29 juill. 2022	Mitsubishi Logistics Corp, swap sur rendement total	3 081	195
300	29 juill. 2022	Mitsui Osk Lines Ltd, swap sur rendement total	8 845	(934)
100	29 juill. 2022	Moresco Corp, swap sur rendement total	1 183	5
200	29 juill. 2022	Nakabayashi Co Ltd, swap sur rendement total	946	(10)
200	29 juill. 2022	New Japan Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	486	6
200	29 juill. 2022	Nidec Corp, swap sur rendement total	15 914	60
200	29 juill. 2022	Nihon M&A Center Inc, swap sur rendement total	2 740	(96)
100	29 juill. 2022	Nikon Corp, swap sur rendement total	1 490	(35)
200	29 juill. 2022	Nippon Paper Industries Co L, swap sur rendement total	1 827	2
800	29 juill. 2022	Nippon Steel Corp, swap sur rendement total	14 425	(2 485)
200	29 juill. 2022	Nishi-Nippon Financial Holdi, swap sur rendement total	1 424	(8)
400	29 juill. 2022	Nissan Chemical Corp, swap sur rendement total	23 738	(3 882)
300	29 juill. 2022	Nissan Tokyo Sales Holdings, swap sur rendement total	749	73
200	29 juill. 2022	Nisshin Fudosan Co Ltd, swap sur rendement total	836	(8)
51	29 juill. 2022	Nitta Corp, swap sur rendement total	1 336	(17)
100	29 juill. 2022	Nof Corp, swap sur rendement total	4 776	95
1 100	29 juill. 2022	Obayashi Corp, swap sur rendement total	10 288	568
300	29 juill. 2022	Odakyu Electric Railway Co, swap sur rendement total	5 199	284
200	29 juill. 2022	Oriental Land Co Ltd, swap sur rendement total	35 929	(525)
7	29 juill. 2022	Orix Jreit Inc, swap sur rendement total	12 243	(48)
100	29 juill. 2022	Otsuka Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	4 575	330
200	29 juill. 2022	Pigeon Corp, swap sur rendement total	3 534	63
1 200	29 juill. 2022	Rakuten Inc, swap sur rendement total	6 973	(662)
400	29 juill. 2022	Rasa Industries Ltd, swap sur rendement total	7 205	(208)
100	29 juill. 2022	Recruit Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	3 793	(684)
300	29 juill. 2022	Renaissance Inc, swap sur rendement total	2 717	74
100	29 juill. 2022	Renesas Electronics Corp, swap sur rendement total	1 171	(255)
500	29 juill. 2022	Resona Holdings Inc, swap sur rendement total	2 412	32
100	29 juill. 2022	Ricoh Leasing Co Ltd, swap sur rendement total	3 319	46
100	29 juill. 2022	Rokko Butter Co Ltd, swap sur rendement total	1 332	34
100	29 juill. 2022	Ryobi Ltd, swap sur rendement total	984	(59)
200	29 juill. 2022	Sagami Holdings Corp, swap sur rendement total	2 155	(9)
100	29 juill. 2022	Sakata Inx Corp, swap sur rendement total	868	1
100	29 juill. 2022	Sankyo Frontier Co Ltd, swap sur rendement total	3 807	(92)
500	29 juill. 2022	Sega Sammy Holdings Inc, swap sur rendement total	10 340	(1 022)
200	29 juill. 2022	Sekisui Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	3 526	11
100	29 juill. 2022	Shimano Inc, swap sur rendement total	21 763	438
100	29 juill. 2022	Shimizu Corp, swap sur rendement total	712	23
200	29 juill. 2022	Shin-Etsu Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	29 055	(5 458)
200	29 juill. 2022	Shiseido Co Ltd, swap sur rendement total	10 342	288
400	29 juill. 2022	Shizuoka Bank Ltd/The, swap sur rendement total	3 095	155
100	29 juill. 2022	Smk Corp, swap sur rendement total	1 980	(79)
100	29 juill. 2022	Sompo Holdings Inc, swap sur rendement total	5 681	84
800	29 juill. 2022	Sony Group Corp, swap sur rendement total	84 278	(7 614)
200	29 juill. 2022	Stanley Electric Co Ltd, swap sur rendement total	4 231	(52)
200	29 juill. 2022	Stemrim Inc, swap sur rendement total	1 333	(49)
1 467	29 juill. 2022	Subaru Corp, swap sur rendement total	33 590	2 566
700	29 juill. 2022	Sumitomo Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	3 529	(176)
300	29 juill. 2022	Suruga Bank Ltd, swap sur rendement total	1 045	37
1 000	29 juill. 2022	Suzuki Motor Corp, swap sur rendement total	40 487	4 118
200	29 juill. 2022	T&D Holdings Inc, swap sur rendement total	3 084	277
100	29 juill. 2022	T&K Toka Co Ltd, swap sur rendement total	767	(18)
300	29 juill. 2022	Taiheiyu Cement Corp, swap sur rendement total	5 768	232
200	29 juill. 2022	Takaoka Toko Co Ltd, swap sur rendement total	3 217	(160)
100	29 juill. 2022	Takara Holdings Inc, swap sur rendement total	954	43

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
900	29 juill. 2022	Tokai Carbon Co Ltd, swap sur rendement total	8 836	(632)
500	29 juill. 2022	Tokuyama Corp, swap sur rendement total	8 194	247
300	29 juill. 2022	Tokyo Rope Mfg Co Ltd, swap sur rendement total	2 646	25
600	29 juill. 2022	Tokyo Steel Mfg Co Ltd, swap sur rendement total	8 523	(90)
100	29 juill. 2022	Toli Corp, swap sur rendement total	194	(3)
100	29 juill. 2022	Tomony Holdings Inc, swap sur rendement total	296	7
200	29 juill. 2022	Topre Corp, swap sur rendement total	1 890	(74)
1 400	29 juill. 2022	Toray Industries Inc, swap sur rendement total	10 119	1 014
100	29 juill. 2022	Tosoh Corp, swap sur rendement total	1 600	(163)
1 200	29 juill. 2022	Yamabiko Corp, swap sur rendement total	13 046	(438)
200	29 juill. 2022	Yamaha Corp, swap sur rendement total	10 634	535
200	29 juill. 2022	Yokogawa Electric Corp, swap sur rendement total	4 256	(132)
400	29 juill. 2022	Yokohama Rubber Co Ltd, swap sur rendement total	6 977	464
200	29 juill. 2022	Zeon Corp, swap sur rendement total	2 495	(105)
				(12 511)
Dollar néo-zélandais – taux du marché des acceptations bancaires (BKBM) à 1 mois				
619	29 juill. 2022	A2 Milk Co Ltd, swap sur rendement total	2 448	(100)
108	29 juill. 2022	Contact Energy Ltd, swap sur rendement total	631	(13)
102	29 juill. 2022	Ebos Group Ltd, swap sur rendement total	3 191	(120)
751	29 juill. 2022	Infratil Ltd, swap sur rendement total	4 626	(45)
				(278)
Dollar de Singapour – taux interbancaire offert à Singapour (SIBOR) à 1 mois				
800	29 juill. 2022	Boustead Singapore Ltd, swap sur rendement total	708	(4)
400	29 juill. 2022	Brc Asia Ltd, swap sur rendement total	664	6
1 656	29 juill. 2022	China Sunline Chemical Hldgs, swap sur rendement total	675	(16)
1 300	29 juill. 2022	DBS Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	35 763	(1 202)
200	29 juill. 2022	First Resources Ltd, swap sur rendement total	302	(56)
1 400	29 juill. 2022	Golden Agri-Resources Ltd, swap sur rendement total	324	(46)
1 000	29 juill. 2022	Hong Fok Corp Ltd, swap sur rendement total	894	9
1 385	29 juill. 2022	Hmetgroup Ltd, swap sur rendement total	995	63
4 400	29 juill. 2022	Japfa Ltd, swap sur rendement total	2 427	(64)
2 700	29 juill. 2022	Oversea-Chinese Banking Corp, swap sur rendement total	28 505	(653)
15 797	29 juill. 2022	Riverstone Holdings Ltd, swap sur rendement total	10 835	62
14 196	29 juill. 2022	Sheng Siong Group Ltd, swap sur rendement total	20 000	(221)
39 119	29 juill. 2022	Thomson Medical Group Ltd, swap sur rendement total	2 864	(76)
15 400	29 juill. 2022	Yanlord Land Group Ltd, swap sur rendement total	15 131	(873)
				(3 071)
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
118	29 juill. 2022	Absa Group Ltd, swap sur rendement total	1 436	(60)
1 055	29 juill. 2022	Alexander Forbes Group Holdi, swap sur rendement total	396	41
34	29 juill. 2022	Anglo American Platinum Ltd, swap sur rendement total	3 815	(789)
2 968	29 juill. 2022	Arrowhead Properties Ltd-B, swap sur rendement total	710	(37)
233	29 juill. 2022	Avi Ltd, swap sur rendement total	1 206	(10)
20	29 juill. 2022	Bidvest Group Ltd, swap sur rendement total	330	(13)
6	29 juill. 2022	Capitec Bank Holdings Ltd, swap sur rendement total	936	(134)
46	29 juill. 2022	Clicks Group Ltd, swap sur rendement total	996	(60)
449	29 juill. 2022	Discovery Ltd, swap sur rendement total	4 529	(575)
510	29 juill. 2022	Exxaro Resources Ltd, swap sur rendement total	7 958	(964)
1 590	29 juill. 2022	Firststrand Ltd, swap sur rendement total	7 809	(1 082)
100	29 juill. 2022	Hosken Cons Investments Ltd, swap sur rendement total	1 215	(104)
100	29 juill. 2022	Hudaco Industries Ltd, swap sur rendement total	1 173	(56)
150	29 juill. 2022	Lewis Group Ltd, swap sur rendement total	579	(38)
339	29 juill. 2022	Mpact Ltd, swap sur rendement total	827	(57)
1 017	29 juill. 2022	Mtn Group Ltd, swap sur rendement total	10 574	(2 235)
43	29 juill. 2022	Multichoice Group Ltd, swap sur rendement total	392	(3)
59	29 juill. 2022	Nedbank Group Ltd, swap sur rendement total	963	(130)
837	29 juill. 2022	Netcare Ltd, swap sur rendement total	940	(72)
217	29 juill. 2022	Northam Platinum Ltd, swap sur rendement total	2 927	(298)
28	29 juill. 2022	Standard Bank Group Ltd, swap sur rendement total	342	(27)
626	29 juill. 2022	Sun International Ltd, swap sur rendement total	1 418	(123)
352	29 juill. 2022	Tiger Brands Ltd, swap sur rendement total	4 026	81
418	29 juill. 2022	Tsogo Sun Gaming Ltd, swap sur rendement total	343	(83)
1 391	29 juill. 2022	Vodacom Group Ltd, swap sur rendement total	14 362	(1 772)
				(8 600)
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
1 374	29 juill. 2022	Addtech Ab- actions, B, swap sur rendement total	23 073	(5 453)
420	29 juill. 2022	Alfa Laval Ab, swap sur rendement total	13 038	(716)
14	29 juill. 2022	Assa Abloy Ab-B, swap sur rendement total	383	(27)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
138	29 juill. 2022	Avanza Bank Holding Ab, swap sur rendement total	2 982	(923)
68	29 juill. 2022	Bioarctic Ab, swap sur rendement total	663	38
111	29 juill. 2022	Bonesupport Holding Ab, swap sur rendement total	986	68
467	29 juill. 2022	Catella Ab, swap sur rendement total	1 987	(387)
25	29 juill. 2022	Eastnine Ab, swap sur rendement total	271	(39)
600	29 juill. 2022	Elekta Ab- actions, B, swap sur rendement total	5 337	(193)
1 269	29 juill. 2022	Embracer Group Ab, swap sur rendement total	12 458	(799)
117	29 juill. 2022	Epiroc Ab-A, swap sur rendement total	2 326	(459)
2 146	29 juill. 2022	Ericsson Lm- actions, B, swap sur rendement total	20 604	(487)
128	29 juill. 2022	Evolution Gaming Group, swap sur rendement total	14 986	(158)
100	29 juill. 2022	Getinge Ab- actions, B, swap sur rendement total	2 976	(146)
858	29 juill. 2022	Hennes & Mauritz Ab- actions, B, swap sur rendement total	13 194	(1 194)
765	29 juill. 2022	Hexagon Ab- actions, B, swap sur rendement total	10 232	(494)
460	29 juill. 2022	Hexatronic Group Ab, swap sur rendement total	4 412	(720)
89	29 juill. 2022	Holmen Ab- actions, B, swap sur rendement total	4 648	(441)
85	29 juill. 2022	Humana Ab, swap sur rendement total	477	(62)
186	29 juill. 2022	Intrum Ab, swap sur rendement total	4 569	(604)
951	29 juill. 2022	Lagercrantz Group Ab- actions, B, swap sur rendement total	9 918	(1 500)
16	29 juill. 2022	Lifco Ab- actions, B, swap sur rendement total	331	(74)
519	29 juill. 2022	Medicover Ab - actions, B, swap sur rendement total	8 709	(2 666)
197	29 juill. 2022	Millicom Intl Cellular-Sdr, swap sur rendement total	3 621	(292)
779	29 juill. 2022	Nibe Industrier Ab- actions, B, swap sur rendement total	7 531	(635)
50	29 juill. 2022	Np3 Fastigheter Ab, swap sur rendement total	1 271	(434)
133	29 juill. 2022	Proact It Group Ab, swap sur rendement total	1 142	(74)
5	29 juill. 2022	Sagax Ab-B, swap sur rendement total	119	(10)
3 501	29 juill. 2022	Samhallsbyggnadsbolaget I No, swap sur rendement total	7 507	(1 767)
608	29 juill. 2022	Sandvik Ab, swap sur rendement total	12 693	(2 549)
657	29 juill. 2022	Scandic Hotels Group Ab, swap sur rendement total	3 265	(140)
22	29 juill. 2022	Securitas Ab- actions, B, swap sur rendement total	244	(3)
128	29 juill. 2022	Skf Ab- actions, B, swap sur rendement total	2 425	(289)
500	29 juill. 2022	Systemair Ab, swap sur rendement total	3 134	(775)
35	29 juill. 2022	Thule Group Ab/The, swap sur rendement total	1 107	(156)
83	29 juill. 2022	Tobii Ab, swap sur rendement total	185	(63)
73	29 juill. 2022	Viaplay Group Ab-B, swap sur rendement total	1 929	(390)
				(25 013)
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
7	29 juill. 2022	Bossard Holding Ag- actions ord., A, swap sur rendement total	1 743	(212)
9	29 juill. 2022	Flughafen Zurich Ag- actions ord., swap sur rendement total	1 750	(172)
164	29 juill. 2022	Holcim Ltd, swap sur rendement total	9 027	(1 251)
4	29 juill. 2022	Lem Holding Sa- actions ord., swap sur rendement total	9 831	285
13	29 juill. 2022	Lonza Group Ag- actions ord., swap sur rendement total	8 916	(759)
58	29 juill. 2022	Nestle Sa- actions ord., swap sur rendement total	8 709	185
38	29 juill. 2022	Roche Holding Ag-Genusschein, swap sur rendement total	16 310	(94)
17	29 juill. 2022	Sensirion Holding Ag, swap sur rendement total	2 217	68
3	29 juill. 2022	Sonova Holding Ag- actions ord., swap sur rendement total	1 229	(10)
24	29 juill. 2022	Swiss Life Holding Ag- actions ord., swap sur rendement total	15 037	(1 135)
74	29 juill. 2022	Swissquote Group Holding- actions ord., swap sur rendement total	9 657	(2 122)
1	29 juill. 2022	Tecan Group Ag- actions ord., swap sur rendement total	374	(45)
18	29 juill. 2022	U-Blox Holding Ag, swap sur rendement total	2 345	149
1 321	29 juill. 2022	Ubs Group Ag- actions ord., swap sur rendement total	27 393	(4 319)
60	29 juill. 2022	Zurich Insurance Group Ag, swap sur rendement total	33 567	(1 455)
				(10 887)
Dollar américain – taux interbancaire offert à Londres (ICE LIBOR) à 1 mois				
200	29 juill. 2022	360 Security Technology In-A, swap sur rendement total	328	7
3 630	29 juill. 2022	Aapico Hitech Pcl, swap sur rendement total	2 905	(379)
391	29 juill. 2022	Ablbio Lnc, swap sur rendement total	9 784	(44)
69	29 juill. 2022	Adani Green Energy Ltd, swap sur rendement total	2 174	61
33	29 juill. 2022	Adani Transmission Ltd, swap sur rendement total	1 333	204
1 000	29 juill. 2022	Aerospace Industrial Develop, swap sur rendement total	1 403	(76)
1 500	29 juill. 2022	Aes Brasil Energia Sa, swap sur rendement total	3 941	(522)
55	29 juill. 2022	Afreecatv Co Ltd, swap sur rendement total	4 375	(1 768)
1 002	29 juill. 2022	Agi Greenpac Ltd, swap sur rendement total	3 326	(488)
219	29 juill. 2022	Ajanta Pharma Ltd, swap sur rendement total	4 418	254
72 823	29 juill. 2022	Alfa S.A.B.-A, swap sur rendement total	66 703	(5 551)
171	29 juill. 2022	Alkem Laboratories Ltd, swap sur rendement total	8 371	(589)
154	29 juill. 2022	Allcargo Logistics Ltd, swap sur rendement total	661	(158)
875	29 juill. 2022	Alpargatas Sa - actions priv., swap sur rendement total	4 128	(986)
900	29 juill. 2022	Alpek Sa De Cv, swap sur rendement total	1 604	62

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
200	29 juill. 2022	Alsea Sab De Cv, swap sur rendement total	489	(65)
1 000	29 juill. 2022	Ammb Holdings Bhd, swap sur rendement total	1 106	4
183	29 juill. 2022	Amorepacific Corp - swap sur rendement total	23 623	(6 204)
939	29 juill. 2022	Amtran Technology Co Ltd, swap sur rendement total	515	(30)
8 120	29 juill. 2022	Anhui Guangxin Agrochemica-A, swap sur rendement total	44 007	3 821
4 100	29 juill. 2022	Arca Continental Sab De Cv, swap sur rendement total	34 845	(211)
11 800	29 juill. 2022	Asia Plus Group Holdings Pcl, swap sur rendement total	1 354	(96)
100	29 juill. 2022	Atacadao Sa, swap sur rendement total	411	(136)
1 400	29 juill. 2022	Auren Energia Sa - On, swap sur rendement total	4 700	(617)
26	29 juill. 2022	Avenue Supermarts Ltd, swap sur rendement total	1 446	(273)
4 000	29 juill. 2022	Azul Sa, swap sur rendement total	12 205	(9 707)
2 900	29 juill. 2022	B3 Sa-Brasil Bolsa Balcao, swap sur rendement total	7 877	(296)
48 014	29 juill. 2022	Bajaj Hindusthan Sugar Ltd, swap sur rendement total	10 151	(1 076)
6 500	29 juill. 2022	Banco Btg Pactual Sa- parts, swap sur rendement total	35 743	(8 495)
200	29 juill. 2022	Banco Del Bajio Sa, swap sur rendement total	517	(120)
7 100	29 juill. 2022	Banco Do Brasil Sa - swap sur rendement total	58 414	(8 728)
100	29 juill. 2022	Banco Estado Rio Gran- actions priv. B - swap sur rendement total	221	(38)
100	29 juill. 2022	Bangkok Bank Public Co Ltd, swap sur rendement total	486	(9)
700	29 juill. 2022	Bangkok Chain Hospital Pcl, swap sur rendement total	478	(58)
1 600	29 juill. 2022	Bank Of Beijing Co Ltd -A, swap sur rendement total	1 399	28
100	29 juill. 2022	Bank Of Chengdu Co Ltd-A, swap sur rendement total	319	23
1 400	29 juill. 2022	Bank Of Communications Co-A, swap sur rendement total	1 342	11
2 500	29 juill. 2022	Bank Of Jiangsu Co Ltd-A, swap sur rendement total	3 427	319
200	29 juill. 2022	Bank Of Nanjing Co Ltd -A, swap sur rendement total	401	33
400	29 juill. 2022	Bank Of Shanghai Co Ltd-A, swap sur rendement total	504	8
1 660	29 juill. 2022	Bank Of Suzhou Co Ltd-A, swap sur rendement total	1 950	26
8 900	29 juill. 2022	Bb Seguridade Participacoes, swap sur rendement total	56 947	(8 304)
4 200	29 juill. 2022	Beijing Capital Co Ltd-A, swap sur rendement total	2 345	(33)
500	29 juill. 2022	Beijing Geoenviron Enginee-A, swap sur rendement total	1 110	(685)
216	29 juill. 2022	Bharti Airtel Ltd, swap sur rendement total	2 415	(101)
1 700	29 juill. 2022	Bk Brasil Operacao E Assesso, swap sur rendement total	2 330	(1 111)
4	29 juill. 2022	Blue Dart Express Ltd, swap sur rendement total	510	11
40	29 juill. 2022	Bnk Financial Group Inc, swap sur rendement total	267	(17)
800	29 juill. 2022	Bright Dairy & Food Co Ltd-A, swap sur rendement total	1 945	20
1 000	29 juill. 2022	Bumrungrad Hospital Pcl, swap sur rendement total	6 541	(40)
100	29 juill. 2022	By-Health Co Ltd-A, swap sur rendement total	417	32
70 308	29 juill. 2022	Cal-Comp Electronics Thailan, swap sur rendement total	6 011	(614)
274	29 juill. 2022	Cap Sa, swap sur rendement total	3 184	(1 346)
150	29 juill. 2022	Castrol India Ltd, swap sur rendement total	260	(11)
1 200	29 juill. 2022	Ccr Sa, swap sur rendement total	3 718	(638)
100	29 juill. 2022	Cell Biotech Co Ltd, swap sur rendement total	1 321	(228)
841	29 juill. 2022	Celsia Sa Esp, swap sur rendement total	993	(269)
200	29 juill. 2022	Central China Land Media-A, swap sur rendement total	287	(29)
23	29 juill. 2022	Cesc Ventures Ltd, swap sur rendement total	185	(10)
2 560	29 juill. 2022	Chalet Hotels Ltd, swap sur rendement total	13 151	497
1 000	29 juill. 2022	Champion Building Materials, swap sur rendement total	477	(39)
15 000	29 juill. 2022	Chengdu Hongqi Chain Co Lt-A, swap sur rendement total	14 584	708
8 100	29 juill. 2022	Chengdu Kanghong Pharmaceu-A, swap sur rendement total	23 298	39
900	29 juill. 2022	China Electric Manufacturing, swap sur rendement total	779	47
200	29 juill. 2022	China Pacific Insurance Gr-A, swap sur rendement total	906	83
1	29 juill. 2022	China Resources Sanjiu Med-A, swap sur rendement total	9	1
48 500	29 juill. 2022	China State Construction -A, swap sur rendement total	49 676	(2 033)
600	29 juill. 2022	China United Network-A, swap sur rendement total	400	(52)
2 600	29 juill. 2022	Chularat Hospital Pcl, swap sur rendement total	352	(13)
125	29 juill. 2022	Cia De Gas De Sao Paulo-Pr A, swap sur rendement total	3 869	(380)
300	29 juill. 2022	Cia De Saneamento Do Pa- parts, swap sur rendement total	1 349	(237)
6 144	29 juill. 2022	Cia Energetica Minas Ger- actions priv., swap sur rendement total	15 719	(3 806)
700	29 juill. 2022	Cia Paranaense De Energi-actions priv., B, swap sur rendement total	1 178	(227)
201 373	29 juill. 2022	Cia Sud Americana De Vapores, swap sur rendement total	23 289	(12 005)
56	29 juill. 2022	Com2Us Corp, swap sur rendement total	3 987	(1 148)
434	29 juill. 2022	Commercial Intl Bank- CIAE, actions ord., swap sur rendement total	929	(177)
300	29 juill. 2022	Cp All Pcl, swap sur rendement total	658	(92)
100	29 juill. 2022	Cpfl Energia Sa, swap sur rendement total	761	(164)
27	29 juill. 2022	Ctc Bio Inc, swap sur rendement total	212	(71)
20	29 juill. 2022	Cuckoo Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	319	(55)
312	29 juill. 2022	Daehan Steel Co Ltd - swap sur rendement total	4 864	(1 745)
170	29 juill. 2022	Daewon Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	2 625	(426)
24	29 juill. 2022	Daewoo Shipbuilding & Marine, swap sur rendement total	572	20

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
2	29 juill. 2022	Daewoong Pharmaceutical Co - swap sur rendement total	351	(9)
524	29 juill. 2022	Dalmia Bharat Sugar & Indust, swap sur rendement total	2 662	(691)
100	29 juill. 2022	Dashenlin Pharmaceutical G-A, swap sur rendement total	603	(33)
4	29 juill. 2022	Dentium Co Ltd, swap sur rendement total	340	18
33	29 juill. 2022	Dgb Financial Group Inc - swap sur rendement total	249	(22)
1 400	29 juill. 2022	Diamond Building Products Pc, swap sur rendement total	376	(20)
24 364	29 juill. 2022	Dish Tv India Ltd, swap sur rendement total	5 151	(181)
133	29 juill. 2022	Dongbu Steel Co Ltd, swap sur rendement total	1 756	(625)
98	29 juill. 2022	Dongkuk Steel Mill Co Ltd - swap sur rendement total	1 250	(569)
2 670	29 juill. 2022	Dongwon Development Co - swap sur rendement total	11 003	(2 586)
17	29 juill. 2022	Doosan Bobcat Inc, swap sur rendement total	488	(96)
4	29 juill. 2022	Doosan Corp, swap sur rendement total	278	(47)
742	29 juill. 2022	Duksan Hi-Metal Co Ltd, swap sur rendement total	4 819	(2 420)
1 000	29 juill. 2022	E.Sun Financial Holding Co, swap sur rendement total	1 258	(104)
70	29 juill. 2022	Easy Bio Inc, swap sur rendement total	260	(102)
341	29 juill. 2022	Eclerx Services Ltd, swap sur rendement total	10 690	(843)
199	29 juill. 2022	Ecopro Co Ltd, swap sur rendement total	14 148	(3 005)
600	29 juill. 2022	Ecorodovias Infra E Log Sa, swap sur rendement total	843	(321)
1 164	29 juill. 2022	Embassy Office Parks Reit, swap sur rendement total	7 111	(533)
75	29 juill. 2022	Empresa Nacional De Telecom, swap sur rendement total	302	(60)
500	29 juill. 2022	Enn Ecological Holdings Co-A, swap sur rendement total	1 790	194
1 500	29 juill. 2022	Equatorial Energia Sa - actions ord. - swap sur rendement total	8 444	(1 161)
372	29 juill. 2022	Eris Lifesciences Ltd, swap sur rendement total	4 052	(82)
200	29 juill. 2022	Eucatex Sa Industria- actions priv., swap sur rendement total	392	(169)
1 000	29 juill. 2022	Eva Airways Corp, swap sur rendement total	1 373	(145)
177	29 juill. 2022	Fdc Ltd, swap sur rendement total	690	(35)
600	29 juill. 2022	Fgv Holdings Bhd, swap sur rendement total	256	(46)
189	29 juill. 2022	Fiem Industries Ltd, swap sur rendement total	4 088	905
45	29 juill. 2022	Finolex Cables Ltd, swap sur rendement total	276	(1)
188	29 juill. 2022	Firstec Co Ltd, swap sur rendement total	653	(200)
400	29 juill. 2022	Fleury Sa - swap sur rendement total	1 607	204
84	29 juill. 2022	Foosung Co Ltd, swap sur rendement total	1 481	(544)
5 596	29 juill. 2022	Forth Smart Service Pcl, swap sur rendement total	3 824	(482)
593	29 juill. 2022	Fortis Healthcare Ltd, swap sur rendement total	2 324	(25)
200	29 juill. 2022	Foxconn Industrial Interne-A, swap sur rendement total	379	14
181	29 juill. 2022	Genie Music Corp, swap sur rendement total	656	(318)
26 400	29 juill. 2022	Gentera Sab De Cv, swap sur rendement total	27 280	1 048
200	29 juill. 2022	Genting Plantations Bhd, swap sur rendement total	377	(70)
3 787	29 juill. 2022	Geojit Financial Services Lt, swap sur rendement total	3 292	135
1 327	29 juill. 2022	Gfl Ltd, swap sur rendement total	1 446	(22)
251	29 juill. 2022	Glaxosmithkline Pharmaceutic, swap sur rendement total	6 145	(169)
4 700	29 juill. 2022	Globetronics Technology Bhd, swap sur rendement total	1 650	(152)
1 218	29 juill. 2022	Gmr Infrastructure Ltd, swap sur rendement total	678	(153)
61	29 juill. 2022	Goodyear India Ltd, swap sur rendement total	1 030	51
420	29 juill. 2022	Greenland Holdings Corp Lt-A, swap sur rendement total	320	8
510	29 juill. 2022	Grindwell Norton Ltd, swap sur rendement total	14 014	(532)
50	29 juill. 2022	Gruma S.A.B.- actions, B, swap sur rendement total	714	(1)
600	29 juill. 2022	Grupo Bimbo Sab- série A, swap sur rendement total	2 516	(26)
600	29 juill. 2022	Grupo Comercial Chedraui Sa, swap sur rendement total	2 094	(43)
482	29 juill. 2022	Grupo Energia Bogota Sa Esp, swap sur rendement total	299	(100)
1 800	29 juill. 2022	Grupo Financiero Inbursa-O, swap sur rendement total	3 697	(890)
42	29 juill. 2022	Grupo Nutresa Sa, swap sur rendement total	517	(16)
78	29 juill. 2022	Gs Engineering & Construct, swap sur rendement total	2 444	(107)
200	29 juill. 2022	Guangdong Ly Intelligent M-A, swap sur rendement total	193	9
5 100	29 juill. 2022	Guangxi Wuzhou Zhongheng G-A, swap sur rendement total	2 897	(705)
2 341	29 juill. 2022	Gujarat Ambuja Exports Ltd, swap sur rendement total	10 805	(2 525)
4 343	29 juill. 2022	Gujarat State Fert & Chemica, swap sur rendement total	9 359	(2 689)
200	29 juill. 2022	Guosen Securities Co Ltd-A, swap sur rendement total	368	9
200	29 juill. 2022	Guotai Junan Securities Co-A, swap sur rendement total	585	24
202	29 juill. 2022	Hana Financial Group - swap sur rendement total	7 893	(289)
1 400	29 juill. 2022	Hangzhou Tigermed Consulti-A, swap sur rendement total	30 849	7 552
72	29 juill. 2022	Hanil Cement Co Ltd - swap sur rendement total	779	(194)
26	29 juill. 2022	Hankook Tire & Technology Co, swap sur rendement total	851	(31)
23	29 juill. 2022	Hansol Paper Co Ltd, swap sur rendement total	287	(61)
120	29 juill. 2022	Hanwha Aerospace Co Ltd - swap sur rendement total	5 803	(832)
686	29 juill. 2022	Hanwha Corporation - swap sur rendement total	17 608	(3 042)
118	29 juill. 2022	Hanwha General Insurance Co - swap sur rendement total	493	(38)
7 288	29 juill. 2022	Hanwha Life Insurance Co Ltd, swap sur rendement total	16 102	(3 839)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
117	29 juill. 2022	Hanwha Systems Co Ltd, swap sur rendement total	1 621	(314)
254	29 juill. 2022	Healthcare Global Enterprise, swap sur rendement total	1 153	(34)
400	29 juill. 2022	Henan Lingrui Pharmaceutic-A, swap sur rendement total	965	10
175	29 juill. 2022	Hg Infra Engineering Ltd, swap sur rendement total	1 485	(174)
19	29 juill. 2022	Hil Ltd, swap sur rendement total	1 102	(94)
20	29 juill. 2022	Hindustan Aeronautics Ltd, swap sur rendement total	578	(33)
511	29 juill. 2022	Hitejinro Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	5 810	(1 468)
589	29 juill. 2022	Home Center Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	684	(259)
1 073	29 juill. 2022	Hon Hai Precision- CIAE, actions ord. S, swap sur rendement total	10 132	(520)
1 700	29 juill. 2022	Hong Leong Bank Berhad, swap sur rendement total	10 177	(393)
1 000	29 juill. 2022	Hua Eng Wire & Cable Co Ltd, swap sur rendement total	733	(117)
200	29 juill. 2022	Huafon Chemical Co Ltd -A, swap sur rendement total	325	5
200	29 juill. 2022	Huatai Securities Co Ltd-A, swap sur rendement total	547	31
300	29 juill. 2022	Huaxia Bank Co Ltd-A, swap sur rendement total	301	(17)
50	29 juill. 2022	Hugel Inc, swap sur rendement total	5 223	(94)
52	29 juill. 2022	Hwasung Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	873	(446)
600	29 juill. 2022	Hypera Sa, swap sur rendement total	5 626	(81)
250	29 juill. 2022	Hyundai Engineering & Const, swap sur rendement total	10 265	(1 028)
166	29 juill. 2022	Hyundai Marine & Fire Ins Co, swap sur rendement total	5 102	(325)
188	29 juill. 2022	Hyundai Mipo Dockyard, swap sur rendement total	17 006	606
11	29 juill. 2022	Hyundai Mobis Co Ltd, swap sur rendement total	2 174	(47)
9	29 juill. 2022	Hyundai Steel Co, swap sur rendement total	287	(99)
400	29 juill. 2022	Ihh Healthcare Bhd, swap sur rendement total	755	(35)
550	29 juill. 2022	Ihq Inc, swap sur rendement total	392	(188)
151	29 juill. 2022	Il Dong Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	2 999	(2 042)
237	29 juill. 2022	Il Dong Pharmaceutical Co Lt, swap sur rendement total	7 260	(3 051)
2 299	29 juill. 2022	Inari Amertron Bhd, swap sur rendement total	1 791	(113)
11	29 juill. 2022	Inbody Co Ltd, swap sur rendement total	261	(58)
4 271	29 juill. 2022	Indian Energy Exchange Ltd, swap sur rendement total	11 069	(2 764)
146	29 juill. 2022	Indoco Remedies Ltd, swap sur rendement total	875	17
2 000	29 juill. 2022	Infortrend Technology Inc, swap sur rendement total	1 275	(113)
1 700	29 juill. 2022	Inner Mongolia Yili Indus-A, swap sur rendement total	12 748	40
200	29 juill. 2022	Inspur Software Co Ltd-A, swap sur rendement total	546	117
131	29 juill. 2022	Interconexion Electrica Sa, swap sur rendement total	834	(233)
52	29 juill. 2022	Interflex Co Ltd, swap sur rendement total	357	(22)
500	29 juill. 2022	Ioi Corp Bhd, swap sur rendement total	562	(72)
2 600	29 juill. 2022	Ioi Properties Group Bhd, swap sur rendement total	761	(13)
111	29 juill. 2022	Isu Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	1 664	(90)
64	29 juill. 2022	It'S Skin Co Ltc - swap sur rendement total	1 055	(390)
94	29 juill. 2022	J.B. Chemicals & Pharma Ltd, swap sur rendement total	2 413	(129)
571	29 juill. 2022	J.Kumar Infraprojects Ltd, swap sur rendement total	2 662	341
2 315	29 juill. 2022	Jagran Prakashan Ltd, swap sur rendement total	1 882	(412)
9 000	29 juill. 2022	Jasmine Intl Public Co Ltd, swap sur rendement total	1 131	(55)
1 100	29 juill. 2022	Jbs Sa, swap sur rendement total	8 565	(520)
22	29 juill. 2022	Jet Airways India Ltd, swap sur rendement total	40	-
2 000	29 juill. 2022	Jiangsu Jiangnan Water Co-A, swap sur rendement total	3 019	590
4 300	29 juill. 2022	Jiangsu King'S Luck Brewer-A, swap sur rendement total	42 221	3 749
300	29 juill. 2022	Jiangsu Yangnong Chemical -A, swap sur rendement total	7 698	(236)
100	29 juill. 2022	Jiangsu Zhongnan Construct-A, swap sur rendement total	59	(4)
1	29 juill. 2022	Jin Air Co Ltd, swap sur rendement total	14	(5)
7 998	29 juill. 2022	Jindal Stainless Ltd, swap sur rendement total	13 031	(1 914)
116	29 juill. 2022	Jk Paper Ltd, swap sur rendement total	560	(89)
222	29 juill. 2022	Jm Financial Ltd, swap sur rendement total	221	(21)
2 200	29 juill. 2022	Joincare Pharmaceutical Gr-A, swap sur rendement total	5 231	165
22	29 juill. 2022	Jyp Entertainment Corp, swap sur rendement total	1 054	(108)
252	29 juill. 2022	Kakao Corp - swap sur rendement total	17 491	(545)
27	29 juill. 2022	Kangwon Land Inc, swap sur rendement total	681	(110)
23 952	29 juill. 2022	Karur Vysya Bank Ltd, swap sur rendement total	17 577	(338)
2 100	29 juill. 2022	Kelington Group Bhd, swap sur rendement total	731	-
37	29 juill. 2022	Kginicis Co Ltd, swap sur rendement total	467	(143)
283	29 juill. 2022	Kia Motors Corp, swap sur rendement total	21 722	(669)
32	29 juill. 2022	Kolon Corp, swap sur rendement total	720	(207)
964	29 juill. 2022	Korea Aerospace Industries, swap sur rendement total	51 499	(1 358)
76	29 juill. 2022	Korea Circuit Co Ltd, swap sur rendement total	1 456	(581)
612	29 juill. 2022	Korea Gas Corporation, swap sur rendement total	24 034	(4 285)
379	29 juill. 2022	Korea Shipbuilding & Offshor- swap sur rendement total	35 338	(774)
46	29 juill. 2022	Korea Zinc Co Ltd - swap sur rendement total	22 267	(6 287)
1 559	29 juill. 2022	Korean Air Lines Co Ltd, swap sur rendement total	39 011	(8 247)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
764	29 juill. 2022	Korean Reinsurance Co, swap sur rendement total	6 372	(1 311)
727	29 juill. 2022	Kpr Mill Ltd, swap sur rendement total	6 120	(1 481)
173	29 juill. 2022	Kt&G Corp, swap sur rendement total	14 121	(898)
648	29 juill. 2022	Ktb Investment & Securities, swap sur rendement total	2 722	(686)
3 200	29 juill. 2022	Kuala Lumpur Kepong Bhd, swap sur rendement total	20 542	(3 560)
22	29 juill. 2022	Kumho Petrochemical Co Ltd, swap sur rendement total	3 037	(628)
192	29 juill. 2022	Kyeryong Const Indust Co Ltd, swap sur rendement total	4 804	(1 747)
2 700	29 juill. 2022	Ladprao General Hospital Pcl, swap sur rendement total	557	(48)
1 100	29 juill. 2022	Laobaixing Pharmacy Chain-A, swap sur rendement total	9 184	511
10 866	29 juill. 2022	Lemon Tree Hotels Ltd, swap sur rendement total	10 830	(809)
2 000	29 juill. 2022	Lefoo Development, swap sur rendement total	1 488	(36)
16	29 juill. 2022	Lg Household & Health Care, swap sur rendement total	10 804	(522)
254	29 juill. 2022	Lg International Corp, swap sur rendement total	8 210	(1 876)
34	29 juill. 2022	Lg Uplus Corp, swap sur rendement total	430	(61)
80	29 juill. 2022	Lig Nex1 Co Ltd, swap sur rendement total	5 704	(894)
127	29 juill. 2022	Longtu Korea Inc, swap sur rendement total	587	(168)
15 400	29 juill. 2022	Lotte Chemical Titan Holding, swap sur rendement total	8 877	(428)
43	29 juill. 2022	Lotte Fine Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	2 797	(915)
94	29 juill. 2022	Ls Corp - swap sur rendement total	5 936	(529)
100	29 juill. 2022	Lumax Industries Ltd, swap sur rendement total	2 079	86
85	29 juill. 2022	Lutronic Corp, swap sur rendement total	1 448	(689)
400	29 juill. 2022	M Dias Branco Sa - swap sur rendement total	2 573	(245)
5 400	29 juill. 2022	Macquarie Mexico Real Estate, swap sur rendement total	8 704	(588)
134	29 juill. 2022	Mahindra Holidays & Resorts, swap sur rendement total	469	(24)
500	29 juill. 2022	Malaysian Pacific Industries, swap sur rendement total	4 096	(742)
331	29 juill. 2022	Man Infraconstruction Ltd, swap sur rendement total	411	(83)
3 700	29 juill. 2022	Marfrig Global Foods Sa, swap sur rendement total	11 044	(4 390)
310	29 juill. 2022	Matrimony.Com Ltd, swap sur rendement total	4 108	82
36	29 juill. 2022	Max Financial Services Ltd, swap sur rendement total	460	(16)
7 100	29 juill. 2022	Mega Lifesciences Pcl, swap sur rendement total	13 101	(822)
21	29 juill. 2022	Megastudyedu Co Ltd, swap sur rendement total	1 626	(398)
1 426	29 juill. 2022	Meritz Fire & Marine Insuran- swap sur rendement total	46 940	(10 506)
200	29 juill. 2022	Minerva Sa, swap sur rendement total	654	(24)
800	29 juill. 2022	Minor International Pcl, swap sur rendement total	994	(90)
579	29 juill. 2022	Mirae Asset Life Insurance, swap sur rendement total	1 785	(485)
316	29 juill. 2022	Mk Electron Co Ltd, swap sur rendement total	3 342	(1 473)
157	29 juill. 2022	Moda-Innochips Co Ltd, swap sur rendement total	635	64
14 300	29 juill. 2022	More Return Pcl, swap sur rendement total	1 008	(16)
200	29 juill. 2022	Multiplan Empreendimentos, swap sur rendement total	1 082	(43)
26	29 juill. 2022	Namhae Chemical Corp, swap sur rendement total	257	(85)
43	29 juill. 2022	Narayana Hrudayalaya Ltd, swap sur rendement total	444	(24)
7 954	29 juill. 2022	Nava Bharat Ventures Ltd, swap sur rendement total	23 043	(1 438)
212	29 juill. 2022	Naver Corp - swap sur rendement total	50 522	(12 436)
139	29 juill. 2022	Nexen Corp, swap sur rendement total	489	(123)
300	29 juill. 2022	Nhn Corp, swap sur rendement total	8 326	(1 611)
25	29 juill. 2022	Nice Information & Telecom, swap sur rendement total	627	(129)
444	29 juill. 2022	Niit Ltd, swap sur rendement total	2 998	(405)
532	29 juill. 2022	Nlc India Ltd, swap sur rendement total	553	(115)
5	29 juill. 2022	Nongshim Co Ltd, swap sur rendement total	1 328	(112)
200	29 juill. 2022	Notre Dame Intermed Par Sa, swap sur rendement total	3 433	(27)
997	29 juill. 2022	Nrb Bearings Ltd, swap sur rendement total	2 197	154
1 000	29 juill. 2022	Obi Pharma Inc, swap sur rendement total	4 229	(582)
100	29 juill. 2022	Oppl Lighting Co Ltd-A, swap sur rendement total	336	8
21	29 juill. 2022	Orion Corp, swap sur rendement total	2 169	35
386	29 juill. 2022	Partron Co Ltd, swap sur rendement total	3 239	(1 252)
257	29 juill. 2022	Persistent Systems Ltd, swap sur rendement total	14 273	(1 806)
2 200	29 juill. 2022	Petro Rio Sa, swap sur rendement total	11 924	(4 748)
300	29 juill. 2022	Petrobras - Petroleo Bras- actions priv., swap sur rendement total	2 065	(385)
2 500	29 juill. 2022	Petronas Chemicals Group Bhd, swap sur rendement total	6 583	(971)
32	29 juill. 2022	Polyplex Corporation Ltd, swap sur rendement total	1 151	(113)
4 400	29 juill. 2022	Polyplex Pcl, swap sur rendement total	3 633	(448)
4 400	29 juill. 2022	Porto Seguro Sa, swap sur rendement total	19 706	(5 135)
29	29 juill. 2022	Posco Chemtech Co Ltd, swap sur rendement total	3 081	(522)
286	29 juill. 2022	Prakash Industries Ltd, swap sur rendement total	236	(45)
59	29 juill. 2022	Prataap Snacks Ltd, swap sur rendement total	609	(50)
23 600	29 juill. 2022	Precious Shipping Pcl, swap sur rendement total	15 867	(1 757)
2	29 juill. 2022	Procter & Gamble Hygiene, swap sur rendement total	437	(23)
2 800	29 juill. 2022	Public Bank Berhad, swap sur rendement total	3 580	(326)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
24	29 juill. 2022	Pvr Ltd, swap sur rendement total	729	(6)
100	29 juill. 2022	Qgep Participacoes Sa, swap sur rendement total	433	(51)
2 000	29 juill. 2022	Qingdao Haier Co Ltd-A, swap sur rendement total	10 574	804
800	29 juill. 2022	Qualitas Controladora Sab Cv, swap sur rendement total	4 748	(424)
1 100	29 juill. 2022	Rajthanee Hospital Pcl, swap sur rendement total	1 457	(14)
500	29 juill. 2022	Rajthanee Hospital Pcl, swap sur rendement total	662	(8)
100	29 juill. 2022	Rede D'Or Sao Luiz Sa, swap sur rendement total	714	(259)
9 166	29 juill. 2022	Redington India Ltd, swap sur rendement total	18 788	(1 041)
5	29 juill. 2022	Reliance Inds-Spons CIAE 144A, swap sur rendement total	420	(10)
53 783	29 juill. 2022	Rosseti Pjsc, swap sur rendement total	749	(1 097)
800	29 juill. 2022	Rumo Na, swap sur rendement total	3 149	(298)
2 700	29 juill. 2022	S Hotels & Resorts Pcl, swap sur rendement total	436	(31)
48	29 juill. 2022	S&T Dynamics Co Ltd, swap sur rendement total	340	(86)
229	29 juill. 2022	S&T Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	3 536	(440)
5	29 juill. 2022	S-1 Corporation, swap sur rendement total	319	(57)
24	29 juill. 2022	Sam Kang M&T Co Ltd, swap sur rendement total	551	(9)
52	29 juill. 2022	Sam Young Electronics Co Ltd, swap sur rendement total	555	(94)
41	29 juill. 2022	Samchully Co Ltd, swap sur rendement total	7 328	531
314	29 juill. 2022	Sammok S-Form Co Ltd, swap sur rendement total	5 893	(2 718)
36	29 juill. 2022	Samsung Biologics Co Ltd, swap sur rendement total	28 240	(1 448)
649	29 juill. 2022	Samsung Card Co, swap sur rendement total	19 655	(3 401)
2	29 juill. 2022	Samsung Electr-CIAE, swap sur rendement total	2 815	(637)
180	29 juill. 2022	Samsung Electro-Mechanics Co, swap sur rendement total	23 325	(5 689)
765	29 juill. 2022	Samsung Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	16 370	(3 168)
8	29 juill. 2022	Samsung Fire & Marine Ins, swap sur rendement total	1 597	(42)
5 775	29 juill. 2022	Samsung Heavy Industries, swap sur rendement total	34 808	(543)
219	29 juill. 2022	Samsung Life Insurance Co Lt, swap sur rendement total	13 613	(1 947)
142	29 juill. 2022	Samsung Sdi Co Ltd - swap sur rendement total	75 013	(9 467)
31	29 juill. 2022	Sanofi India Ltd, swap sur rendement total	3 258	(271)
1 000	29 juill. 2022	Sao Martinho Sa, swap sur rendement total	8 972	(4 243)
140	29 juill. 2022	Schaeffler India Ltd, swap sur rendement total	5 235	(124)
400	29 juill. 2022	Sdic Capital Co Ltd-A, swap sur rendement total	490	13
269	29 juill. 2022	Seah Besteel Corp - swap sur rendement total	4 100	(826)
104	29 juill. 2022	Seah Steel Holdings - swap sur rendement total	14 303	(3 330)
4 700	29 juill. 2022	Sersang Power Corp Co Ltd, swap sur rendement total	1 606	(149)
300	29 juill. 2022	Shandong Lukang Pharma-A, swap sur rendement total	378	-
300	29 juill. 2022	Shanghai Fudan Forward S &-A, swap sur rendement total	390	(145)
300	29 juill. 2022	Shanghai International Por-A, swap sur rendement total	337	(11)
200	29 juill. 2022	Shenzhen Overseas Chinese-A, swap sur rendement total	250	(36)
6	29 juill. 2022	Shin Heung Energy & Electron, swap sur rendement total	328	(50)
45	29 juill. 2022	Shinsega Food Co Ltd, swap sur rendement total	2 516	(538)
131	29 juill. 2022	Shinwon Corp, swap sur rendement total	212	(49)
200	29 juill. 2022	Siam Commercial Bank Pub Co, swap sur rendement total	534	(351)
100	29 juill. 2022	Sichuan Kelun Pharmaceutic-A, swap sur rendement total	360	15
137	29 juill. 2022	Sigurd Microelectronics Corp, swap sur rendement total	308	(49)
400	29 juill. 2022	Sime Darby Plantation Bhd, swap sur rendement total	507	(86)
41	29 juill. 2022	Simmtech Co Ltd, swap sur rendement total	1 504	(589)
14	29 juill. 2022	Sk Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	2 989	(259)
6	29 juill. 2022	Sk Hynix Inc - swap sur rendement total	542	(154)
132	29 juill. 2022	Sk Telecom, swap sur rendement total	6 816	(1 047)
24	29 juill. 2022	Skc Co Ltd, swap sur rendement total	3 170	(759)
11	29 juill. 2022	Skf India Ltd, swap sur rendement total	656	(4)
650	29 juill. 2022	Slc Agricola Sa, swap sur rendement total	7 070	(2 626)
147	29 juill. 2022	Sm Entertainment Co - swap sur rendement total	9 211	(1 453)
17	29 juill. 2022	Solar Industries India Ltd, swap sur rendement total	764	23
89	29 juill. 2022	Somany Ceramics Ltd, swap sur rendement total	816	(77)
10	29 juill. 2022	Sundaytoz Corp, swap sur rendement total	216	(92)
1 600	29 juill. 2022	Sunflower Pharmaceutical-A, swap sur rendement total	4 818	(195)
45	29 juill. 2022	Sunjin Co Ltd, swap sur rendement total	449	(1)
14 800	29 juill. 2022	Super Energy Corp Pcl, swap sur rendement total	406	(68)
632	29 juill. 2022	Supreme Petrochem Ltd, swap sur rendement total	9 146	1 473
2 200	29 juill. 2022	Synnex Thailand Pcl, swap sur rendement total	1 463	(371)
300	29 juill. 2022	Ta Ann Holdings Berhad, swap sur rendement total	349	(91)
204	29 juill. 2022	Taeyoung Engineering & Const, swap sur rendement total	1 377	(453)
3 000	29 juill. 2022	Taiwan Cooperative Financial, swap sur rendement total	3 494	(264)
1 359	29 juill. 2022	Tanla Platforms Ltd, swap sur rendement total	22 290	(7 756)
932	29 juill. 2022	Tata Teleservices Maharashtra, swap sur rendement total	1 843	(99)
900	29 juill. 2022	Thai Union Group Pcl, swap sur rendement total	562	(14)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
27	29 juill. 2022	Thermax Ltd, swap sur rendement total	924	28
47 195	29 juill. 2022	Thoresen Thai Agencies Pcl, swap sur rendement total	15 175	(2 802)
500	29 juill. 2022	Tibet Rhodiola Pharm-A, swap sur rendement total	3 996	204
172	29 juill. 2022	Tk Corporation, swap sur rendement total	2 340	70
700	29 juill. 2022	Tofflon Science & Technolo-A, swap sur rendement total	4 570	131
1 000	29 juill. 2022	Ton Yi Industrial Corp, swap sur rendement total	677	(44)
8 400	29 juill. 2022	Tpi Polene Public Co Ltd, swap sur rendement total	479	(31)
51	29 juill. 2022	Transport Corp Of India Ltd, swap sur rendement total	562	(64)
7 495	29 juill. 2022	Triveni Engineering & Indus, swap sur rendement total	28 933	(7 558)
3 400	29 juill. 2022	Truking Technology Ltd-A, swap sur rendement total	11 645	657
1 200	29 juill. 2022	Tsh Resources Bhd, swap sur rendement total	372	(73)
13	29 juill. 2022	Ttcl Pcl, swap sur rendement total	2	-
40	29 juill. 2022	Ttk Prestige Ltd, swap sur rendement total	543	(11)
72	29 juill. 2022	Tway Air Co Ltd, swap sur rendement total	142	(121)
1 011	29 juill. 2022	Tym Corp, swap sur rendement total	2 605	(612)
19	29 juill. 2022	Unid Co Ltd, swap sur rendement total	1 819	(685)
1 000	29 juill. 2022	Union Bank Of Taiwan, swap sur rendement total	664	3
100	29 juill. 2022	Unipar Carbocloro Sa, swap sur rendement total	2 252	(481)
24 396	29 juill. 2022	Unisem (M) Berhad, swap sur rendement total	16 418	(3 363)
1 000	29 juill. 2022	Universal Cement, swap sur rendement total	954	(14)
100	29 juill. 2022	Valiant Co Ltd - A, swap sur rendement total	402	(16)
3 000	29 juill. 2022	Via Technologies Inc, swap sur rendement total	6 213	(870)
4 500	29 juill. 2022	Vibra Energia Sa, swap sur rendement total	18 534	(4 385)
1 600	29 juill. 2022	Vitrox Corp Bhd, swap sur rendement total	3 386	(270)
22	29 juill. 2022	Voltamp Transformers Ltd, swap sur rendement total	1 032	199
2 100	29 juill. 2022	Wasu Media Holding Co Ltd-A, swap sur rendement total	3 222	41
200	29 juill. 2022	Weg Sa, swap sur rendement total	1 306	(20)
251	29 juill. 2022	West Coast Paper Mills Ltd, swap sur rendement total	1 383	(24)
381	29 juill. 2022	Wonderla Holidays Ltd, swap sur rendement total	1 461	(46)
357	29 juill. 2022	Wonik Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 349	(481)
153	29 juill. 2022	Woongjin Co Ltd, swap sur rendement total	216	(135)
2 000	29 juill. 2022	Wuxi Apttec Co Ltd-A, swap sur rendement total	40 042	3 194
200	29 juill. 2022	Xiamen C & D Inc-A, swap sur rendement total	503	49
2 000	29 juill. 2022	Yc Inox Co Ltd, swap sur rendement total	2 320	(412)
2 000	29 juill. 2022	Yieh Phui Enterprise Co Ltd, swap sur rendement total	1 440	(384)
600	29 juill. 2022	Yifeng Pharmacy Chain Co L-A, swap sur rendement total	6 103	1 465
100	29 juill. 2022	Ymc Co Ltd, swap sur rendement total	572	(184)
2 500	29 juill. 2022	Yonghui Superstores Co Ltd-A, swap sur rendement total	2 060	(40)
204	29 juill. 2022	Youngone Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	9 490	(2 652)
200	29 juill. 2022	Yto Express Group Co Ltd-A, swap sur rendement total	785	52
600	29 juill. 2022	Zhejiang Jingxin Pharmaceu-A, swap sur rendement total	1 051	24
100	29 juill. 2022	Zhejiang Weixing New Build-A, swap sur rendement total	463	107
1 300	29 juill. 2022	Zijin Mining Group Co Ltd-A, swap sur rendement total	2 335	7
				<u>(281 692)</u>
				<u>(435 175)</u>
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position acheteur		
				<u>(435 175)</u>
		Swaps d'actions – position vendeur		
		Dollar australien – taux de swap des acceptations bancaires (BBSW) à 1 mois		
(111)	29 juill. 2022	Adelaide Brighton Ltd, swap sur rendement total	(238)	17
(368)	29 juill. 2022	Allkem Ltd, swap sur rendement total	(3 365)	626
(1 774)	29 juill. 2022	Ama Group Ltd, swap sur rendement total	(268)	62
(12 150)	29 juill. 2022	Amp Ltd, swap sur rendement total	(10 292)	1 510
(40)	29 juill. 2022	Ap Eagers Ltd, swap sur rendement total	(345)	10
(61)	29 juill. 2022	Appen Ltd, swap sur rendement total	(304)	45
(10)	29 juill. 2022	Arb Corp Ltd, swap sur rendement total	(250)	(8)
(353)	29 juill. 2022	Aust And Nz Banking Group, swap sur rendement total	(7 220)	(377)
(109)	29 juill. 2022	Australian Strategic Material, swap sur rendement total	(334)	45
(380)	29 juill. 2022	Bank Of Queensland Ltd, swap sur rendement total	(2 248)	191
(62)	29 juill. 2022	Bapcor Ltd, swap sur rendement total	(334)	-
(4 994)	29 juill. 2022	Betmakers Technology Group L, swap sur rendement total	(1 506)	641
(1 223)	29 juill. 2022	Bravura Solutions Ltd, swap sur rendement total	(1 535)	175
(240)	29 juill. 2022	Carsales.Com Ltd, swap sur rendement total	(3 915)	318
(140)	29 juill. 2022	Challenger Ltd, swap sur rendement total	(849)	48
(220)	29 juill. 2022	Charter Hall Long Wale Reit, swap sur rendement total	(848)	70
(5)	29 juill. 2022	Cimic Group Ltd, swap sur rendement total	(98)	-
(99)	29 juill. 2022	City Chic Collective Ltd, swap sur rendement total	(161)	44
(33)	29 juill. 2022	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd, swap sur rendement total	(435)	30
(1 334)	29 juill. 2022	Coles Group Ltd, swap sur rendement total	(21 075)	(339)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(139)	29 juill. 2022	Commonwealth Bank Of Austral, swap sur rendement total	(11 144)	134
(1 517)	29 juill. 2022	Cromwell Property Group, swap sur rendement total	(1 038)	11
(604)	29 juill. 2022	Dexus, swap sur rendement total	(4 903)	435
(84)	29 juill. 2022	Domino'S Pizza Enterprises L, swap sur rendement total	(5 067)	53
(342)	29 juill. 2022	Fortescue Metals Group Ltd, swap sur rendement total	(5 318)	785
(5 420)	29 juill. 2022	Gold Road Resources Ltd, swap sur rendement total	(5 433)	482
(2 028)	29 juill. 2022	Goodman Group, swap sur rendement total	(32 362)	3 576
(2 709)	29 juill. 2022	Humm Group Ltd, swap sur rendement total	(985)	872
(61)	29 juill. 2022	Igo Ltd, swap sur rendement total	(538)	125
(1 174)	29 juill. 2022	Imugene Ltd, swap sur rendement total	(187)	15
(374)	29 juill. 2022	Iph Ltd, swap sur rendement total	(2 707)	(202)
(618)	29 juill. 2022	James Hardie Industries-Cdi, swap sur rendement total	(17 580)	1 085
(825)	29 juill. 2022	Lynas Corp Ltd, swap sur rendement total	(6 389)	638
(1 600)	29 juill. 2022	Mayne Pharma Group Ltd, swap sur rendement total	(355)	70
(44)	29 juill. 2022	Mineral Resources Ltd, swap sur rendement total	(1 884)	539
(4 441)	29 juill. 2022	Mirvac Group, swap sur rendement total	(7 981)	897
(105)	29 juill. 2022	National Australia Bank Ltd, swap sur rendement total	(2 648)	(128)
(10 122)	29 juill. 2022	National Storage Reit, swap sur rendement total	(19 699)	1 927
(274)	29 juill. 2022	Navigator Global Investments, swap sur rendement total	(303)	18
(143)	29 juill. 2022	Nine Entertainment Co Holdin, swap sur rendement total	(231)	41
(265)	29 juill. 2022	People Infrastructure Ltd, swap sur rendement total	(679)	62
(8 434)	29 juill. 2022	Perenti Global Ltd, swap sur rendement total	(4 900)	81
(3 142)	29 juill. 2022	Pointsbet Holdings Ltd, swap sur rendement total	(7 469)	792
(2 473)	29 juill. 2022	Polynovo Ltd, swap sur rendement total	(2 972)	(254)
(2 957)	29 juill. 2022	Praemium Ltd, swap sur rendement total	(1 220)	405
(2 099)	29 juill. 2022	Ramelius Resources Ltd, swap sur rendement total	(1 620)	528
(31)	29 juill. 2022	Rea Group Ltd, swap sur rendement total	(3 075)	(107)
(2 183)	29 juill. 2022	Reliance Worldwide Corp Ltd, swap sur rendement total	(7 823)	(250)
(716)	29 juill. 2022	Resolute Mining Ltd, swap sur rendement total	(143)	32
(1 057)	29 juill. 2022	Seek Ltd, swap sur rendement total	(19 689)	3 048
(152)	29 juill. 2022	Senex Energy Ltd, swap sur rendement total	(620)	-
(5 043)	29 juill. 2022	Service Stream Ltd, swap sur rendement total	(3 914)	277
(1 265)	29 juill. 2022	Shopping Centres Australasia, swap sur rendement total	(3 176)	(149)
(1 289)	29 juill. 2022	Stockland, swap sur rendement total	(4 295)	88
(47)	29 juill. 2022	Suncorp Group Ltd, swap sur rendement total	(458)	8
(53)	29 juill. 2022	Technology One Ltd, swap sur rendement total	(504)	(5)
(4 365)	29 juill. 2022	Telstra Corp Ltd, swap sur rendement total	(14 907)	(112)
(384)	29 juill. 2022	Treasury Wine Estates Ltd, swap sur rendement total	(3 866)	141
(1 960)	29 juill. 2022	Woodside Energy Group Ltd, swap sur rendement total	(55 357)	(1 612)
(1 910)	29 juill. 2022	Woolworths Group Ltd, swap sur rendement total	(60 315)	(1 868)
(2 240)	29 juill. 2022	Worleyparsons Ltd, swap sur rendement total	(28 294)	1 040
(125)	29 juill. 2022	Xero Ltd, swap sur rendement total	(8 533)	1 102
(3 544)	29 juill. 2022	Zip Co Ltd, swap sur rendement total	(1 383)	1 486
				<u>19 214</u>
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
(2 131)	29 juill. 2022	4D Pharma Plc, swap sur rendement total	(556)	540
(220)	29 juill. 2022	Ab Dynamics Plc, swap sur rendement total	(3 998)	(256)
(565)	29 juill. 2022	Advanced Medical Solutions, swap sur rendement total	(2 611)	54
(1 188)	29 juill. 2022	Anglo Pacific Group Plc, swap sur rendement total	(2 695)	203
(718)	29 juill. 2022	Ao World Plc, swap sur rendement total	(776)	111
(318)	29 juill. 2022	Argo Blockchain Plc, swap sur rendement total	(167)	86
(140)	29 juill. 2022	Asos Plc, swap sur rendement total	(1 839)	443
(5 080)	29 juill. 2022	Assura Plc, swap sur rendement total	(5 267)	435
(1 031)	29 juill. 2022	Aston Martin Lagonda Global, swap sur rendement total	(7 139)	4 463
(812)	29 juill. 2022	Aveva Group Plc, swap sur rendement total	(28 634)	440
(200)	29 juill. 2022	B&M European Value Retail Sa, swap sur rendement total	(1 185)	28
(1 402)	29 juill. 2022	Batm Advanced Communications, swap sur rendement total	(760)	154
(32)	29 juill. 2022	Berkeley Group Holdings/The, swap sur rendement total	(1 867)	45
(333)	29 juill. 2022	Bhp Group Ltd-Di, swap sur rendement total	(11 983)	(109)
(15 460)	29 juill. 2022	Boohoo Group Plc, swap sur rendement total	(13 301)	7 279
(72)	29 juill. 2022	Boot (Henry) Plc, swap sur rendement total	(327)	40
(755)	29 juill. 2022	Breedon Group Plc, swap sur rendement total	(673)	156
(110)	29 juill. 2022	Britvic Plc, swap sur rendement total	(1 411)	(37)
(4 968)	29 juill. 2022	Cairn Homes Plc, swap sur rendement total	(6 639)	464
(126)	29 juill. 2022	Caretech Holdings Plc, swap sur rendement total	(1 463)	(116)
(186)	29 juill. 2022	Chesnara Plc, swap sur rendement total	(817)	39
(117)	29 juill. 2022	Close Brothers Group Plc, swap sur rendement total	(1 879)	118
(8 298)	29 juill. 2022	Costain Group Plc, swap sur rendement total	(4 446)	627

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(2 239)	29 juill. 2022	Countryside Properties Plc, swap sur rendement total	(8 699)	1 067
(1 674)	29 juill. 2022	De La Rue Plc, swap sur rendement total	(2 040)	422
(15)	29 juill. 2022	Dechra Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	(813)	(60)
(2 365)	29 juill. 2022	Dignity Plc, swap sur rendement total	(14 968)	2 807
(198)	29 juill. 2022	Direct Line Insurance Group, swap sur rendement total	(781)	9
(988)	29 juill. 2022	Diversified Energy Co Plc, swap sur rendement total	(1 724)	133
(79)	29 juill. 2022	Domino'S Pizza Group Plc, swap sur rendement total	(346)	68
(137)	29 juill. 2022	Ds Smith Plc, swap sur rendement total	(595)	45
(5 168)	29 juill. 2022	Easyjet Plc, swap sur rendement total	(29 680)	7 737
(628)	29 juill. 2022	Ekf Diagnostics Holdings Plc, swap sur rendement total	(315)	26
(10)	29 juill. 2022	First Derivatives Plc, swap sur rendement total	(308)	33
(451)	29 juill. 2022	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(58 246)	10 640
(827)	29 juill. 2022	Foxtons Group Plc, swap sur rendement total	(426)	63
(79)	29 juill. 2022	Frasers Group Plc, swap sur rendement total	(824)	29
(29)	29 juill. 2022	Frontier Developments Plc, swap sur rendement total	(627)	21
(260)	29 juill. 2022	Future Plc, swap sur rendement total	(7 018)	466
(950)	29 juill. 2022	Gb Group Plc, swap sur rendement total	(5 980)	1 537
(57)	29 juill. 2022	Genuit Group Plc, swap sur rendement total	(342)	65
(100)	29 juill. 2022	Globaldata Plc, swap sur rendement total	(1 614)	178
(79)	29 juill. 2022	Grainger Plc, swap sur rendement total	(351)	27
(6 144)	29 juill. 2022	Gym Group Plc/The, swap sur rendement total	(18 307)	2 977
(100)	29 juill. 2022	Hargreaves Services Plc, swap sur rendement total	(805)	56
(702)	29 juill. 2022	Hays Plc, swap sur rendement total	(1 227)	64
(27)	29 juill. 2022	Headlam Group Plc, swap sur rendement total	(126)	10
(2 250)	29 juill. 2022	Helical Plc, swap sur rendement total	(13 491)	1 599
(570)	29 juill. 2022	Hill & Smith Holdings Plc, swap sur rendement total	(10 510)	1 906
(90)	29 juill. 2022	Homeserve Plc, swap sur rendement total	(1 652)	(12)
(6 843)	29 juill. 2022	Hye Group Plc, swap sur rendement total	(7 911)	1 507
(253)	29 juill. 2022	Ig Design Group Plc, swap sur rendement total	(337)	(150)
(54)	29 juill. 2022	Integratin Holdings Plc, swap sur rendement total	(190)	54
(7 206)	29 juill. 2022	Itm Power Plc, swap sur rendement total	(19 507)	13 782
(18 146)	29 juill. 2022	Itv Plc, swap sur rendement total	(18 552)	1 356
(545)	29 juill. 2022	Iwg Plc, swap sur rendement total	(1 597)	121
(51)	29 juill. 2022	James Fisher & Sons Plc, swap sur rendement total	(232)	55
(15 188)	29 juill. 2022	Jd Sports Fashion Plc, swap sur rendement total	(27 457)	1 745
(1 431)	29 juill. 2022	Jet2 Plc, swap sur rendement total	(20 306)	5 591
(370)	29 juill. 2022	John Wood Group Plc, swap sur rendement total	(904)	466
(111)	29 juill. 2022	Jupiter Fund Management, swap sur rendement total	(258)	25
(56)	29 juill. 2022	Knights Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(75)	33
(15 920)	29 juill. 2022	Legal & General Group Plc, swap sur rendement total	(59 731)	4 669
(466)	29 juill. 2022	Londonmetric Property Plc, swap sur rendement total	(1 687)	51
(2 269)	29 juill. 2022	M&G Plc, swap sur rendement total	(6 917)	630
(1 200)	29 juill. 2022	Marks & Spencer Group Plc, swap sur rendement total	(2 547)	80
(765)	29 juill. 2022	Marshalls Plc, swap sur rendement total	(5 484)	888
(672)	29 juill. 2022	National Express Group Plc, swap sur rendement total	(2 047)	741
(341)	29 juill. 2022	Next Plc, swap sur rendement total	(31 304)	2 840
(111)	29 juill. 2022	Ninety One Plc, swap sur rendement total	(344)	47
(829)	29 juill. 2022	Ocado Group Plc, swap sur rendement total	(10 145)	1 626
(659)	29 juill. 2022	On The Beach Group Plc, swap sur rendement total	(1 470)	607
(95)	29 juill. 2022	Oxford Biomedica Plc, swap sur rendement total	(676)	82
(180)	29 juill. 2022	Pagegroup Plc, swap sur rendement total	(1 127)	153
(51)	29 juill. 2022	Paypoint Plc, swap sur rendement total	(449)	14
(215)	29 juill. 2022	Pearson Plc, swap sur rendement total	(2 525)	226
(145)	29 juill. 2022	Pennon Group Plc, swap sur rendement total	(2 164)	174
(61)	29 juill. 2022	Persimmon Plc, swap sur rendement total	(1 885)	272
(6 778)	29 juill. 2022	Phoenix Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(62 690)	5 027
(234)	29 juill. 2022	Plus500 Ltd, swap sur rendement total	(6 134)	(409)
(159)	29 juill. 2022	Prudential Plc, swap sur rendement total	(2 531)	57
(5 029)	29 juill. 2022	Quilter Plc, swap sur rendement total	(8 075)	1 399
(34)	29 juill. 2022	Redrow Plc, swap sur rendement total	(261)	15
(232)	29 juill. 2022	Regional Reit Ltd, swap sur rendement total	(269)	31
(63)	29 juill. 2022	Rentokil Initial Plc, swap sur rendement total	(468)	(10)
(8 087)	29 juill. 2022	Restaurant Group Plc, swap sur rendement total	(5 643)	1 105
(36)	29 juill. 2022	Rhi Magnesita Nv, swap sur rendement total	(1 123)	237
(881)	29 juill. 2022	Rws Holdings Plc, swap sur rendement total	(4 782)	668
(179)	29 juill. 2022	S4 Capital Plc, swap sur rendement total	(643)	119
(1)	29 juill. 2022	Saga Plc, swap sur rendement total	(3)	1
(50)	29 juill. 2022	Sage Group Plc/The, swap sur rendement total	(497)	126

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(715)	29 juill. 2022	Sainsbury (J) Plc, swap sur rendement total	(2 396)	139
(192)	29 juill. 2022	Segro Plc, swap sur rendement total	(2 938)	79
(7)	29 juill. 2022	Severn Trent Plc, swap sur rendement total	(305)	6
(44)	29 juill. 2022	Sse Plc, swap sur rendement total	(1 114)	12
(2 215)	29 juill. 2022	St James'S Place Plc, swap sur rendement total	(38 256)	6 463
(41 158)	29 juill. 2022	Stobart Group Ltd, swap sur rendement total	(6 061)	(438)
(917)	29 juill. 2022	Strix Group Plc, swap sur rendement total	(2 399)	404
(466)	29 juill. 2022	Sylvania Platinum Ltd, swap sur rendement total	(642)	13
(382)	29 juill. 2022	Synthomer Plc, swap sur rendement total	(1 474)	408
(5 352)	29 juill. 2022	Taylor Wimpey Plc, swap sur rendement total	(9 780)	860
(3 505)	29 juill. 2022	Tesco Plc, swap sur rendement total	(14 029)	193
(655)	29 juill. 2022	Tp Icap Plc, swap sur rendement total	(1 152)	179
(88)	29 juill. 2022	Trainline Plc, swap sur rendement total	(397)	24
(476)	29 juill. 2022	Trifast Plc, swap sur rendement total	(713)	58
(478)	29 juill. 2022	United Utilities Group Plc, swap sur rendement total	(7 855)	(52)
(12)	29 juill. 2022	Verici Dx Plc, swap sur rendement total	(4)	(4)
(1 378)	29 juill. 2022	Vesuvius Plc, swap sur rendement total	(6 563)	871
(765)	29 juill. 2022	Wizz Air Holdings Plc, swap sur rendement total	(21 021)	12 329
(59)	29 juill. 2022	Woodside Energy Group, swap sur rendement total	(1 608)	(1 608)
(38)	29 juill. 2022	Workspace Group Plc, swap sur rendement total	(331)	75
(1 641)	29 juill. 2022	Zotefoams Plc, swap sur rendement total	(6 941)	879
				114 061
Euro – taux à court terme (€STR)				
(651)	29 juill. 2022	Accor Sa, swap sur rendement total	(22 677)	3 635
(26)	29 juill. 2022	Ackermans & Van Haaren, swap sur rendement total	(4 996)	399
(246)	29 juill. 2022	Adp, swap sur rendement total	(40 092)	5 981
(4 299)	29 juill. 2022	Aegon Nv, swap sur rendement total	(24 454)	4 341
(5)	29 juill. 2022	Aena Sme Sa, swap sur rendement total	(818)	140
(2 533)	29 juill. 2022	Air France-Klm, swap sur rendement total	(3 817)	454
(66)	29 juill. 2022	Airbus Se, swap sur rendement total	(8 229)	1 301
(108)	29 juill. 2022	Albioma Sa, swap sur rendement total	(7 265)	(6)
(42)	29 juill. 2022	Altearea, swap sur rendement total	(7 397)	509
(24)	29 juill. 2022	Alten Sa, swap sur rendement total	(3 360)	350
(1 161)	29 juill. 2022	Amper Sa, swap sur rendement total	(317)	71
(16)	29 juill. 2022	Amundi Sa, swap sur rendement total	(1 126)	(154)
(1 048)	29 juill. 2022	Arcelormittal, swap sur rendement total	(30 400)	2 373
(127)	29 juill. 2022	Arkema, swap sur rendement total	(14 544)	3 615
(28)	29 juill. 2022	Asm International Nv, swap sur rendement total	(9 010)	714
(234)	29 juill. 2022	Asr Nederland Nv, swap sur rendement total	(12 171)	1 140
(517)	29 juill. 2022	Atos Se, swap sur rendement total	(8 914)	7 205
(230)	29 juill. 2022	Be Semiconductor Industries, swap sur rendement total	(14 228)	3 283
(171)	29 juill. 2022	Biomérieux, swap sur rendement total	(21 493)	899
(591)	29 juill. 2022	Bouygues Sa, swap sur rendement total	(23 400)	2 024
(443)	29 juill. 2022	Bpost Sa, swap sur rendement total	(3 366)	110
(427)	29 juill. 2022	Brunel International, swap sur rendement total	(5 977)	194
(17)	29 juill. 2022	Ca Immobilien Anlagen Ag, swap sur rendement total	(694)	15
(44)	29 juill. 2022	Care Property Invest, swap sur rendement total	(1 415)	13
(1 239)	29 juill. 2022	Cellnex Telecom Sa, swap sur rendement total	(61 873)	6 810
(52)	29 juill. 2022	Cfe, swap sur rendement total	(579)	(28)
(1 007)	29 juill. 2022	Cgg Sa, swap sur rendement total	(1 127)	317
(11)	29 juill. 2022	Cofinimmo, swap sur rendement total	(1 537)	223
(12)	29 juill. 2022	Colruyt Sa, swap sur rendement total	(420)	47
(5)	29 juill. 2022	Corbion Nv, swap sur rendement total	(195)	26
(46)	29 juill. 2022	Covivio, swap sur rendement total	(3 285)	810
(65)	29 juill. 2022	Crédit Agricole Sa, swap sur rendement total	(765)	137
(187)	29 juill. 2022	Dalata Hotel Group Plc, swap sur rendement total	(876)	146
(24)	29 juill. 2022	Deutsche Euroshop Ag, swap sur rendement total	(719)	(4)
(4)	29 juill. 2022	Dredging Environmental, swap sur rendement total	(566)	(566)
(172)	29 juill. 2022	Edenred, swap sur rendement total	(10 431)	192
(89)	29 juill. 2022	Edf, swap sur rendement total	(937)	47
(189)	29 juill. 2022	Eiffage, swap sur rendement total	(21 889)	1 548
(293)	29 juill. 2022	Elis Sa, swap sur rendement total	(5 018)	785
(100)	29 juill. 2022	Enento Group Oyj, swap sur rendement total	(2 798)	352
(1 338)	29 juill. 2022	Engie, swap sur rendement total	(19 787)	1 933
(34)	29 juill. 2022	Essilorluxottica, swap sur rendement total	(6 552)	153
(566)	29 juill. 2022	Euronav Nv, swap sur rendement total	(8 770)	263

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(437)	29 juill. 2022	Etelsat Communications, swap sur rendement total	(6 329)	152
(10 557)	29 juill. 2022	Finnair Oyj, swap sur rendement total	(5 823)	1 009
(49)	29 juill. 2022	Flow Traders, swap sur rendement total	(1 805)	125
(263)	29 juill. 2022	Flughafen Wien Ag, swap sur rendement total	(11 616)	(2 176)
(11)	29 juill. 2022	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(1 431)	178
(416)	29 juill. 2022	Fortum Oyj, swap sur rendement total	(8 031)	1 507
(446)	29 juill. 2022	Galp Energia Sgps Sa, swap sur rendement total	(6 727)	466
(339)	29 juill. 2022	Gaztransport Et Techniga Sa, swap sur rendement total	(54 632)	1 094
(6)	29 juill. 2022	Gecina Sa, swap sur rendement total	(720)	153
(1 072)	29 juill. 2022	Glenveagh Properties Plc, swap sur rendement total	(1 352)	20
(23)	29 juill. 2022	Heineken Holding Nv, swap sur rendement total	(2 154)	131
(69)	29 juill. 2022	Heineken Nv, swap sur rendement total	(8 096)	621
(12)	29 juill. 2022	Huhtamaki Oyj, swap sur rendement total	(612)	(31)
(194)	29 juill. 2022	Icade, swap sur rendement total	(12 176)	1 842
(58)	29 juill. 2022	Ipsen, swap sur rendement total	(7 043)	(114)
(145)	29 juill. 2022	Irish Residential Properties, swap sur rendement total	(248)	19
(1 229)	29 juill. 2022	Just Eat Takeaway.Com Nv, swap sur rendement total	(24 970)	9 471
(895)	29 juill. 2022	Kapsch Trafficcom Ag, swap sur rendement total	(15 208)	451
(52)	29 juill. 2022	Kaufman & Broad Sa, swap sur rendement total	(1 823)	159
(44)	29 juill. 2022	Kering, swap sur rendement total	(29 081)	523
(80)	29 juill. 2022	Klepierre, swap sur rendement total	(1 981)	262
(14)	29 juill. 2022	Kojamo Oyj, swap sur rendement total	(311)	24
(401)	29 juill. 2022	Koninklijke Kpn Nv, swap sur rendement total	(1 839)	(200)
(118)	29 juill. 2022	La Française Des Jeux Saem, swap sur rendement total	(5 255)	113
(41)	29 juill. 2022	Lagardere Sca, swap sur rendement total	(907)	474
(17)	29 juill. 2022	Legrand Sa, swap sur rendement total	(1 615)	83
(160)	29 juill. 2022	Maisons Du Monde Sa, swap sur rendement total	(2 050)	291
(584)	29 juill. 2022	Mcphly Energy Sa, swap sur rendement total	(10 089)	1 900
(258)	29 juill. 2022	Mercialys, swap sur rendement total	(2 683)	469
(177)	29 juill. 2022	Metrovacesa Sa, swap sur rendement total	(1 616)	69
(48)	29 juill. 2022	Neinor Homes Sa, swap sur rendement total	(774)	(52)
(129)	29 juill. 2022	Neles Oyj, swap sur rendement total	(1 607)	(1)
(24)	29 juill. 2022	Neste Oyj, swap sur rendement total	(1 367)	46
(33)	29 juill. 2022	Oeneo, swap sur rendement total	(630)	20
(44)	29 juill. 2022	Oesterreichische Post Ag, swap sur rendement total	(1 614)	66
(1 230)	29 juill. 2022	Orange, swap sur rendement total	(18 611)	592
(1 325)	29 juill. 2022	Oriola Corp -B, swap sur rendement total	(3 388)	359
(30)	29 juill. 2022	Orion Oyj- cat. B, swap sur rendement total	(1 723)	(182)
(206)	29 juill. 2022	Plastic Omnium, swap sur rendement total	(4 592)	242
(20)	29 juill. 2022	Publicis Groupe, swap sur rendement total	(1 258)	(3)
(1 782)	29 juill. 2022	Rexel Sa, swap sur rendement total	(35 266)	11 858
(1)	29 juill. 2022	Robertet Sa, swap sur rendement total	(1 150)	72
(103)	29 juill. 2022	S.O.I.T.E.C., swap sur rendement total	(18 821)	4 106
(585)	29 juill. 2022	Sbm Offshore Nv, swap sur rendement total	(10 205)	1 419
(21)	29 juill. 2022	Seb Sa, swap sur rendement total	(2 593)	167
(518)	29 juill. 2022	Ses, swap sur rendement total	(5 827)	373
(100)	29 juill. 2022	Sligro Food Group Nv, swap sur rendement total	(2 438)	236
(7)	29 juill. 2022	Smurfit Kappa Group Plc, swap sur rendement total	(303)	16
(21)	29 juill. 2022	Société Bic Sa, swap sur rendement total	(1 478)	27
(34)	29 juill. 2022	Sodexo Sa, swap sur rendement total	(3 075)	92
(1 024)	29 juill. 2022	Solocal Group, swap sur rendement total	(1 326)	71
(209)	29 juill. 2022	Solutions 30 Se, swap sur rendement total	(1 011)	526
(85)	29 juill. 2022	Solvay Sa, swap sur rendement total	(8 863)	1 058
(56)	29 juill. 2022	Sopra Steria Group, swap sur rendement total	(10 769)	1 693
(202)	29 juill. 2022	Suominen Oyj, swap sur rendement total	(815)	102
(89)	29 juill. 2022	Tarkett, swap sur rendement total	(1 488)	113
(25)	29 juill. 2022	Teleperformance, swap sur rendement total	(9 888)	326
(200)	29 juill. 2022	Télévision Française (T.F.1), swap sur rendement total	(1 822)	238
(46)	29 juill. 2022	Thales Sa, swap sur rendement total	(7 261)	(197)
(100)	29 juill. 2022	Uponor Oyj, swap sur rendement total	(1 776)	196
(26)	29 juill. 2022	Verallia, swap sur rendement total	(799)	93
(5)	29 juill. 2022	Vib Vermoegen Ag, swap sur rendement total	(162)	31
(150)	29 juill. 2022	Vivendi, swap sur rendement total	(1 961)	273

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(602)	29 juill. 2022	Voltalia Sa- actions ord., swap sur rendement total	(15 506)	1 776
(99)	29 juill. 2022	Westwing Group Ag, swap sur rendement total	(948)	253
(15)	29 juill. 2022	Worldline Sa, swap sur rendement total	(716)	11
				96 898
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
(16 110)	29 juill. 2022	Ak Medical Holdings Ltd, swap sur rendement total	(15 638)	(3 296)
(1 000)	29 juill. 2022	Akeso Inc, swap sur rendement total	(3 789)	(919)
(11 053)	29 juill. 2022	A-Living Smart City Services, swap sur rendement total	(23 675)	(923)
(2 000)	29 juill. 2022	Alphamab Oncology, swap sur rendement total	(2 660)	81
(3 000)	29 juill. 2022	Anhui Conch Cement Co Ltd-H, swap sur rendement total	(16 768)	1 476
(1 200)	29 juill. 2022	Ascentage Pharma Group Inter, swap sur rendement total	(4 202)	(766)
(298)	29 juill. 2022	Asia Cement China Holdings, swap sur rendement total	(233)	4
(1 100)	29 juill. 2022	Asm Pacific Technology, swap sur rendement total	(12 052)	729
(18 002)	29 juill. 2022	Avichina Industry & Tech-H, swap sur rendement total	(13 287)	90
(200)	29 juill. 2022	Bank Of East Asia Ltd, swap sur rendement total	(363)	9
(7 001)	29 juill. 2022	Beijing Chunlizhengda Medi-H, swap sur rendement total	(15 641)	(5 730)
(20 000)	29 juill. 2022	Beijing Enterprises Clean En, swap sur rendement total	(253)	20
(12 000)	29 juill. 2022	Beijing Enterprises Water Gr, swap sur rendement total	(4 675)	454
(12 000)	29 juill. 2022	Beijing North Star Co Ltd-H, swap sur rendement total	(2 111)	(39)
(100)	29 juill. 2022	Boc Aviation Ltd, swap sur rendement total	(1 084)	(19)
(14 000)	29 juill. 2022	Bosideng Intl Hldgs Ltd, swap sur rendement total	(11 208)	(1 657)
(4 000)	29 juill. 2022	Brilliance China Automotive, swap sur rendement total	(4 800)	(2 556)
(2 000)	29 juill. 2022	C&D International Investment, swap sur rendement total	(7 365)	(1 808)
(200)	29 juill. 2022	Cansino Biologics Inc-H, swap sur rendement total	(2 642)	(40)
(2 000)	29 juill. 2022	Canvest Environmental Protec, swap sur rendement total	(1 357)	(78)
(25 900)	29 juill. 2022	Cgn New Energy Holdings Co L, swap sur rendement total	(15 753)	775
(4 000)	29 juill. 2022	Cgn Power Co Ltd-H, swap sur rendement total	(1 305)	47
(500)	29 juill. 2022	China Aircraft Leasing Group, swap sur rendement total	(435)	(16)
(8 003)	29 juill. 2022	China Coal Energy Co-H, swap sur rendement total	(9 145)	356
(2 000)	29 juill. 2022	China Conch Venture Holdings, swap sur rendement total	(5 852)	845
(1 000)	29 juill. 2022	China Construction Bank-H, swap sur rendement total	(926)	34
(1 009)	29 juill. 2022	China Datang Corp Renewabl-H, swap sur rendement total	(443)	7
(4 003)	29 juill. 2022	China Eastern Airlines Co-H, swap sur rendement total	(1 981)	(186)
(2 000)	29 juill. 2022	China Everbright Greentech L, swap sur rendement total	(710)	(20)
(19 000)	29 juill. 2022	China Everbright Intl Ltd, swap sur rendement total	(14 461)	282
(8 000)	29 juill. 2022	China Everbright Ltd, swap sur rendement total	(9 706)	(242)
(1 000)	29 juill. 2022	China Galaxy Securities Co-H, swap sur rendement total	(745)	(33)
(13 200)	29 juill. 2022	China Gas Holdings Ltd, swap sur rendement total	(26 300)	(901)
(500)	29 juill. 2022	China Harmony New Energy Aut, swap sur rendement total	(310)	(33)
(3 006)	29 juill. 2022	China High Speed Transmissio, swap sur rendement total	(2 298)	(84)
(1 600)	29 juill. 2022	China International Capita-H, swap sur rendement total	(4 477)	(547)
(306)	29 juill. 2022	China International Marine-H, swap sur rendement total	(640)	1
(8 000)	29 juill. 2022	China Jinmao Holdings Group, swap sur rendement total	(2 775)	13
(1 000)	29 juill. 2022	China Longyuan Power Group-H, swap sur rendement total	(2 516)	245
(2 000)	29 juill. 2022	China Medical System Holding, swap sur rendement total	(4 024)	(223)
(24 000)	29 juill. 2022	China Merchants Land Ltd, swap sur rendement total	(2 643)	40
(42 000)	29 juill. 2022	China Molybdenum Co Ltd-H, swap sur rendement total	(30 733)	(4 016)
(1 000)	29 juill. 2022	China Overseas Grand Oceans, swap sur rendement total	(735)	(74)
(6 002)	29 juill. 2022	China Petroleum & Chemical-H, swap sur rendement total	(3 483)	167
(1 000)	29 juill. 2022	China Power International, swap sur rendement total	(819)	(161)
(15 000)	29 juill. 2022	China Reinsurance Group Co-H, swap sur rendement total	(1 714)	(12)
(2 900)	29 juill. 2022	China Renaissance Holdings L, swap sur rendement total	(4 691)	(28)
(18 000)	29 juill. 2022	China Resources Cement, swap sur rendement total	(16 422)	1 952
(500)	29 juill. 2022	China Resources Pharmaceutic, swap sur rendement total	(450)	(36)
(6 000)	29 juill. 2022	China South City Holdings, swap sur rendement total	(651)	-
(20 001)	29 juill. 2022	China Suntien Green Energy-H, swap sur rendement total	(13 701)	1 259
(2 000)	29 juill. 2022	China Tower Corp Ltd-H, swap sur rendement total	(332)	(30)
(800)	29 juill. 2022	Chow Tai Fook Jewellery Grou, swap sur rendement total	(1 941)	(155)
(113 000)	29 juill. 2022	Cosco Shipping Development-H, swap sur rendement total	(29 164)	747
(6 000)	29 juill. 2022	Cosco Shipping Energy Tran-H, swap sur rendement total	(4 932)	1
(4 002)	29 juill. 2022	Cosco Shipping Holdings Co-H, swap sur rendement total	(7 783)	1 131
(15 990)	29 juill. 2022	Cosmopolitan Intl Hldgs, swap sur rendement total	(4 363)	(841)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(2 000)	29 juill. 2022	Cpmc Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 118)	(53)
(1 000)	29 juill. 2022	Dexin China Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(462)	(39)
(8 400)	29 juill. 2022	Dongfang Electric Corp Ltd-H, swap sur rendement total	(12 980)	(551)
(11 002)	29 juill. 2022	Dynagreen Environmental Pr-H, swap sur rendement total	(6 113)	(180)
(96 053)	29 juill. 2022	Esprit Holdings Ltd, swap sur rendement total	(22 264)	(946)
(536)	29 juill. 2022	Esr Cayman Ltd, swap sur rendement total	(1 868)	142
(6 000)	29 juill. 2022	Ever Sunshine Lifestyle Serv, swap sur rendement total	(9 863)	(888)
(1 000)	29 juill. 2022	Flat Glass Group Co Ltd-H, swap sur rendement total	(4 537)	425
(1 500)	29 juill. 2022	Fosun International Ltd, swap sur rendement total	(1 862)	106
(22 000)	29 juill. 2022	Future Land Development Hold, swap sur rendement total	(14 032)	(1 976)
(8 000)	29 juill. 2022	Gemdale Properties And Inves, swap sur rendement total	(1 013)	(13)
(5 000)	29 juill. 2022	Greatview Aseptic Packaging, swap sur rendement total	(1 290)	386
(14 000)	29 juill. 2022	Guangdong Investment Ltd, swap sur rendement total	(20 081)	2 572
(79 000)	29 juill. 2022	Guotai Junan International, swap sur rendement total	(12 078)	(778)
(10 240)	29 juill. 2022	Haidilao International Holdi, swap sur rendement total	(30 805)	(4 542)
(2 200)	29 juill. 2022	Haitong International Securi, swap sur rendement total	(405)	(17)
(1 200)	29 juill. 2022	Haitong Securities Co Ltd-H, swap sur rendement total	(1 136)	(39)
(1 000)	29 juill. 2022	Hang Lung Properties Ltd, swap sur rendement total	(2 446)	(41)
(4 500)	29 juill. 2022	Hengan Intl Group Co Ltd, swap sur rendement total	(27 260)	1 556
(1 000)	29 juill. 2022	Hk Electric Investments -Ss, swap sur rendement total	(1 184)	51
(16 500)	29 juill. 2022	Hkbn Ltd, swap sur rendement total	(24 168)	2 904
(1 013)	29 juill. 2022	Hong Kong & China Gas, swap sur rendement total	(1 407)	67
(4 000)	29 juill. 2022	Huadian Power Intl Corp-H, swap sur rendement total	(1 881)	(44)
(2 000)	29 juill. 2022	Huaneng Power Intl Inc-H, swap sur rendement total	(1 286)	17
(4 000)	29 juill. 2022	Hutchison Telecomm Hong Kong, swap sur rendement total	(986)	(24)
(2 200)	29 juill. 2022	Imax China Holding Inc, swap sur rendement total	(2 870)	258
(3 000)	29 juill. 2022	Ind & Comm Bk Of China-H, swap sur rendement total	(2 298)	25
(6 000)	29 juill. 2022	Jiayuan International Group, swap sur rendement total	(429)	(76)
(5 000)	29 juill. 2022	Jinchuan Group International, swap sur rendement total	(847)	(156)
(3 000)	29 juill. 2022	Js Global Lifestyle Co Ltd, swap sur rendement total	(5 242)	(1 067)
(16 222)	29 juill. 2022	Kwg Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	(6 667)	(79)
(3 000)	29 juill. 2022	Lee & Man Paper Manufacturin, swap sur rendement total	(1 662)	222
(100)	29 juill. 2022	Link Reit, swap sur rendement total	(1 076)	123
(1 200)	29 juill. 2022	Livzon Pharmaceutical Grou-H, swap sur rendement total	(5 356)	(384)
(4 000)	29 juill. 2022	Luoyang Glass Company Ltd-H, swap sur rendement total	(9 679)	(1 670)
(500)	29 juill. 2022	Luye Pharma Group Ltd, swap sur rendement total	(212)	(10)
(20 000)	29 juill. 2022	Lvgem China Real Estate Inve, swap sur rendement total	(3 978)	(1 150)
(2 000)	29 juill. 2022	Maoyan Entertainment, swap sur rendement total	(2 630)	(582)
(6 400)	29 juill. 2022	Mgm China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(4 682)	(503)
(4 600)	29 juill. 2022	Midea Real Estate Holding Lt, swap sur rendement total	(10 798)	(1 408)
(7 000)	29 juill. 2022	Nexteer Automotive Group Ltd, swap sur rendement total	(6 501)	(655)
(5 000)	29 juill. 2022	Nine Dragons Paper Holdings, swap sur rendement total	(5 523)	255
(15 000)	29 juill. 2022	Nissin Foods Co Ltd, swap sur rendement total	(12 946)	(344)
(1 000)	29 juill. 2022	Pacific Textiles Holdings, swap sur rendement total	(516)	77
(32 000)	29 juill. 2022	Panda Green Energy Group Ltd, swap sur rendement total	(1 284)	58
(10 000)	29 juill. 2022	Pccw Ltd, swap sur rendement total	(6 822)	214
(1 350)	29 juill. 2022	Pharmaron Beijing Co Ltd-H, swap sur rendement total	(17 499)	(3 135)
(15 000)	29 juill. 2022	Poly Property Group Co Ltd, swap sur rendement total	(4 993)	(357)
(500)	29 juill. 2022	Powerlong Commercial Managem, swap sur rendement total	(462)	51
(1 000)	29 juill. 2022	Prada S.P.A., swap sur rendement total	(7 225)	723
(6 000)	29 juill. 2022	Prosperity Reit, swap sur rendement total	(2 367)	285
(13 000)	29 juill. 2022	Q Technology Group Co Ltd, swap sur rendement total	(11 540)	25
(6 000)	29 juill. 2022	Qingling Motors Co Ltd-H, swap sur rendement total	(1 302)	149
(796)	29 juill. 2022	Red Star Macalline Group C-H, swap sur rendement total	(433)	(9)
(2 000)	29 juill. 2022	Redco Properties Group Ltd, swap sur rendement total	(661)	(13)
(13 987)	29 juill. 2022	Redsun Properties Group Ltd, swap sur rendement total	(5 909)	(367)
(8 000)	29 juill. 2022	Regal International Airport, swap sur rendement total	(30 379)	(8 976)
(12 000)	29 juill. 2022	Ronshine China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(3 847)	276
(5 200)	29 juill. 2022	Sands China Ltd, swap sur rendement total	(16 002)	(3 121)
(400)	29 juill. 2022	Shandong Weigao Gp Medical-H, swap sur rendement total	(604)	(32)
(8 000)	29 juill. 2022	Shanghai Fudan-Zhangjiang-H, swap sur rendement total	(4 471)	(381)
(300)	29 juill. 2022	Shanghai Haohai Biological-H, swap sur rendement total	(2 047)	(399)
(300)	29 juill. 2022	Shanghai Henlius Biotech I-H, swap sur rendement total	(871)	15

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(6 000)	29 juill. 2022	Shanghai Industrial Urban De, swap sur rendement total	(661)	-
(3 192)	29 juill. 2022	Shanghai Pharmaceuticals-H, swap sur rendement total	(6 821)	(114)
(2 000)	29 juill. 2022	Shangri-La Asia Ltd, swap sur rendement total	(2 091)	(141)
(2 000)	29 juill. 2022	Shenzhen Expressway Co-H, swap sur rendement total	(2 680)	50
(2 000)	29 juill. 2022	Shenzhen Investment Ltd, swap sur rendement total	(539)	16
(4 000)	29 juill. 2022	Shougang Fushan Resources Gr, swap sur rendement total	(2 144)	92
(18 500)	29 juill. 2022	Shui On Land Ltd, swap sur rendement total	(3 224)	152
(4 000)	29 juill. 2022	Shun Tak Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 032)	40
(4 000)	29 juill. 2022	Sichuan Expressway Co-H, swap sur rendement total	(1 374)	7
(1 000)	29 juill. 2022	Sihuan Pharmaceutical Hldgs, swap sur rendement total	(210)	(24)
(14 000)	29 juill. 2022	Sinopec Kantons Holdings, swap sur rendement total	(6 191)	(27)
(2 800)	29 juill. 2022	Sinopharm Group Co-H, swap sur rendement total	(9 100)	(154)
(11 000)	29 juill. 2022	Smartone Telecommunications, swap sur rendement total	(7 486)	36
(1 500)	29 juill. 2022	Soho China Ltd, swap sur rendement total	(367)	-
(2 000)	29 juill. 2022	Ssy Group Ltd, swap sur rendement total	(1 378)	(207)
(1 000)	29 juill. 2022	Sunevision Holdings, swap sur rendement total	(983)	26
(600)	29 juill. 2022	Swire Properties Ltd, swap sur rendement total	(1 921)	(28)
(5 000)	29 juill. 2022	Tai Cheung Holdings, swap sur rendement total	(3 682)	25
(2 000)	29 juill. 2022	Television Broadcasts Ltd, swap sur rendement total	(1 417)	66
(10 000)	29 juill. 2022	Tiangong Intl Co Ltd, swap sur rendement total	(4 750)	(475)
(14 000)	29 juill. 2022	Times Neighborhood Holdings, swap sur rendement total	(4 067)	(39)
(2 000)	29 juill. 2022	Tong Ren Tang Technologies-H, swap sur rendement total	(2 219)	(286)
(800)	29 juill. 2022	Transport Intl Hldg Ltd, swap sur rendement total	(1 552)	54
(2 000)	29 juill. 2022	Travelsky Technology Ltd-H, swap sur rendement total	(5 029)	(833)
(3 000)	29 juill. 2022	Value Partners Group Ltd, swap sur rendement total	(1 460)	89
(3 500)	29 juill. 2022	Venus Medtech Hangzhou Inc-H, swap sur rendement total	(10 069)	(2 278)
(14 000)	29 juill. 2022	Vitasoy Intl Holdings Ltd, swap sur rendement total	(31 576)	785
(5 503)	29 juill. 2022	Viva Biotech Holdings, swap sur rendement total	(2 461)	(208)
(8 000)	29 juill. 2022	Vobile Group Ltd, swap sur rendement total	(6 102)	(723)
(2 000)	29 juill. 2022	Vpower Group International H, swap sur rendement total	(276)	20
(300)	29 juill. 2022	Vtech Holdings Ltd, swap sur rendement total	(3 043)	(141)
(1 000)	29 juill. 2022	Want Want China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 121)	163
(62 667)	29 juill. 2022	We Solutions Ltd, swap sur rendement total	(3 503)	(309)
(700)	29 juill. 2022	Wuxi Aptec Co Ltd-H, swap sur rendement total	(12 025)	(879)
(16 800)	29 juill. 2022	Wynn Macau Ltd, swap sur rendement total	(14 720)	(2 071)
(2 000)	29 juill. 2022	Xiabuxiabu Catering Managem, swap sur rendement total	(1 410)	(223)
(2 000)	29 juill. 2022	Xinhua Winshare Publishing-H, swap sur rendement total	(1 940)	(167)
(3 800)	29 juill. 2022	Xinjiang Goldwind Sci&Tec-H, swap sur rendement total	(9 326)	(1 292)
(5 999)	29 juill. 2022	Yanzhou Coal Mining Co-H, swap sur rendement total	(24 260)	1 196
(11 997)	29 juill. 2022	Yichang Hec Changjiang Pha-H, swap sur rendement total	(14 298)	(3 904)
(2 000)	29 juill. 2022	Yuexiu Property Co Ltd, swap sur rendement total	(3 415)	(611)
(38 435)	29 juill. 2022	Yuexiu Real Estate Investmen, swap sur rendement total	(19 334)	318
(3 500)	29 juill. 2022	Zhaojin Mining Industry - H, swap sur rendement total	(3 947)	(5)
(6 000)	29 juill. 2022	Zhejiang Expressway Co-H, swap sur rendement total	(7 141)	(305)
(11 000)	29 juill. 2022	Zhenro Properties Group Ltd, swap sur rendement total	(1 049)	(18)
(2 000)	29 juill. 2022	Zhuguang Holdings Group Co, swap sur rendement total	(368)	30
(5 399)	29 juill. 2022	Zhuzhou Crrc Times Electri-H, swap sur rendement total	(34 747)	(4 923)
(41 200)	29 juill. 2022	Zoomlion Heavy Industry - H, swap sur rendement total	(30 545)	2 213
				<u>(53 734)</u>
Nouveau shekel israélien – taux interbancaire offert à Tel Aviv (TELBOR) à 1 mois				
(1)	29 juill. 2022	El Al Israel Airlines, swap sur rendement total	(1)	-
				<u>-</u>
Yen japonais – taux moyen du financement à un jour offert à Tokyo (TONAR)				
(100)	29 juill. 2022	Achilles Corp, swap sur rendement total	(1 275)	22
(100)	29 juill. 2022	Aeon Hokkaido Corp, swap sur rendement total	(1 031)	(13)
(100)	29 juill. 2022	Aoki Holdings Inc, swap sur rendement total	(662)	(23)
(100)	29 juill. 2022	Arcs Co Ltd, swap sur rendement total	(1 900)	(62)
(200)	29 juill. 2022	Aska Pharmaceutical Holdings, swap sur rendement total	(1 908)	(41)
(500)	29 juill. 2022	Atom Corp, swap sur rendement total	(3 713)	(32)
(200)	29 juill. 2022	Chugai Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(6 590)	127
(100)	29 juill. 2022	Cosel Co Ltd, swap sur rendement total	(777)	14
(100)	29 juill. 2022	Daido Metal Co Ltd, swap sur rendement total	(494)	2
(100)	29 juill. 2022	Dowa Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(4 277)	(92)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(100)	29 juill. 2022	Duskin Co Ltd, swap sur rendement total	(2 746)	(168)
(100)	29 juill. 2022	East Japan Railway Co, swap sur rendement total	(6 588)	(199)
(100)	29 juill. 2022	E-Guardian Inc, swap sur rendement total	(2 673)	133
(200)	29 juill. 2022	Gree Inc, swap sur rendement total	(1 565)	95
(100)	29 juill. 2022	Imasen Electric Industrial, swap sur rendement total	(555)	9
(100)	29 juill. 2022	Intage Holdings Inc, swap sur rendement total	(1 212)	130
(100)	29 juill. 2022	Japan Post Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(920)	(10)
(200)	29 juill. 2022	Kddi Corp, swap sur rendement total	(8 145)	379
(500)	29 juill. 2022	Kirin Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(10 148)	(543)
(100)	29 juill. 2022	Kokuyo Co Ltd, swap sur rendement total	(1 631)	(62)
(300)	29 juill. 2022	Komatsu Ltd, swap sur rendement total	(8 568)	436
(100)	29 juill. 2022	Kurimoto Ltd, swap sur rendement total	(1 566)	(17)
(100)	29 juill. 2022	M3 Inc, swap sur rendement total	(3 701)	(152)
(400)	29 juill. 2022	Maezawa Kasei Industries Co, swap sur rendement total	(4 854)	(7)
(100)	29 juill. 2022	Max Co Ltd, swap sur rendement total	(1 530)	(1)
(100)	29 juill. 2022	Maxvalu Tokai Co Ltd, swap sur rendement total	(2 571)	-
(100)	29 juill. 2022	Ministop Co Ltd, swap sur rendement total	(1 389)	(50)
(400)	29 juill. 2022	Mito Securities Co Ltd, swap sur rendement total	(987)	14
(300)	29 juill. 2022	Mitsubishi Electric Corp, swap sur rendement total	(4 133)	(46)
(100)	29 juill. 2022	Mitsubishi Motors Corp, swap sur rendement total	(436)	-
(100)	29 juill. 2022	Mitsubishi Ufj Financial Gro, swap sur rendement total	(693)	-
(300)	29 juill. 2022	Mitsui Fudosan Co Ltd, swap sur rendement total	(8 310)	(138)
(100)	29 juill. 2022	Mitsuuroko Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(881)	17
(1)	29 juill. 2022	Mori Hills Reit Investment C, swap sur rendement total	(1 446)	(1)
(200)	29 juill. 2022	Nissan Motor Co Ltd, swap sur rendement total	(1 003)	8
(500)	29 juill. 2022	Olympus Corp, swap sur rendement total	(12 944)	(79)
(100)	29 juill. 2022	Ono Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(3 306)	(121)
(100)	29 juill. 2022	Optim Corp, swap sur rendement total	(710)	84
(100)	29 juill. 2022	Oracle Corp Japan, swap sur rendement total	(7 463)	(129)
(100)	29 juill. 2022	Pilot Corp, swap sur rendement total	(4 591)	189
(400)	29 juill. 2022	Plenus Co Ltd, swap sur rendement total	(7 577)	(181)
(100)	29 juill. 2022	Ringer Hut Co Ltd, swap sur rendement total	(2 211)	(60)
(100)	29 juill. 2022	Round One Corp, swap sur rendement total	(1 450)	(16)
(100)	29 juill. 2022	Saibu Gas Co Ltd, swap sur rendement total	(1 792)	(48)
(200)	29 juill. 2022	Sekisui Plastics Co Ltd, swap sur rendement total	(775)	(5)
(100)	29 juill. 2022	Shoei Co Ltd, swap sur rendement total	(5 042)	(460)
(1 700)	29 juill. 2022	Softbank Corp, swap sur rendement total	(24 317)	(462)
(100)	29 juill. 2022	Softbank Group Corp, swap sur rendement total	(4 971)	85
(100)	29 juill. 2022	Sotetsu Holdings Inc, swap sur rendement total	(2 228)	(94)
(100)	29 juill. 2022	Taiyo Yuden Co Ltd, swap sur rendement total	(4 377)	433
(100)	29 juill. 2022	Takamiya Co Ltd, swap sur rendement total	(373)	(27)
(500)	29 juill. 2022	Tanseisha Co Ltd, swap sur rendement total	(3 874)	44
(400)	29 juill. 2022	Toppa Printing Co Ltd, swap sur rendement total	(8 610)	185
(100)	29 juill. 2022	Topy Industries Ltd, swap sur rendement total	(1 295)	(27)
(100)	29 juill. 2022	Yotai Refractories Co Ltd, swap sur rendement total	(1 325)	45
				(915)
Dollar néo-zélandais – taux du marché des acceptations bancaires (BKBM) à 1 mois				
(246)	29 juill. 2022	Fisher & Paykel Healthcare C, swap sur rendement total	(4 004)	98
(8 354)	29 juill. 2022	Kiwi Property Group Ltd, swap sur rendement total	(6 533)	292
(949)	29 juill. 2022	Meridian Energy Ltd, swap sur rendement total	(3 562)	(10)
(1 639)	29 juill. 2022	Pacific Edge Ltd, swap sur rendement total	(894)	47
(2 463)	29 juill. 2022	Precinct Properties New Zeal, swap sur rendement total	(2 706)	5
(101)	29 juill. 2022	Restaurant Brands Nz Ltd, swap sur rendement total	(876)	69
(490)	29 juill. 2022	Sanford Limited, swap sur rendement total	(1 615)	58
(418)	29 juill. 2022	Serko Ltd, swap sur rendement total	(1 240)	(25)
(1 735)	29 juill. 2022	Synlait Milk Ltd, swap sur rendement total	(4 342)	379
				913
Couronne norvégienne – taux interbancaire offert en Norvège (NIBOR) à 1 mois				
(1)	29 juill. 2022	Norway Royal Salmon Asa, swap sur rendement total	(33)	-
				-
Dollar de Singapour – taux interbancaire offert à Singapour (SIBOR) à 1 mois				
(700)	29 juill. 2022	Aims Apac Reit, swap sur rendement total	(876)	14
(500)	29 juill. 2022	Ascendas Real Estate Inv Trt, swap sur rendement total	(1 321)	(31)
(11 800)	29 juill. 2022	Ascott Residence Trust, swap sur rendement total	(12 468)	222
(500)	29 juill. 2022	Capitaland China Trust, swap sur rendement total	(533)	(2)
(6 965)	29 juill. 2022	Esr-Reit, swap sur rendement total	(2 615)	30
(25 700)	29 juill. 2022	Far East Hospitality Trust, swap sur rendement total	(15 245)	256

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(307)	29 juill. 2022	First Real Estate Inv Trust, swap sur rendement total	(78)	3
(1 072)	29 juill. 2022	Frasers Centrepoint Trust, swap sur rendement total	(2 275)	(33)
(11 287)	29 juill. 2022	Frasers Hospitality Trust, swap sur rendement total	(7 323)	(490)
(1 400)	29 juill. 2022	Frasers Logistics & Industri, swap sur rendement total	(1 726)	20
(300)	29 juill. 2022	Ho Bee Land Ltd, swap sur rendement total	(770)	8
(600)	29 juill. 2022	Keppel Dc Reit, swap sur rendement total	(1 096)	42
(604)	29 juill. 2022	Keppel Infrastructure Trust, swap sur rendement total	(319)	(3)
(500)	29 juill. 2022	Mapletree Commercial Trust, swap sur rendement total	(848)	(23)
(1 300)	29 juill. 2022	Mapletree Industrial Trust, swap sur rendement total	(3 133)	(142)
(2 500)	29 juill. 2022	Mapletree North Asia Commerc, swap sur rendement total	(2 781)	26
(1 000)	29 juill. 2022	Oue Commercial Real Estate I, swap sur rendement total	(357)	9
(600)	29 juill. 2022	Oue Ltd, swap sur rendement total	(712)	19
(16 200)	29 juill. 2022	Raffles Medical Group Ltd, swap sur rendement total	(16 817)	919
(560)	29 juill. 2022	Sats Ltd, swap sur rendement total	(2 024)	222
(5 924)	29 juill. 2022	Sembcorp Marine Ltd, swap sur rendement total	(593)	61
(3 347)	29 juill. 2022	Singapore Airlines Ltd, swap sur rendement total	(15 822)	1 278
(600)	29 juill. 2022	Singapore Exchange Ltd, swap sur rendement total	(5 261)	45
(800)	29 juill. 2022	Starhill Global Reit, swap sur rendement total	(430)	(1)
(1 200)	29 juill. 2022	Suntec Reit, swap sur rendement total	(1 802)	62
(2 207)	29 juill. 2022	Thomson Medical Group Ltd, swap sur rendement total	(162)	4
(1 000)	29 juill. 2022	Ums Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 029)	1 186
				<u>3 701</u>
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
(696)	29 juill. 2022	Attacq Ltd, swap sur rendement total	(304)	69
(562)	29 juill. 2022	Fortress Reit Ltd-A, swap sur rendement total	(473)	77
(1 418)	29 juill. 2022	Growthpoint Properties Ltd, swap sur rendement total	(1 379)	230
(945)	29 juill. 2022	Kap Industrial Holdings Ltd, swap sur rendement total	(327)	23
(7)	29 juill. 2022	Kumba Iron Ore Ltd, swap sur rendement total	(290)	42
(256)	29 juill. 2022	Nepi Rockcastle Plc, swap sur rendement total	(1 756)	212
(100)	29 juill. 2022	Resilient Reit Ltd, swap sur rendement total	(421)	10
(280)	29 juill. 2022	Rmb Holdings Ltd, swap sur rendement total	(38)	(4)
(80)	29 juill. 2022	Woolworths Holdings Ltd, swap sur rendement total	(342)	18
				<u>677</u>
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
(16)	29 juill. 2022	Aak Ab, swap sur rendement total	(336)	(11)
(559)	29 juill. 2022	Academedia Ab, swap sur rendement total	(3 207)	125
(40)	29 juill. 2022	Addlife Ab-B, swap sur rendement total	(773)	383
(1 329)	29 juill. 2022	Afry Ab, swap sur rendement total	(23 488)	2 739
(11)	29 juill. 2022	Axfood Ab, swap sur rendement total	(408)	(23)
(33)	29 juill. 2022	Bactiguard Holding Ab, swap sur rendement total	(465)	(47)
(267)	29 juill. 2022	Betsson Ab, swap sur rendement total	(2 079)	158
(15)	29 juill. 2022	Better Collective A/S, swap sur rendement total	(258)	18
(15)	29 juill. 2022	Bico Group Ab, swap sur rendement total	(168)	77
(441)	29 juill. 2022	Bonava Ab- actions, B, swap sur rendement total	(1 649)	461
(429)	29 juill. 2022	Bravida Holding Ab, swap sur rendement total	(4 812)	148
(32)	29 juill. 2022	Bulten Ab, swap sur rendement total	(258)	2
(280)	29 juill. 2022	Bygghemma Group First Ab, swap sur rendement total	(1 143)	497
(417)	29 juill. 2022	Castellum Ab, swap sur rendement total	(6 900)	2 825
(34)	29 juill. 2022	Catena Ab, swap sur rendement total	(1 589)	165
(398)	29 juill. 2022	Cellavision Ab, swap sur rendement total	(16 934)	300
(224)	29 juill. 2022	Cibus Nordic Real Estate Ab, swap sur rendement total	(4 452)	1 320
(20)	29 juill. 2022	Ctt Systems Ab, swap sur rendement total	(498)	18
(477)	29 juill. 2022	Dios Fastigheter Ab, swap sur rendement total	(4 266)	708
(671)	29 juill. 2022	Duni Ab, swap sur rendement total	(6 892)	591
(268)	29 juill. 2022	Eolus Vind Ab- actions, B, swap sur rendement total	(2 617)	630
(23)	29 juill. 2022	Fabege Ab, swap sur rendement total	(283)	56
(36)	29 juill. 2022	Fastighets Ab Balder- actions, B, swap sur rendement total	(222)	24
(441)	29 juill. 2022	Fingerprint Cards Ab-B, swap sur rendement total	(497)	78
(134)	29 juill. 2022	Granges Ab, swap sur rendement total	(1 290)	188
(76)	29 juill. 2022	Jm Ab, swap sur rendement total	(1 620)	443
(244)	29 juill. 2022	Kambi Group Plc, swap sur rendement total	(5 142)	1 693
(257)	29 juill. 2022	Karo Pharma Ab, swap sur rendement total	(1 624)	253
(131)	29 juill. 2022	Loomis Ab, swap sur rendement total	(4 103)	(35)
(6 798)	29 juill. 2022	Lundin Energy Ab, swap sur rendement total	(5 982)	3 252
(158)	29 juill. 2022	Lundin Energy Mergerco Ab, swap sur rendement total	-	-
(508)	29 juill. 2022	Modern Times Group- actions, B, swap sur rendement total	(6 852)	435
(12)	29 juill. 2022	Mycronic Ab, swap sur rendement total	(217)	53
(1 746)	29 juill. 2022	Pandox Ab, swap sur rendement total	(25 210)	4 181

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(20)	29 juill. 2022	Powercell Sweden Ab, swap sur rendement total	(341)	26
(394)	29 juill. 2022	Pricer Ab- actions, B, swap sur rendement total	(764)	62
(79 097)	29 juill. 2022	Sas Ab, swap sur rendement total	(6 446)	1 952
(3 032)	29 juill. 2022	Sinch Ab, swap sur rendement total	(12 708)	5 251
(50)	29 juill. 2022	Ssab Ab- actions, A, swap sur rendement total	(281)	98
(3 960)	29 juill. 2022	Stillfront Group Ab, swap sur rendement total	(11 251)	1 163
(145)	29 juill. 2022	Storytel Ab, swap sur rendement total	(892)	340
(777)	29 juill. 2022	Svenska Handelsbanken- actions, A, swap sur rendement total	(8 551)	713
(81)	29 juill. 2022	Swedbank Ab – actions, A, swap sur rendement total	(1 318)	160
(493)	29 juill. 2022	Tele2 Ab- actions, B, swap sur rendement total	(7 230)	165
(1 966)	29 juill. 2022	Telia Co Ab, swap sur rendement total	(9 696)	206
(24)	29 juill. 2022	Trelleborg Ab-actions, B, swap sur rendement total	(623)	61
(53)	29 juill. 2022	Vitrolife Ab, swap sur rendement total	(1 569)	311
				<u>32 213</u>
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
(322)	29 juill. 2022	Adecco Group Ag- actions ord, swap sur rendement total	(14 075)	2 028
(437)	29 juill. 2022	Ams Ag, swap sur rendement total	(5 063)	1 331
(11)	29 juill. 2022	Baloise Holding Ag - actions ord, swap sur rendement total	(2 311)	76
(24)	29 juill. 2022	Bucher Industries Ag- actions ord, swap sur rendement total	(10 736)	372
(3)	29 juill. 2022	Burckhardt Compression Holdi, swap sur rendement total	(1 619)	241
(94)	29 juill. 2022	Cie Financière Richemont- actions ord, swap sur rendement total	(12 875)	403
(2 420)	29 juill. 2022	Evolva Holding Sa, swap sur rendement total	(290)	58
(1 083)	29 juill. 2022	Gam Holding Ag, swap sur rendement total	(1 153)	360
(19)	29 juill. 2022	Geberit Ag- actions ord, swap sur rendement total	(11 746)	475
(10)	29 juill. 2022	Gurit Holding Ag-Br, swap sur rendement total	(1 366)	45
(343)	29 juill. 2022	Implenia Ag- actions ord, swap sur rendement total	(10 098)	(254)
(56)	29 juill. 2022	Kuehne + Nagel Intl Ag- actions ord, swap sur rendement total	(17 053)	1 648
(1 072)	29 juill. 2022	Meyer Burger Technology Ag, swap sur rendement total	(584)	63
(1)	29 juill. 2022	Mobimo Holding Ag- actions ord, swap sur rendement total	(313)	25
(8)	29 juill. 2022	Schindler Holding-Part Cert, swap sur rendement total	(1 877)	(3)
(1)	29 juill. 2022	Sgs Sa- actions ord, swap sur rendement total	(2 944)	16
(76)	29 juill. 2022	Sig Combibloc Group Ag, swap sur rendement total	(2 153)	(56)
(22)	29 juill. 2022	Sika Ag- actions ord, swap sur rendement total	(6 521)	79
(29)	29 juill. 2022	Softwareone Holding Ag, swap sur rendement total	(447)	42
(3)	29 juill. 2022	Straumann Holding Ag- actions ord, swap sur rendement total	(463)	(45)
(2)	29 juill. 2022	Swatch Group Ag/The-Br, swap sur rendement total	(610)	46
(2)	29 juill. 2022	Swisscom Ag- actions ord, swap sur rendement total	(1 421)	(10)
(12)	29 juill. 2022	Temenos Ag - actions ord, swap sur rendement total	(1 320)	(49)
(2)	29 juill. 2022	Vat Group Ag, swap sur rendement total	(613)	27
				<u>6 918</u>
Dollar américain – taux interbancaire offert à Londres (ICE LIBOR) à 1 mois				
(24)	29 juill. 2022	Ace Technologies Corp, swap sur rendement total	(170)	87
(251)	29 juill. 2022	Advanced Process Systems Cor, swap sur rendement total	(4 137)	1 507
(110)	29 juill. 2022	Alteogen Inc, swap sur rendement total	(6 674)	(53)
(1 000)	29 juill. 2022	Alupar Investimento Sa- parts, swap sur rendement total	(6 396)	726
(8 200)	29 juill. 2022	Americanas Sa -, swap sur rendement total	(27 143)	17 792
(119)	29 juill. 2022	Ananti Inc, swap sur rendement total	(788)	164
(1 600)	29 juill. 2022	Axtel Sab De Cv - Cpo, swap sur rendement total	(157)	9
(1 365)	29 juill. 2022	Banco Abc Brasil Sa, swap sur rendement total	(5 222)	646
(3 200)	29 juill. 2022	Banpu Public Co Ltd, swap sur rendement total	(1 473)	4
(100)	29 juill. 2022	Becle Sab De Cv, swap sur rendement total	(279)	4
(58)	29 juill. 2022	Boryung Pharmaceutical Co, swap sur rendement total	(585)	140
(2 600)	29 juill. 2022	Br Properties Sa, swap sur rendement total	(5 671)	444
(1 125)	29 juill. 2022	Bukwang Pharmaceutical Co, swap sur rendement total	(9 451)	3 107
(53)	29 juill. 2022	Cafe24 Corp, swap sur rendement total	(650)	253
(4 800)	29 juill. 2022	Camil Alimentos Sa, swap sur rendement total	(11 641)	914
(12)	29 juill. 2022	Cellivery Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(277)	74
(1 009)	29 juill. 2022	Celltrion Healthcare Co Ltd, swap sur rendement total	(68 731)	(3 727)
(4)	29 juill. 2022	Celltrion Inc, swap sur rendement total	(709)	(37)
(341)	29 juill. 2022	Celltrion Pharm Inc, swap sur rendement total	(26 648)	2 452
(300)	29 juill. 2022	Centro De Imagem Diagnostico, swap sur rendement total	(1 443)	162
(4)	29 juill. 2022	Chong Kun Dang Pharma -, swap sur rendement total	(348)	33
(1 000)	29 juill. 2022	Chun Yuan Steel Industry Co, swap sur rendement total	(694)	180
(500)	29 juill. 2022	Cia De Transmissao De Ene- actions priv., swap sur rendement total	(2 831)	336
(53 100)	29 juill. 2022	Cielo Sa, swap sur rendement total	(49 079)	8 121
(2)	29 juill. 2022	Cj Cheiljedang Corp, swap sur rendement total	(753)	68
(270)	29 juill. 2022	Cj Logistics Corp, swap sur rendement total	(30 564)	5 683
(11 700)	29 juill. 2022	Cogna Educacional Sa, swap sur rendement total	(6 171)	2 277

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(1)	29 juill. 2022	Commercial Intl Bank- CIAE, actions ord., swap sur rendement total	(2)	-
(1 500)	29 juill. 2022	Consortio Ara S.A.B.- série *, swap sur rendement total	(334)	48
(5 000)	29 juill. 2022	Construtora Tenda Sa, swap sur rendement total	(4 806)	2 022
(5 300)	29 juill. 2022	Cosan Sa Industria Comercio - swap sur rendement total	(23 775)	7 148
(518)	29 juill. 2022	Crystalgenomics Inc, swap sur rendement total	(2 083)	646
(78)	29 juill. 2022	Cs Wind Corp, swap sur rendement total	(4 477)	180
(6 600)	29 juill. 2022	Cyrela Brazil Realty Sa Emp, swap sur rendement total	(19 228)	4 164
(95)	29 juill. 2022	Dairy Farm Intl Hldgs Ltd, swap sur rendement total	(359)	(27)
(1 000)	29 juill. 2022	Da-Li Development Co Ltd, swap sur rendement total	(1 299)	60
(367)	29 juill. 2022	Daou Data Corp, swap sur rendement total	(3 717)	1 323
(16)	29 juill. 2022	Dawonsys Co Ltd - swap sur rendement total	(381)	273
(400)	29 juill. 2022	Dexco Sa, swap sur rendement total	(973)	235
(72)	29 juill. 2022	DI Co Ltd, swap sur rendement total	(5 069)	204
(229)	29 juill. 2022	Dongbu Hitek Co Ltd, swap sur rendement total	(11 358)	5 066
(81)	29 juill. 2022	Doosan Fuel Cell Co Ltd, swap sur rendement total	(2 417)	836
(699)	29 juill. 2022	Doosan Heavy Industries, swap sur rendement total	(13 465)	1 646
(76)	29 juill. 2022	Duk San Neolux Co Ltd, swap sur rendement total	(2 272)	479
(20)	29 juill. 2022	Ecopro Bm Co Ltd, swap sur rendement total	(2 254)	360
(1 000)	29 juill. 2022	El Puerto De Liverpool-C1, swap sur rendement total	(5 581)	1 233
(4 000)	29 juill. 2022	Ennostar Inc, swap sur rendement total	(9 143)	2 158
(2)	29 juill. 2022	Enzychem Lifesciences Corp, swap sur rendement total	(32)	10
(131)	29 juill. 2022	Eo Technics Co Ltd, swap sur rendement total	(10 484)	3 885
(1 000)	29 juill. 2022	Even Construtora E Inco Sa - swap sur rendement total	(1 067)	303
(5 100)	29 juill. 2022	Ez Tec Empreendimentos E Par, swap sur rendement total	(18 164)	4 463
(34)	29 juill. 2022	Feelux Co Ltd, swap sur rendement total	(50)	24
(72)	29 juill. 2022	Fila Korea Ltd, swap sur rendement total	(2 009)	370
(2 200)	29 juill. 2022	Gaec Educacao Sa, swap sur rendement total	(2 115)	1 231
(3 238)	29 juill. 2022	Gafisa Sa, swap sur rendement total	(854)	426
(327)	29 juill. 2022	Genexine Co Ltd, swap sur rendement total	(9 920)	2 955
(2 600)	29 juill. 2022	Genomma Lab Internacional-B, swap sur rendement total	(3 357)	30
(34)	29 juill. 2022	Green Cross Corp, swap sur rendement total	(5 689)	1 122
(408)	29 juill. 2022	Green Cross Holdings Corp, swap sur rendement total	(7 941)	1 360
(15)	29 juill. 2022	Grupo Aeroport Del Sureste-B, swap sur rendement total	(380)	38
(600)	29 juill. 2022	Grupo Carso Sab De Cv- série A1, swap sur rendement total	(2 884)	152
(500)	29 juill. 2022	Grupo Cementos Chihuahua, swap sur rendement total	(4 032)	438
(100)	29 juill. 2022	Grupo Herdez Sab- série *, swap sur rendement total	(171)	25
(2 100)	29 juill. 2022	Grupo Mexico Sab De Cv- série B, swap sur rendement total	(11 216)	1 787
(586)	29 juill. 2022	Grupo Rotoplas Sab De Cv, swap sur rendement total	(937)	130
(400)	29 juill. 2022	Grupo Traxion Sab De Cv, swap sur rendement total	(703)	133
(160)	29 juill. 2022	Gs Holdings - swap sur rendement total	(6 649)	929
(17)	29 juill. 2022	Gs Retail Co Ltd, swap sur rendement total	(433)	44
(315)	29 juill. 2022	Hanall Biopharma Co Ltd, swap sur rendement total	(5 161)	480
(4)	29 juill. 2022	Hanmi Pharm Co Ltd - swap sur rendement total	(1 223)	68
(165)	29 juill. 2022	Hanon Systems, swap sur rendement total	(1 647)	324
(27)	29 juill. 2022	Hansae Co Ltd - swap sur rendement total	(454)	161
(229)	29 juill. 2022	Hanssem Co Ltd, swap sur rendement total	(14 667)	2 750
(281)	29 juill. 2022	Hanwha Chemical Corp, swap sur rendement total	(10 575)	869
(10 400)	29 juill. 2022	Hapvida Participacoes E Inve, swap sur rendement total	(14 021)	3 200
(113)	29 juill. 2022	Hdc Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(744)	107
(232)	29 juill. 2022	Hdc Hyundai Development Co-E, swap sur rendement total	(2 569)	766
(582)	29 juill. 2022	Helixmith Co Ltd, swap sur rendement total	(12 021)	1 500
(771)	29 juill. 2022	Hlb Inc, swap sur rendement total	(27 102)	9 495
(1 600)	29 juill. 2022	Hongkong Land Holdings Ltd, swap sur rendement total	(10 361)	(749)
(15)	29 juill. 2022	Hotel Shilla Co Ltd - swap sur rendement total	(1 060)	162
(147 250)	29 juill. 2022	Hoteles City Express Sab De, swap sur rendement total	(38 158)	1 537
(13)	29 juill. 2022	Hyundai Dept Store Co - swap sur rendement total	(905)	146
(84)	29 juill. 2022	Hyundai Greenfood Co Ltd, swap sur rendement total	(650)	83
(1 571)	29 juill. 2022	Hyundai Merchant Marine, swap sur rendement total	(38 375)	14 079
(6)	29 juill. 2022	Hyundai Robotics Co Ltd- swap sur rendement total	(354)	19
(1 163)	29 juill. 2022	Hyundai Rotem Company, swap sur rendement total	(24 020)	(542)
(101)	29 juill. 2022	Ilyang Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(2 226)	613
(45)	29 juill. 2022	Imarketkorea Inc, swap sur rendement total	(1 171)	112
(500)	29 juill. 2022	Industrias Romi Sa, swap sur rendement total	(1 503)	427
(300)	29 juill. 2022	Instituto Hermes Pardini Sa, swap sur rendement total	(1 472)	241
(6 375)	29 juill. 2022	International Meal Company - swap sur rendement total	(2 530)	1 121
(900)	29 juill. 2022	Irani Sa, swap sur rendement total	(1 480)	342
(4 000)	29 juill. 2022	Irb Brasil Resseguros Sa, swap sur rendement total	(2 001)	1 207
(15)	29 juill. 2022	Is Dongseo Co Ltd, swap sur rendement total	(581)	195

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(1)	29 juill. 2022	Itau Corpbanca, swap sur rendement total	(4)	-
(25)	29 juill. 2022	Itm Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	(771)	88
(12 500)	29 juill. 2022	Jhsf Participacoes Sa, swap sur rendement total	(17 962)	5 978
(240)	29 juill. 2022	Jusung Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	(4 027)	781
(25)	29 juill. 2022	Kcc Corp, swap sur rendement total	(7 137)	1 723
(1 600)	29 juill. 2022	Keppel Pacific Oak Us Reit, swap sur rendement total	(1 445)	(17)
(2 200)	29 juill. 2022	Kimberly-Clark De Mexico-A, swap sur rendement total	(3 843)	537
(32)	29 juill. 2022	Kolmar Bnh Co Ltd, swap sur rendement total	(855)	175
(124)	29 juill. 2022	Kolmar Korea Co Ltd - swap sur rendement total	(4 697)	639
(90)	29 juill. 2022	Komipharm International Co, swap sur rendement total	(637)	102
(129)	29 juill. 2022	Korea Investment Holdings Co, swap sur rendement total	(7 903)	1 733
(235)	29 juill. 2022	Koreacenter Co Ltd, swap sur rendement total	(1 157)	319
(2)	29 juill. 2022	L&F Co Ltd, swap sur rendement total	(417)	115
(7)	29 juill. 2022	Leeno Industrial Inc, swap sur rendement total	(904)	32
(314)	29 juill. 2022	Legochem Biosciences Inc, swap sur rendement total	(13 080)	466
(4)	29 juill. 2022	Lg Electronics Inc, swap sur rendement total	(351)	4
(1)	29 juill. 2022	Lg Innotek Co Ltd - swap sur rendement total	(340)	62
(5 072)	29 juill. 2022	Li Cheng Enterprise Co Ltd, swap sur rendement total	(6 313)	(921)
(3 225)	29 juill. 2022	Light Sa, swap sur rendement total	(4 594)	2 137
(8 700)	29 juill. 2022	Locaweb Servicos De Internet, swap sur rendement total	(12 051)	3 625
(300)	29 juill. 2022	Log Commercial Properties E - swap sur rendement total	(1 351)	411
(500)	29 juill. 2022	Log-In Logistica Intermodal, swap sur rendement total	(3 739)	894
(900)	29 juill. 2022	Lojas Americanas Sa - swap sur rendement total	(1 462)	(233)
(14)	29 juill. 2022	Lotte Shopping Co - swap sur rendement total	(1 446)	41
(7 000)	29 juill. 2022	Magazine Luiza Sa, swap sur rendement total	(4 106)	1 662
(113)	29 juill. 2022	Mando Corp, swap sur rendement total	(5 335)	1 163
(5 199)	29 juill. 2022	Manulife Us Real Estate Inv, swap sur rendement total	(3 823)	204
(14)	29 juill. 2022	Medpacto Inc, swap sur rendement total	(321)	120
(745)	29 juill. 2022	Meritz Securities Co Ltd, swap sur rendement total	(3 359)	1 375
(5 300)	29 juill. 2022	Metalurgica Gerdau Sa, swap sur rendement total	(12 475)	5 134
(108)	29 juill. 2022	Mezzion Pharma Co Ltd, swap sur rendement total	(1 769)	290
(1 600)	29 juill. 2022	Mills Estruturas E Servicos - swap sur rendement total	(2 307)	287
(5 235)	29 juill. 2022	Mirae Asset Daewoo Co Ltd, swap sur rendement total	(34 412)	10 153
(4 875)	29 juill. 2022	Mrv Engenharia - swap sur rendement total	(9 622)	3 055
(88)	29 juill. 2022	Nasmedia Co Ltd - swap sur rendement total	(9 621)	1 993
(4 500)	29 juill. 2022	Natura & Co Holding Sa, swap sur rendement total	(14 885)	5 257
(1)	29 juill. 2022	Ncsoft Co, swap sur rendement total	(347)	128
(20 100)	29 juill. 2022	Nemak Sab De Cv, swap sur rendement total	(5 131)	754
(11)	29 juill. 2022	Netmarble Corp, swap sur rendement total	(753)	153
(1 000)	29 juill. 2022	Newmax Technology Co Ltd, swap sur rendement total	(1 186)	159
(1 015)	29 juill. 2022	Nh Investment & Securities C, swap sur rendement total	(9 121)	2 317
(142)	29 juill. 2022	Nkmax Co Ltd, swap sur rendement total	(2 094)	906
(6)	29 juill. 2022	Oci Co Ltd, swap sur rendement total	(855)	(46)
(2 600)	29 juill. 2022	Omega Energia Sa, swap sur rendement total	(7 690)	(222)
(326)	29 juill. 2022	Optoelectronics Solutions Co, swap sur rendement total	(7 332)	2 361
(481)	29 juill. 2022	Oscotec Inc, swap sur rendement total	(13 254)	1 476
(53)	29 juill. 2022	Pan Ocean Co Ltd, swap sur rendement total	(313)	106
(274)	29 juill. 2022	Poongsan Corp - swap sur rendement total	(6 747)	1 297
(30)	29 juill. 2022	Posco Daewoo Corp - swap sur rendement total	(573)	167
(1 400)	29 juill. 2022	Positivo Tecnologia Sa - swap sur rendement total	(1 991)	818
(1 000)	29 juill. 2022	Qualicorp Sa, swap sur rendement total	(2 748)	300
(3)	29 juill. 2022	Samsung Sds Co Ltd, swap sur rendement total	(387)	78
(455)	29 juill. 2022	Samsung Securities Co Ltd, swap sur rendement total	(15 113)	3 708
(617)	29 juill. 2022	Seegene Inc, swap sur rendement total	(22 148)	6 465
(400)	29 juill. 2022	Ser Educacional Sa - swap sur rendement total	(619)	251
(335)	29 juill. 2022	Sfa Semicon Co Ltd, swap sur rendement total	(1 677)	558
(100)	29 juill. 2022	Siam Commercial Bank Pub Co, swap sur rendement total	(380)	36
(1 100)	29 juill. 2022	Singia Sa, swap sur rendement total	(4 295)	1 451
(148)	29 juill. 2022	Sk Chemicals Co Ltd/New, swap sur rendement total	(13 535)	6 279
(200)	29 juill. 2022	Sk Discovery Co Ltd, swap sur rendement total	(6 941)	1 457
(84)	29 juill. 2022	S-Oil Corp, swap sur rendement total	(8 675)	1 449
(100)	29 juill. 2022	Soulbrain Co Ltd, swap sur rendement total	(1 911)	354
(253)	29 juill. 2022	St Pharm Co Ltd, swap sur rendement total	(22 585)	4 813
(2 400)	29 juill. 2022	Tegma Gestao Logistica, swap sur rendement total	(8 110)	1 961
(3 941)	29 juill. 2022	Telcon Rf Pharmaceutical Inc, swap sur rendement total	(5 479)	2 806
(5 200)	29 juill. 2022	Telesites Sab De Cv, swap sur rendement total	(8 217)	(776)
(129)	29 juill. 2022	Tes Co Ltd - swap sur rendement total	(2 530)	766
(248)	29 juill. 2022	Toptec Co Ltd, swap sur rendement total	(1 761)	304

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(900)	29 juill. 2022	Totvs Sa - swap sur rendement total	(5 160)	1 560
(1 600)	29 juill. 2022	Trisul Sa, swap sur rendement total	(1 345)	346
(300)	29 juill. 2022	Tupy Sa, swap sur rendement total	(1 644)	248
(20)	29 juill. 2022	Tway Air Co Ltd, swap sur rendement total	(18)	(1)
(4 450)	29 juill. 2022	Unifin Financiera Sab De Cv, swap sur rendement total	(4 967)	(26)
(1 800)	29 juill. 2022	Usinas Sider Minas Ger-actions priv., A, swap sur rendement total	(3 838)	1 243
(7 700)	29 juill. 2022	Via S/A, swap sur rendement total	(3 644)	2 917
(800)	29 juill. 2022	Vivara Participacoes Sa, swap sur rendement total	(4 334)	932
(200)	29 juill. 2022	Walmart De Mexico Sab De Cv, swap sur rendement total	(889)	(25)
(197)	29 juill. 2022	Wonik Ips Co Ltd - swap sur rendement total	(5 829)	596
(36)	29 juill. 2022	Woongjin Coway Co Ltd, swap sur rendement total	(2 284)	401
(1 900)	29 juill. 2022	Yduqs Part, swap sur rendement total	(6 121)	2 233
(64)	29 juill. 2022	Yungjin Pharmaceutical Co, swap sur rendement total	(230)	50
(23)	29 juill. 2022	Zinus Inc, swap sur rendement total	(1 115)	298
				230 778
Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position vendeur				450 724
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total				709 100
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total				(693 551)
Plus-value (moins-value) latente des swaps sur rendement total, montant net				15 549

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (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 (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 constituer un portefeuille diversifié d'actions mondiales en prenant à la fois des positions acheteur et vendeur, tout en tentant de maintenir une position acheteur nette de 100 %, en vue de maximiser le rendement total à long terme. Le Fonds a pour objectif d'obtenir un rendement supérieur à celui de l'indice MSCI Monde (tous pays, CAD, rendement net) au cours d'un cycle de marché.

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 2022

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	2 135 508 \$	– \$	– \$	2 135 508 \$
Actions américaines – position acheteur	12 902 496	719	–	12 903 215
Actions étrangères – position acheteur	9 499 427	10 788	–	9 510 215
Contrats de change à terme	–	24 659	–	24 659
Contrats de swap	–	709 100	–	709 100
	24 537 431 \$	745 266 \$	– \$	25 282 697 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	1 514 619 \$	23 \$	– \$	1 514 642 \$
Actions américaines – position vendeur	1 336 589	–	–	1 336 589
Actions étrangères – position vendeur	1 336 589	10 861	–	3 410 997
Contrats de change à terme	3 400 136	23 454	–	23 454
Contrats de swap	–	693 551	–	693 551
	6 251 344 \$	727 889 \$	– \$	6 979 233 \$

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Au 31 décembre 2021

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	3 031 657 \$	– \$	– \$	3 031 657 \$
Actions américaines – position acheteur	18 393 361	2 934	–	18 396 295
Actions étrangères – position acheteur	15 060 867	15 157	–	15 076 024
Contrats de change à terme	–	14 436	–	14 436
Contrats de swap	–	549 356	–	549 356
	36 485 885 \$	581 883 \$	– \$	37 067 768 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	2 172 222 \$	– \$	– \$	2 172 222 \$
Actions américaines – position vendeur	1 858 374	–	–	1 858 374
Actions étrangères – position vendeur	5 008 040	1 738	–	5 009 778
Contrats de change à terme	–	16 331	–	16 331
Contrats de swap	–	445 883	–	445 883
	9 038 636 \$	463 952 \$	– \$	9 502 588 \$

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 2022 et l'exercice clos le 31 décembre 2021. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2022 et l'exercice clos le 31 décembre 2021, 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
2022					
Série A	13 355	1 377	–	(1 255)	13 477
Série F	321 623	20 845	–	(56 792)	285 676
Série I	1 970 842	49	–	(266 584)	1 704 307
2021					
Série A	8 196	3 544	1 615	–	13 355
Série F	295 883	217 185	40 470	(231 915)	321 623
Série I	1 746 010	46 948	274 832	(96 948)	1 970 842

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2021, le Fonds disposait de pertes en capital inutilisées de néant (néant au 31 décembre 2020) 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 2020).

Au cours de la période, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2021).

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 1,50 % pour la série A et de 0,50 % 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 20 % 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 MSCI Monde (tous pays, CAD, rendement net).

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 2022, CCLFGII détenait 1 616 973 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 16 343 393 \$ (1 883 286 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 23 051 421 \$ au 31 décembre 2021). Au 30 juin 2022, GFCC&L détenait 6 302 parts de série A, 6 530 parts de série F et 6 719 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 63 588 \$, 65 440 \$ et 67 912 \$ (6 302 parts de série A, 6 530 parts de série F et 6 719 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 77 704 \$, de 79 666 \$ et de 82 241 \$ au 31 décembre 2021).

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

Le Fonds a payé 36 316 \$ (26 797 \$ en 2021) 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 2 773 (3 533 \$ en 2021).

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (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 2022 et au 31 décembre 2021, 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 2022

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar australien	(22 063)	512 706	490 643	2,4	24 532
Livre sterling	133 989	(443 342)	(309 353)	(1,5)	(15 468)
Renminbi chinois	4 954	–	4 954	–	248
Couronne danoise	7 053	–	7 053	–	353
Euro	116 321	(233 304)	(116 983)	(0,6)	(5 849)
Dollar de Hong Kong	49 245	–	49 245	0,2	2 462
Forint hongrois	6 518	–	6 518	–	326
Nouveau shekel israélien	29 385	–	29 385	0,2	1 469
Yen japonais	39 281	489 641	528 922	2,6	26 446
Peso mexicain	(2 595)	–	(2 595)	–	(130)
Dollar néo-zélandais	4 662	–	4 662	–	233
Couronne norvégienne	8 997	–	8 997	–	450
Peso philippin	(518)	–	(518)	–	(26)
Zloty polonais	1 259	–	1 259	–	63
Dollar de Singapour	25 956	–	25 956	0,1	1 298
Rand sud-africain	(11 112)	–	(11 112)	(0,1)	(556)
Couronne suédoise	(7 578)	–	(7 578)	–	(379)
Franc suisse	19 215	–	19 215	0,1	961
Lire turque	6 712	–	6 712	–	336
Dirham des ÉAU	715	–	715	–	36
Dollar américain	1 279 985	(139 629)	1 140 356	5,6	57 018
Total	1 690 381	186 072	1 876 453	9,0	93 823

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Au 31 décembre 2021

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar australien	147 764	819 189	966 953	3,4	48 348
Livre sterling	(21 106)	-	(21 106)	(0,1)	(1 055)
Couronne danoise	18 774	(158 757)	(139 983)	(0,5)	(6 999)
Euro	59 462	(808 724)	(749 262)	(2,6)	(37 463)
Dollar de Hong Kong	21 200	(193 127)	(171 927)	(0,6)	(8 596)
Forint hongrois	(2 656)	-	(2 656)	-	(133)
Roupie indonésienne	3 858	-	3 858	-	193
Nouveau shekel israélien	25 698	-	25 698	0,1	1 285
Yen japonais	12 313	(148 785)	(136 472)	(0,5)	(6 824)
Peso mexicain	134	-	134	-	7
Dollar néo-zélandais	25 070	-	25 070	0,1	1 254
Couronne norvégienne	24 141	(157 423)	(133 282)	(0,5)	(6 664)
Zloty polonais	(4 335)	-	(4 335)	-	(217)
Dollar de Singapour	46 286	-	46 286	0,2	2 314
Rand sud-africain	(2 593)	(156 469)	(159 062)	(0,6)	(7 953)
Couronne suédoise	74 115	(288 378)	(214 263)	(0,8)	(10 713)
Franc suisse	(1 442)	-	(1 442)	-	(72)
Lire turque	(4 726)	-	(4 726)	-	(236)
Dirham des ÉAU	700	-	700	-	35
Dollar américain	96 188	1 396 302	1 492 490	5,3	74 625
Total	518 845	303 828	822 673	2,9	41 136

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, 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 2022 et au 31 décembre 2021, 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 1 829 000 \$ (2 746 000 \$ au 31 décembre 2021). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Risque de crédit

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, 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 3,6 % (2,0 % au 31 décembre 2021) 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).

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Prêt de titre (note 12)

Pour les périodes closes les 30 juin 2022 et 2021, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2022	2021
	(\$)	(\$)
Revenus bruts tirés du prêt de titres	1 104	891
Charges liées au prêt de titres	(217)	(178)
Revenus nets tirés du prêt de titres	887	713
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	(91)	(11)
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	796	702

Les charges liées au prêt de titres ont représenté 19,7 % (20,0 % en 2021) 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 2022 et au 31 décembre 2021.

	30 juin 2022	31 décembre 2021
	(en milliers de \$)	(en milliers de \$)
Titres prêtés	903	1 157
Garanties reçues	948	1 215
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Effet de levier et emprunt (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2022 et de l'exercice clos le 31 décembre 2021, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié entre 62,1 % et 75,0 % (entre 62,8 % et 86,3 % au 31 décembre 2021) 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 2021, l'exposition totale du Fonds correspondait à 68,7 % (63,4 % au 31 décembre 2021) 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 2022 et de l'exercice clos le 31 décembre 2021, le niveau de la dette bancaire du Fonds était de 1 873 990 \$ à 4 491 450 \$ (de 2 156 117 \$ à 5 337 261 \$ en 2021), avec un taux d'intérêt moyen de 0,80 % (0,42 % en 2021). Au 30 juin 2022, la dette bancaire correspondait à 14,0 % (8,5 % au 31 décembre 2021) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

États de la situation financière aux

	30 juin 2022 (non audité)	31 décembre 2021 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	2 467 158 \$	804 922 \$
Placements	22 178 917	30 488 282
Plus-value latente des contrats de change à terme	9 632	11 691
Plus-value latente des contrats de swap	741 875	594 701
Marge de variation quotidienne	2 152 803	2 111 450
Montant à recevoir du courtier	201 299	831 590
Dividendes à recevoir	84 197	73 502
	27 835 881	34 916 138
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	3 654 940	1 915 637
Placements vendus à découvert	4 633 641	6 738 464
Moins-value latente des contrats de change à terme	15 245	7 123
Moins-value latente des contrats de swap	694 985	460 255
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	29 099	6 418
Montant à payer au courtier	233 304	845 888
Frais d'emprunt de titres à payer	6 683	883
Charges à payer	33 690	34 280
Frais de gestion à payer	4 349	816
Rémunération au rendement à payer	572	3 446
	9 306 508	10 013 210
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18 529 373 \$	24 902 928 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	462 902 \$	491 333 \$
Série F	3 944 016 \$	423 659 \$
Série I	14 122 455 \$	23 987 936 \$
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	43 957	41 855
Série F	365 474	35 406
Série I	1 305 247	2 004 975
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	10,53 \$	11,74 \$
Série F	10,79 \$	11,97 \$
Série I	10,82 \$	11,96 \$

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

Administrateur

« Tim Elliott »

Administrateur

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2022	2021
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	9 460 \$	128 472 \$
Variation du gain (perte) de change latent	(16 750)	(55 938)
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	1 141	1 878
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	346 301	302 097
Charges de dividende sur les titres vendus à découvert	(70 887)	(23 022)
Intérêts aux fins des distributions	656	1 010
Gain (perte) net réalisé sur les placements	873 589	1 911 457
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	498 304	(505 712)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	(68 478)	8 891
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	37 979	(71 554)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	(140 139)	969 167
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	(4 118 755)	1 869 057
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	832 142	257 680
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	(10 181)	(6 999)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	(87 556)	(81 719)
Gain (perte) net total sur placements	<u>(1 907 025)</u>	<u>4 630 353</u>
Total des revenus (pertes) nets	<u>(1 913 174)</u>	<u>4 704 765</u>
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	13 191	10 172
Honoraires des dépositaires	39 012	25 175
Frais de dépôt	22 251	18 885
Honoraires du comité d'examen indépendant	2 480	2 476
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	321	313
Charges d'intérêts	13 374	10 531
Frais de gestion	11 199	2 996
Rémunération au rendement	770	2 134
Coût d'emprunt de titres	40 743	23 239
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	4 589	3 919
Coûts d'opérations (note 9)	14 488	11 577
Total des charges d'exploitation	<u>162 418</u>	<u>111 417</u>
Retenues d'impôts (note 7)	<u>(6 902)</u>	<u>(5 255)</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>(2 082 494) \$</u>	<u>4 588 093 \$</u>

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2022	2021
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	(53 431) \$	57 525 \$
Série F	(492 658) \$	68 508 \$
Série I	(1 536 405) \$	4 462 060 \$
	<hr/>	<hr/>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	43 340	22 103
Série F	221 970	25 945
Série I	1 529 897	1 620 282
	<hr/>	<hr/>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	(1,23) \$	2,60 \$
Série F	(2,22) \$	2,64 \$
Série I	(1,00) \$	2,75 \$
	<hr/>	<hr/>

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 2022	Série A 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	491 333 \$	228 619 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(53 431)	57 525
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	25 000	20 000
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	25 000	20 000
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(28 431)	77 525
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	462 902 \$	306 144 \$
	Série F 2022	Série F 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	423 659 \$	279 270 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(492 658)	68 508
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	4 013 635	–
Rachat de parts rachetables	(620)	–
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	4 013 015	–
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	3 520 357	68 508
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	3 944 016 \$	347 778 \$

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 2022	Série I 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	23 987 936 \$	17 363 328 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(1 536 405)	4 462 060
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	32 882	71 479
Rachat de parts rachetables	(8 361 958)	(675)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(8 329 076)	70 804
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(9 865 481)	4 532 864
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	14 122 455 \$	21 896 192 \$
	Total 2022	Total 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	24 902 928 \$	17 871 217 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 082 494)	4 588 093
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	4 071 517	91 479
Rachat de parts rachetables	(8 362 578)	(675)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(4 291 061)	90 804
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(6 373 555)	4 678 897
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	18 529 373 \$	22 550 114 \$

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2022	2021
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 082 494) \$	4 588 093 \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	16 750	55 938
(Gain) perte net réalisé sur les placements	(873 589)	(1 911 457)
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	(498 304)	505 712
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	4 118 755	(1 869 057)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	(832 142)	(257 680)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	10 181	6 999
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	87 556	81 719
Achat de placements	(37 113 191)	(37 491 200)
Produit de la vente de placements	41 420 720	36 603 454
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	(41 353)	(6 718)
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(10 695)	(4 021)
(Augmentation) diminution des autres créances	-	(59)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	5 800	1 232
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	22 681	1 100
Augmentation (diminution) des charges à payer	(590)	(6 021)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	3 533	365
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	(2 874)	1 452
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	4 230 744	299 851
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables	4 071 517	91 479
Rachat de parts rachetables	(8 362 578)	(675)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(4 291 061)	90 804
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	(60 317)	390 655
Variation du gain (perte) de change latent	(16 750)	(55 938)
Trésorerie, à l'ouverture de la période	804 922	13 424
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	(1 915 637)	(2 524 480)
	(1 187 782)	(2 176 339)
Trésorerie, à la clôture de la période	2 467 158 \$	395 112 \$
Dette bancaire, à la clôture de la période	(3 654 940) \$	(2 571 451) \$
	(1 187 782) \$	(2 176 339) \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	328 789 \$	292 852 \$
Dividendes payés*	48 206	21 922
Intérêts reçus*	656	1 010
Intérêts payés*	13 374	10 531

* Inclus dans les activités d'exploitation.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Actions canadiennes – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2021 : 13,33 %)				
ARC Resources Ltd.	7 721	100 305	125 312	
Athabasca Oil Corp.	8 500	9 560	21 165	
Baytex Energy Corp.	4 100	22 412	25 625	
Birchcliff Energy Ltd.	1 000	7 023	8 750	
Corporation Cameco, TSE	900	26 570	24 354	
Canacol Energy Ltd.	100	361	252	
Canadian Natural Resources Ltd.	6 900	323 050	477 273	
Cardinal Energy Ltd.	4 800	22 463	34 704	
Cenovus Energy Inc.	11 055	146 541	270 737	
CES Energy Solutions Corp.	200	350	466	
Crescent Point Energy Corp.	2 936	22 548	26 864	
Crew Energy Inc.	3 000	10 955	13 860	
Enbridge Inc.	13 200	665 966	717 552	
Enerflex Ltd.	200	1 199	1 214	
Enerplus Corp.	4 833	40 297	82 209	
Ensign Energy Services Inc.	1 000	2 065	3 370	
Freehold Royalties Ltd.	900	13 323	11 466	
Frontera Energy Corp.	300	2 212	3 105	
Gear Energy Ltd.	700	739	868	
Gibson Energy Inc.	900	22 221	21 456	
Headwater Exploration Inc.	2 700	18 428	14 607	
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	1 300	78 903	78 884	
Keyera Corp.	1 800	56 575	52 920	
MEG Energy Corp.	4 100	33 090	73 062	
NexGen Energy Ltd.	7 200	47 973	33 264	
NuVista Energy Ltd.	100	1 087	1 032	
Paramount Resources Ltd.	500	13 385	15 370	
Parex Resources Inc.	1 586	36 777	34 575	
Pembina Pipeline Corp., TSE	3 393	160 612	154 382	
Peyto Exploration & Development Corp.	2 000	20 917	24 080	
PrairieSky Royalty Ltd.	1 930	28 691	31 285	
Secure Energy Services Inc.	8 764	41 180	52 584	
Suncor Énergie Inc.	9 600	334 171	433 536	
Surge Energy Inc.	1 000	8 305	9 110	
Tamarack Valley Energy Ltd.	11 467	40 712	49 652	
Corporation TC Énergie	6 900	445 932	460 092	
Tidewater Midstream and Infrastructure Ltd.	200	269	262	
Topaz Energy Corp.	400	7 021	8 124	
Tourmaline Oil Corp.	1 400	76 684	93 702	
Vaalco Energy Inc.	165	710	1 477	
Whitecap Resources Inc.	6 371	34 274	56 957	
		2 925 856	3 549 559	19,16
Matières premières (31 décembre 2021 : 13,60 %)				
Mines Agnico Eagle Ltée	2 066	149 483	121 729	
Alamos Gold Inc.	2 700	29 953	24 381	
Argonaut Gold Inc.	2 500	7 585	1 125	
Société aurifère Barrick	12 100	321 770	275 396	
Calibre Mining Corp..	700	822	679	
Canfor Corp.	400	9 824	8 980	
Capstone Copper Corp.	2 700	14 266	8 775	
Cascades inc.	900	11 455	9 117	
CCL Industries Inc., cat. B	200	12 838	12 168	
Centerra Gold Inc.	3 300	32 927	28 809	
Dundee Precious Metals Inc.	1 271	10 003	8 147	
Eldorado Gold Corp.	2 699	32 606	22 159	
Endeavour Silver Corp.	100	453	404	
ERO Copper Corp.	400	6 634	4 348	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
First Majestic Silver Corp.	1 800	26 626	16 614	
First Quantum Minerals Ltd.	2 595	76 762	63 370	
Franco-Nevada Corp., TSE	1 400	232 960	237 048	
GCM Mining Corp.	1 700	9 593	5 967	
Hudbay Minerals Inc.	5 000	41 948	26 250	
IAMGOLD Corp.	10 200	41 802	21 114	
Interfor Corp.	900	20 945	23 346	
Ivanhoe Mines Ltd.	6 200	57 925	45 942	
Karora Resources Inc.	400	1 864	1 328	
Kinross Gold Corp.	17 851	135 003	81 758	
Labrador Iron Ore Royalty Corp.	1 700	61 492	48 195	
Liberty Gold Corp.	4 796	5 276	2 638	
Lucara Diamond Corp.	2 900	4 702	1 769	
Lundin Mining Corp.	3 800	39 568	31 008	
New Gold Inc.	7 300	11 249	10 001	
Novagold Resources Inc.	3 000	29 608	18 450	
Nutrien Ltd.	3 100	252 364	317 781	
OceanaGold Corp.	15 699	43 065	38 777	
Minière Osisko Inc.	2 400	9 633	7 344	
Pan American Silver Corp.	2 300	71 284	58 167	
Sandstorm Gold Ltd	3 000	25 059	22 920	
Seabridge Gold Inc.	400	9 556	6 380	
Sierra Metals Inc.	200	461	208	
Silvercorp Metals inc.	2 900	17 750	9 251	
SSR Mining Inc.	3 000	70 967	64 500	
Stelco Holdings Inc.	400	16 969	12 872	
Stella-Jones Inc.	400	17 821	13 000	
Taseko Mines Ltd.	3 671	4 575	5 176	
Ressources Teck Ltée	2 116	89 237	83 286	
Torex Gold Resources Inc.	300	5 011	2 982	
Transcontinental inc.	500	8 461	7 655	
Turquoise Hill Resources Ltd.	1 400	47 652	48 272	
Wesdome Gold Mines Ltd.	1 000	9 179	11 150	
West Fraser Timber Co., Ltd.	1 001	99 993	98 869	
Western Copper & Gold Corp.	900	1 850	1 593	
Western Forest Products Inc.	1 300	2 342	1 885	
Wheaton Precious Metals Corp.	3 700	187 101	171 606	
Winpak Ltée	200	7 237	8 798	
Yamana Gold Inc.	8 557	43 467	51 256	
		2 478 976	2 204 743	11,90
Industries (31 décembre 2021 : 11,27 %)				
Groupe Aecon Inc.	500	7 591	6 565	
AG Growth International Inc.	100	3 554	2 969	
Air Canada	3 400	71 456	54 536	
ATS Automation Tooling Systems Inc.	2 100	79 999	74 235	
Badger Infrastructure Solutions Ltd.	400	12 735	11 296	
Ballard Power Systems Inc.	300	2 393	2 439	
Black Diamond Group Ltd.	2 600	5 472	9 672	
Bombardier Inc.	656	28 975	12 674	
Boyd Group Services Inc.	200	33 658	27 732	
CAE inc., TSE	100	3 139	3 172	
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	3 600	503 405	521 244	
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	6 300	542 620	566 433	
Civeo Corp.	62	1 051	2 069	
Dexterra Group Inc.	140	1 133	774	
Doman Building Materials Group Ltd.	1 700	12 734	10 659	
Finning International Inc.	900	33 847	24 381	
GFL Environmental Inc.	2 000	78 728	66 320	
Héroux-Devtek Inc.	300	5 378	4 170	
Magellan Aerospace Corp.	500	6 219	3 755	
Mullen Group Ltd.	566	6 602	6 390	
NFI Group Inc.	1 481	23 327	19 831	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ritchie Bros Auctioneers Inc.	700	51 596	58 625	
Métaux Russel Inc.	400	12 466	10 408	
Groupe SNC-Lavalin inc.	800	22 993	17 712	
Stantec Inc., TSE	900	53 108	50 751	
TFI International Inc., TSE	1 200	107 685	123 996	
Thomson Reuters Corp., TSE	1 500	175 828	201 285	
Industries Toromont Ltée	500	56 360	52 040	
Waste Connections Inc.	1 893	280 672	302 123	
Westshore Terminals Investment Corp.	200	3 451	6 390	
WSP Global Inc.	800	111 123	116 432	
		2 339 298	2 371 078	12,80
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 3,54 %)				
Aritzia Inc.	1 300	64 083	45 305	
BRP Inc.	559	51 028	44 284	
La Société Canadian Tire Ltée	400	74 194	64 960	
Dollarama inc.	1 700	89 514	126 004	
Les Industries Dorel Inc., cat B	1 100	12 139	7 106	
Linamar Corp.	400	20 638	21 816	
Magna International Inc.	1 025	69 950	72 447	
Martinrea International Inc.	900	7 885	7 479	
Restaurant Brands International Inc.	2 100	147 376	135 597	
Roots Corp.	500	1 465	1 560	
Sleep Country Canada Holdings Inc.	200	7 230	4 804	
Spin Master Corp.	100	4 483	4 201	
		549 985	535 563	2,89
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 3,04 %)				
Alimentation Couche-Tard inc.	5 500	249 512	276 155	
Empire Co., Ltd.	2 400	87 559	95 160	
George Weston Ltée	500	60 931	75 185	
Les Aliments High Liner inc.	100	1 049	1 203	
Jamieson Wellness Inc.	300	10 343	10 743	
Les Compagnies Loblaw Ltée	500	50 328	58 045	
Les Aliments Maple Leaf Inc.	800	21 895	20 248	
Metro inc.	1 179	78 156	81 457	
North West Co Inc.	200	7 203	6 658	
Saputo inc.	1 600	47 721	44 912	
		614 697	669 766	3,61
Soins de santé (31 décembre 2021 : 0,31 %)				
Bausch Health Cos Inc.	1 700	25 850	18 292	
BELLUS Santé inc.	1 500	11 535	17 775	
Chartwell résidences pour retraités	200	2 362	2 230	
Extendicare Inc.	1 000	7 066	6 860	
OrganiGram Holdings Inc.	5 800	17 549	6 844	
Sienna Senior Living Inc.	2 155	31 078	27 993	
Viemed Healthcare Inc.	200	1 298	1 392	
		96 738	81 386	0,44
Services financiers (31 décembre 2021 : 32,73 %)				
Banque de Montréal, NYSE	200	13 510	24 811	
Banque de Montréal, TSE	4 300	536 850	532 254	
La Banque de Nouvelle-Écosse	8 200	640 337	624 676	
Brookfield Asset Management Inc.	9 719	605 007	556 510	
Groupe Canaccord Genuity Inc.	1 600	19 214	13 488	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	6 200	426 104	387 562	
Banque canadienne de l'Ouest	600	16 502	15 618	
CI Financial Corp.	4 300	99 267	58 781	
ECN Capital Corp.	1 600	10 346	8 816	
Element Fleet Management Corp.	2 700	32 014	36 234	
EQB Inc.	300	17 366	15 945	
Fairfax Financial Holdings Ltd.	100	52 835	68 210	
goeasy Ltd.	100	17 247	9 810	
Great-West Lifeco Inc.	1 700	62 344	53 431	
Home Capital Group Inc.	300	11 635	7 308	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
iA Société financière inc.	1 400	94 888	89 628	
Société financière IGM Inc.	900	40 801	31 050	
Intact Corporation financière	800	123 523	145 248	
Banque Laurentienne du Canada	500	20 346	19 340	
Société Financière Manuvie	10 114	239 316	225 744	
Banque nationale du Canada	2 300	210 002	194 281	
Onex Corp.	500	32 011	32 050	
Power Corporation du Canada	2 443	85 315	80 912	
Banque Royale du Canada	9 100	1 031 048	1 134 214	
Sprott Inc.	100	5 309	4 472	
Financière Sun Life inc.	3 600	227 028	212 328	
Groupe TMX Ltée	400	50 097	52 400	
La Banque Toronto-Dominion	12 400	979 988	1 046 682	
Trisura Group Ltd.	500	20 803	16 665	
		5 721 053	5 698 468	30,76
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 11,39 %)				
Absolute Software Corp.	4 100	47 730	45 510	
Blackberry Ltd.	3 500	48 504	24 290	
Celestica Inc.	1 600	19 913	20 032	
CGI Inc.	1 200	121 781	123 048	
Constellation Software Inc.	199	351 187	380 263	
Converge Technology Solutions Corp.	4 000	42 650	20 520	
Descartes Systems Group Inc.	1 400	127 493	111 986	
Dye & Durham Ltd.	400	16 411	8 700	
Enghouse Systems Ltd.	300	16 047	8 529	
Kinaxis Inc.	100	16 042	13 896	
Corporation Nuvei	400	44 894	18 608	
Open Text Corp.	500	27 554	24 345	
Quarterhill Inc.	3 000	4 425	5 580	
Shopify Inc.	6 640	541 624	267 061	
TELUS International CDA Inc., TSE	400	19 303	12 920	
		1 445 558	1 085 288	5,86
Services de communication (31 décembre 2021: 5,25 %)				
Aimia Inc.	8 601	31 457	39 565	
BCE Inc.	6 400	404 820	404 928	
Cogeco Communications inc.	300	29 928	26 121	
Corus Entertainment Inc.	8 100	39 857	28 593	
Québecor inc.	1 000	30 749	27 510	
Rogers Communications Inc., TSE	1 300	84 077	80 184	
Shaw Communications Inc., cat. B	3 091	83 642	117 242	
TELUS Corp.	11 600	328 111	332 572	
Pages Jaunes Limitée	1 100	8 611	15 015	
		1 041 252	1 071 730	5,78
Services publics (31 décembre 2021 : 3,51 %)				
Algonquin Power & Utilities Corp.	8 300	155 252	143 590	
AltaGas Ltd.	2 300	60 866	62 468	
Atco Ltd.	300	13 192	13 230	
Borex inc.	900	35 778	38 592	
Brookfield Infrastructure Corp.	900	55 650	49 167	
Canadian Utilities Ltd.	500	17 744	19 195	
Capital Power Corp.	700	28 187	31 507	
Emera Inc.	2 600	156 731	156 780	
Fortis Inc.	3 400	194 830	206 890	
Hydro One Ltd.	2 000	60 393	69 220	
Innergex énergie renouvelable inc.	1 100	20 547	19 030	
Northland Power Inc.	1 516	57 617	58 093	
Polaris Infrastructure Inc.	900	16 007	17 523	
Superior Plus Corp.	2 528	30 518	28 718	
TransAlta Corp., TSE	100	1 350	1 469	
TransAlta Renewables Inc.	1 000	18 785	16 450	
		923 447	931 922	5,03

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Immobilier (31 décembre 2021 : 3,55 %)				
Allied Properties REIT	1 600	73 673	53 104	
Groupe Altus limitée	545	32 534	24 302	
Artis REIT	500	5 922	5 880	
Boardwalk REIT	300	15 767	12 564	
Fonds de placement immobilier d'immeubles résidentiels canadiens	800	43 265	35 856	
Colliers International Group Inc.	200	24 175	28 206	
Fonds de placement immobilier Crombie	899	15 550	14 501	
CT REIT	400	6 862	6 628	
Fiducie de placement immobilier industriel Dream	1 683	26 863	20 331	
Fiducie de placement immobilier de bureaux Dream	200	4 811	3 876	
First Capital REIT	1 495	28 006	22 395	
FirstService Corp.	500	101 086	78 070	
FPI Granite Inc.	1 200	107 218	94 740	
Fonds de placement immobilier H&R	2 100	26 585	26 145	
InterRent REIT	1 000	13 912	11 990	
Killam Apartment REIT	1 800	38 321	30 870	
Morguard North American Residential Real Estate Investment	300	4 961	4 914	
Primaris REIT	450	8 133	5 504	
FPI RioCan	2 100	49 778	42 042	
SmartCentres REIT	700	19 740	19 243	
Summit Industrial Income REIT	4 382	90 056	74 976	
Tricon Residential Inc., TSE	1 900	35 290	24 795	
		<u>772 508</u>	<u>640 932</u>	3,46
Total des actions canadiennes – position acheteur		<u>18 909 368</u>	<u>18 840 435</u>	101,69
Actions canadiennes – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2021 : -0,06 %)				
Computer Modelling Group Ltd.	(200)	(1 066)	(972)	
Denison Mines Corp.	(21 100)	(39 523)	(26 797)	
Energy Fuels Inc., NYSE	(1 450)	(11 071)	(9 184)	
Energy Fuels Inc., TSE	(3 300)	(36 335)	(20 922)	
Pason Systems Inc.	(200)	(1 690)	(2 918)	
Shawcor Ltée	(600)	(3 331)	(3 426)	
Total Energy Services Inc.	(300)	(1 007)	(2 241)	
Trican Well Service Ltd.	(600)	(2 487)	(2 214)	
Vermilion Energy Inc.	(1 400)	(34 195)	(34 300)	
		<u>(130 705)</u>	<u>(102 974)</u>	(0,56)
Matières premières (31 décembre 2021 : -0,98 %)				
Alexco Resource Corp.	(200)	(389)	(100)	
Americas Gold & Silver Corp.	(3 500)	(8 455)	(3 150)	
B2Gold Corp.	(100)	(548)	(436)	
Canfor Pulp Products Inc.	(200)	(1 851)	(1 000)	
Equinox Gold Corp.	(100)	(726)	(574)	
Fortuna Silver Mines Inc.	(10 200)	(52 571)	(37 332)	
GoGold Resources Inc.	(400)	(854)	(820)	
Jaguar Mining Inc.	(100)	(479)	(284)	
Lundin Gold Inc.	(100)	(910)	(924)	
MAG Silver Corp.	(100)	(2 070)	(1 571)	
Major Drilling Group International Inc.	(200)	(2 103)	(1 806)	
Maverix Metals Inc.	(100)	(580)	(558)	
Redevances aurifères Osisko Ltée	(300)	(4 095)	(3 894)	
Platinum Group Metals Ltd.	(2 000)	(5 100)	(3 360)	
Sabina Gold & Silver Corp.	(900)	(1 065)	(954)	
SilverCrest Metals Inc.	(3 398)	(36 365)	(26 742)	
Skeena Resources Ltd.	(400)	(3 924)	(2 720)	
Victoria Gold Corp.	(200)	(3 289)	(1 998)	
Wallbridge Mining Co., Ltd.	(1 500)	(1 063)	(285)	
		<u>(126 437)</u>	<u>(88 508)</u>	(0,48)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Industries (31 décembre 2021 : -0,22 %)				
Chorus Aviation Inc.	(1 100)	(4 318)	(3 597)	
DIRTT Environmental Solutions	(600)	(1 793)	(840)	
PyroGenèse Canada Inc.	(8 100)	(30 515)	(20 169)	
Transat AT Inc.	(200)	(825)	(716)	
Westport Fuel Systems Inc.	(900)	(1 894)	(1 161)	
Xebee Adsorption Inc.	(8 200)	(24 944)	(6 806)	
		(64 289)	(33 289)	(0,18)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -0,37 %)				
Bragg Gaming Group Inc.	(100)	(655)	(594)	
Diversified Royalty Corp.	(500)	(910)	(1 290)	
ElectraMeccanica Vehicles Corp.	(15 246)	(60 708)	(26 550)	
Fire & Flower Holdings Corp.	(400)	(1 125)	(976)	
Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	(400)	(15 778)	(14 820)	
Goodfood Market Corp.	(3 200)	(13 577)	(5 120)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.	(600)	(37 611)	(30 750)	
		(130 364)	(80 100)	(0,43)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -0,04 %)				
Andrew Peller Ltée	(200)	(1 208)	(1 170)	
SunOpta Inc.	(1 000)	(7 187)	(9 950)	
		(8 395)	(11 120)	(0,06)
Soins de santé (31 décembre 2021 : -0,45 %)				
Aptose Biosciences Inc.	(200)	(660)	(190)	
Cronos Group Inc.	(4 100)	(20 674)	(14 760)	
HEXO Corp.	(24 097)	(46 063)	(6 506)	
Thérapeutique Knight Inc.	(400)	(2 078)	(2 136)	
Sundial Growers Inc.	(70 976)	(45 680)	(29 856)	
Valens Co Inc.	(800)	(1 174)	(664)	
VBI Vaccines Inc.	(217)	(354)	(226)	
Well Health Technologies Corp.	(8 200)	(39 889)	(25 174)	
Xenon Pharmaceuticals Inc.	(99)	(3 982)	(3 885)	
		(160 554)	(83 397)	(0,45)
Services financiers (31 décembre 2021 : -0,03 %)				
Mogo Inc.	(2 600)	(10 806)	(2 834)	(0,02)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -0,21 %)				
Hut 8 Mining Corp	(15 400)	(71 275)	(26 796)	
Lightspeed Commerce Inc., TSE	(600)	(18 568)	(17 220)	
		(89 843)	(44 016)	(0,24)
Services de communication (31 décembre 2021 : néant)				
Enthusiast Gaming Holdings Inc.	(600)	(1 913)	(1 530)	
Imax Corp.	(375)	(8 363)	(8 170)	
Groupe Stingray Inc.	(400)	(2 187)	(2 480)	
Telesat Corp.	(8)	(349)	(115)	
		(12 812)	(12 295)	(0,07)
Services publics (31 décembre 2021 : -0,11 %)				
Immobilier (31 décembre 2021 : néant)				
European Residential REIT	(300)	(1 160)	(1 074)	
Information Services Corp.	(100)	(2 483)	(2 103)	
Morguard REIT	(200)	(1 029)	(1 028)	
		(4 672)	(4 205)	(0,02)
Total des actions canadiennes – position vendeur		(738 877)	(462 738)	(2,51)
Actions américaines – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2021 : 0,78 %)				
American Resources Corp.	153	497	286	
Antero Midstream Corp.	38	454	444	
Arch Resources Inc.	18	3 578	3 322	
Archrock Inc.	191	2 193	2 038	
Baker Hughes Co.	945	36 388	35 193	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Berry Corp.	705	6 848	6 930	
Brigham Minerals Inc.	394	12 230	12 518	
CONSOL Energy Inc.	149	6 916	9 491	
CVR Energy Inc.	20	747	864	
Delek US Holdings Inc.	223	7 253	7 433	
Earthstone Energy Inc.	1 305	20 584	22 978	
Equitrans Midstream Corp.	246	2 423	2 018	
Gran Tierra Energy Inc., ASE	653	684	969	
Gran Tierra Energy Inc., TSE	3 300	7 762	4 884	
Helix Energy Solutions Group Inc.	1 665	7 626	6 658	
Hess Midstream LP	1 502	55 857	54 250	
HF Sinclair Corp.	96	5 674	5 592	
Kinetik Holdings Inc.	15	724	661	
KLX Energy Services Holdings Inc.	79	1 025	441	
Kosmos Energy Ltd.	2 549	9 932	20 353	
Laredo Petroleum Inc.	255	16 180	22 677	
Liberty Energy Inc.	537	10 694	8 839	
Marathon Petroleum Corp.	26	2 913	2 757	
NACCO Industries Inc.	8	549	391	
New Fortress Energy Inc.	69	3 976	3 522	
Newpark Resources Inc.	271	1 497	1 080	
NextDecade Corp.	327	2 582	1 873	
NOV Inc.	3	52	65	
Oceaneering International Inc.	387	6 197	5 332	
Oil States International Inc.	69	675	482	
Par Pacific Holdings Inc.	400	6 940	8 044	
PBF Energy Inc.	120	3 399	4 492	
PDC Energy Inc.	4	361	318	
Peabody Energy Corp.	203	5 805	5 586	
Ranger Oil Corp.	439	9 495	18 614	
Ring Energy Inc.	767	2 501	2 632	
Sitio Royalties Corp.	142	4 508	4 246	
Smart Sand Inc.	283	733	730	
Solaris Oilfield Infrastructure Inc.	91	1 288	1 277	
Southwestern Energy Co.	5 333	50 747	42 996	
Tellurian Inc.	4 182	18 054	16 076	
Tidewater Inc.	25	618	680	
Uranium Energy Corp.	1 111	5 727	4 414	
US Silica Holdings Inc.	17	376	250	
Viper Energy Partners LP	20	722	688	
		345 984	355 384	1,92
Matières premières (31 décembre 2021 : 0,18 %)				
Advanced Emissions Solutions Inc.	119	889	720	
Berry Global Group Inc.	41	2 920	2 890	
Clearwater Paper Corp.	11	453	477	
Gold Resource Corp.	161	439	339	
Intrepid Potash Inc.	66	3 178	3 856	
Livent Corp.	137	4 477	4 010	
Loop Industries Inc.	204	2 496	1 021	
LSB Industries Inc.	155	4 048	2 771	
Mccaw Mining Inc.	300	343	162	
Ramaco Resources Inc.	98	1 983	1 662	
Rayonier Advanced Materials Inc.	47	345	159	
Resolute Forest Products Inc.	100	1 445	1 646	
Ryerson Holding Corp.	37	1 779	1 016	
Schnitzer Steel Industries Inc.	25	1 790	1 059	
SunCoke Energy Inc.	69	748	606	
		27 333	22 394	0,12
Industries (31 décembre 2021 : 0,36 %)				
Alta Equipment Group Inc.	21	378	243	
American Airlines Group Inc.	1 264	28 988	20 675	
Atlas Air Worldwide Holdings Inc.	63	5 314	5 015	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Bloom Energy Corp.	689	14 296	14 665	
BlueLinx Holdings Inc.	40	3 330	3 447	
BrightView Holdings Inc.	16	360	248	
Copart Inc.	3	426	421	
CSX Corp.	40	1 496	1 499	
Ducommun Inc.	22	1 277	1 221	
Hurco Cos Inc.	10	446	319	
JetBlue Airways Corp.	548	8 256	5 917	
LSI Industries Inc.	233	2 276	1 854	
Manitowoc Co Inc.	16	353	217	
MasTec Inc.	3	381	277	
Mesa Air Group Inc.	36	372	102	
Mistras Group Inc.	42	214	322	
Proto Labs Inc.	17	1 497	1 049	
Union Pacific Corp.	2	595	550	
United Airlines Holdings Inc.	579	33 843	26 455	
Upwork Inc.	178	4 551	4 748	
Vertiv Holdings Co.	549	6 557	5 821	
Yellow Corp.	527	7 030	1 992	
		122 236	97 057	0,52
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 1,31 %)				
2U Inc.	190	9 636	2 566	
Asbury Automotive Group Inc.	3	714	655	
Big Lots Inc.	106	3 483	2 867	
Biglari Holdings Inc.	75	10 041	11 871	
Bluegreen Vacations Holding Corp.	65	1 316	2 093	
Chegg Inc.	98	2 392	2 374	
Chewy Inc.	195	7 174	8 734	
Designer Brands Inc.	18	386	303	
Dick's Sporting Goods Inc.	8	798	778	
Everi Holdings Inc.	277	5 820	5 828	
Expedia Group Inc.	486	80 582	59 451	
Harley-Davidson Inc.	27	1 146	1 103	
Hibbett Inc.	4	356	226	
iRobot Corp.	3	422	142	
Lindblad Expeditions Holdings Inc.	19	406	199	
Macy's Inc.	12	353	284	
MarineMax Inc.	46	2 895	2 143	
Murphy USA Inc.	2	619	601	
PlayAGS Inc.	992	4 838	6 603	
Porch Group Inc.	113	374	373	
Quotient Technology Inc.	1 213	11 270	4 647	
Qurate Retail Inc.	90	844	333	
Red Robin Gourmet Burgers Inc.	64	2 030	663	
Rush Street Interactive Inc.	187	3 891	1 127	
Smith & Wesson Brands Inc.	38	738	644	
Stitch Fix Inc.	598	9 557	3 811	
Strategic Education Inc.	4	358	364	
Tri Pointe Homes Inc.	79	1 640	1 719	
Under Armour Inc., cat. A	101	1 388	1 085	
Vivint Smart Home Inc.	230	3 433	1 032	
Wayfair Inc.	449	46 153	25 230	
Wynn Resorts Ltd.	76	5 595	5 586	
		220 648	155 435	0,84
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 0,05 %)				
22nd Century Group Inc.	205	488	563	
Altria Group Inc.	161	9 025	8 675	
Hershey Co.	1	262	278	
J M Smucker Co.	2	321	330	
Lifevantage Corp.	175	3 264	982	
Performance Food Group Co.	57	3 451	3 381	
Post Holdings Inc.	8	810	850	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Rite Aid Corp.	46	710	400	
Simply Good Foods Co.	42	2 131	2 046	
Spectrum Brands Holdings Inc.	3	342	317	
Turning Point Brands Inc.	6	351	210	
Village Super Market Inc.	22	671	647	
		21 826	18 679	0,10
Soins de santé (31 décembre 2021 : 1,92 %)				
10X Genomics Inc.	6	327	350	
1Life Healthcare Inc.	36	360	364	
2seventy bio Inc.	20	650	341	
ABIOMED Inc.	2	604	639	
Acadia Pharmaceuticals Inc.	80	1 939	1 454	
Actinium Pharmaceuticals Inc.	25	373	155	
Adaptive Biotechnologies Corp.	127	3 867	1 325	
Adicet Bio Inc.	52	841	979	
Adverum Biotechnologies Inc.	1 327	4 023	2 054	
Agios Pharmaceuticals Inc.	138	8 704	3 947	
Akebia Therapeutics Inc.	1 261	4 698	574	
Alector Inc.	180	3 732	2 359	
Align Technology Inc.	1	490	305	
Allakos Inc.	414	4 555	1 672	
Allogene Therapeutics Inc.	44	688	647	
AmerisourceBergen Corp.	52	9 540	9 490	
Amicus Therapeutics Inc.	448	4 460	6 207	
AnaptysBio Inc.	143	3 951	3 745	
Arrowhead Pharmaceuticals Inc.	101	6 654	4 587	
Arvinas Inc.	214	20 989	11 619	
Assembly Biosciences Inc.	814	4 530	2 205	
Assertio Holdings Inc.	184	586	700	
Atara Biotherapeutics Inc.	67	1 093	673	
Athenex Inc.	206	959	109	
Atreca Inc.	207	765	478	
Axonics Inc.	22	1 717	1 608	
Bionano Genomics Inc.	1	7	2	
Black Diamond Therapeutics Inc.	114	367	362	
Bridgebio Pharma Inc.	60	678	703	
Bruker Corp.	4	326	324	
Cara Therapeutics Inc.	25	365	294	
CareDx Inc.	27	746	748	
Castle Biosciences Inc.	25	746	708	
Charles River Laboratories International Inc.	2	847	552	
Chimerix Inc.	675	4 668	1 811	
Chinook Therapeutics Inc.	131	3 154	2 956	
CIGNA Corp.	1	326	340	
Clearside Biomedical Inc.	291	815	552	
Cogent Biosciences Inc.	158	1 860	1 838	
Coherus Biosciences Inc.	194	2 876	1 812	
Collegium Pharmaceutical Inc.	19	537	434	
ConforMIS Inc.	7 738	13 388	3 532	
Corcept Therapeutics Inc.	62	1 485	1 902	
Crinetics Pharmaceuticals Inc.	13	376	313	
Cutera Inc.	20	1 474	967	
Cytokinetics Inc.	196	9 748	9 934	
CytomX Therapeutics Inc.	1 774	5 572	4 188	
CytoSorbents Corp.	109	358	308	
Editas Medicine Inc.	293	9 222	4 471	
Eiger BioPharmaceuticals Inc.	115	1 008	935	
Emergent Biosolutions Inc.	10	510	400	
Epizyme Inc.	3	10	6	
Exelixis Inc.	25	646	671	
Fate Therapeutics Inc.	90	3 674	2 877	
FibroGen Inc.	24	359	327	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
G1 Therapeutics Inc.	83	1 051	529	
Global Blood Therapeutics Inc.	33	1 223	1 360	
Gossamer Bio Inc.	99	1 335	1 069	
Halozyme Therapeutics Inc.	29	1 748	1 646	
Health Catalyst Inc.	88	2 142	1 645	
HealthStream Inc.	18	548	504	
Heska Corp.	1	313	122	
Homology Medicines Inc.	105	816	267	
Insmed Inc.	23	650	585	
Intellia Therapeutics Inc.	31	1 785	2 070	
Intercept Pharmaceuticals Inc.	371	10 289	6 609	
Intra-Cellular Therapies Inc.	12	901	884	
Ionis Pharmaceuticals Inc.	128	6 085	6 113	
IVERIC bio Inc.	415	7 497	5 150	
Jounce Therapeutics Inc.	289	2 899	1 130	
KalVista Pharmaceuticals Inc.	21	498	267	
Karuna Therapeutics Inc.	2	306	326	
Kezar Life Sciences Inc.	154	1 384	1 643	
Lineage Cell Therapeutics Inc.	233	369	475	
Lumos Pharma Inc.	15	364	149	
MacroGenics Inc.	138	510	525	
Mirum Pharmaceuticals Inc.	32	679	803	
Molina Healthcare Inc.	1	369	361	
NanoString Technologies Inc.	7	387	115	
Natera Inc.	169	8 984	7 726	
NeoGenomics Inc.	8	406	84	
Nevro Corp.	35	3 047	1 979	
NextCure Inc.	55	451	333	
NuVasive Inc.	5	368	317	
OPKO Health Inc.	430	1 457	1 403	
Pacira BioSciences Inc.	23	1 862	1 730	
Passage Bio Inc.	241	1 057	734	
PDL BioPharma Inc.	1 517	7 899	1 668	
Phreesia Inc.	15	791	484	
Precigen Inc.	128	345	221	
Precision BioSciences Inc.	36	413	74	
Puma Biotechnology Inc.	126	755	463	
Quanterix Corp.	95	4 619	1 984	
R1 RCM Inc.	36	1 209	973	
Radius Health Inc.	225	2 379	3 010	
Replimune Group Inc.	8	352	180	
Rhythm Pharmaceuticals Inc.	15	382	80	
Rocket Pharmaceuticals Inc.	53	857	941	
Sage Therapeutics Inc.	36	1 568	1 500	
Sangamo Therapeutics Inc.	417	5 368	2 227	
Sarepta Therapeutics Inc.	12	1 239	1 160	
Savara Inc.	995	1 713	1 951	
SeaSpine Holdings Corp.	25	493	182	
Selecta Biosciences Inc.	349	1 911	590	
SI-BONE Inc.	164	4 695	2 793	
SIGA Technologies Inc.	311	4 441	4 646	
Sorrento Therapeutics Inc.	2	21	5	
SpringWorks Therapeutics Inc.	35	955	1 112	
Synlogic Inc.	152	364	225	
Syros Pharmaceuticals Inc.	217	1 499	269	
Tabula Rasa HealthCare Inc.	128	957	424	
Tandem Diabetes Care Inc.	2	351	153	
Teladoc Health Inc.	551	23 961	23 605	
TherapeuticsMD Inc.	1	13	13	
Tonix Pharmaceuticals Holding Corp.	1	3	2	
Traverse Therapeutics Inc.	501	14 553	15 659	
Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	19	1 369	1 462	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
United Therapeutics Corp.	2	569	608	
Vanda Pharmaceuticals Inc.	51	752	717	
Vertex Pharmaceuticals Inc.	1	341	364	
Viking Therapeutics Inc.	347	1 669	1 294	
Voyager Therapeutics Inc.	161	1 366	1 227	
		309 195	223 772	1,21
Services financiers (31 décembre 2021 : 0,43 %)				
Allstate Corp.	44	6 986	7 193	
American Express Co.	4	770	715	
American International Group Inc.	5	345	330	
AMERISAFE Inc.	100	6 517	6 709	
Brown & Brown Inc.	151	10 958	11 364	
BRP Group Inc.	186	7 190	5 794	
Carter Bankshares Inc.	18	367	306	
Charles Schwab Corp.	103	10 025	8 394	
CNO Financial Group Inc.	34	819	793	
Columbia Banking System Inc.	46	1 676	1 700	
Crawford & Co., cat. A	29	360	292	
Eagle Bancorp Inc.	5	363	306	
Elevate Credit Inc.	310	1 105	944	
Enova International Inc.	14	558	520	
Granite Point Mortgage Trust Inc.	20	369	247	
Green Dot Corp.	40	1 618	1 296	
Greenhill & Co Inc.	30	577	357	
Hartford Financial Services Group Inc.	4	351	338	
HCI Group Inc.	13	1 088	1 136	
Intercontinental Exchange Inc.	14	1 760	1 698	
Kemper Corp.	74	4 628	4 572	
LendingClub Corp.	277	6 101	4 177	
Medallion Financial Corp.	114	849	941	
Mercury General Corp.	23	1 409	1 314	
Middlefield Banc Corp.	24	736	780	
Moody's Corp.	1	361	351	
Morgan Stanley	7	726	687	
Oppenheimer Holdings Inc.	8	426	341	
ProAssurance Corp.	14	416	427	
PROG Holdings Inc.	94	2 247	2 001	
Progressive Corp.	25	3 727	3 750	
Redwood Trust Inc.	190	1 882	1 890	
RLI Corp.	8	1 166	1 203	
Sculptor Capital Management Inc.	291	7 682	3 134	
Selective Insurance Group Inc.	12	1 178	1 346	
Southside Bancshares Inc.	7	370	338	
SVB Financial Group	1	507	510	
Tiptree Inc.	75	1 193	1 027	
Trupanion Inc.	10	1 382	777	
United Insurance Holdings Corp.	50	457	101	
Voya Financial Inc.	10	776	768	
		92 021	80 867	0,44
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 1,57 %)				
Alteryx Inc.	301	23 786	18 800	
Amtech Systems Inc.	29	359	273	
Bel Fuse Inc.	21	378	422	
Blackline Inc.	47	4 530	4 038	
Box Inc.	113	4 058	3 665	
Bread Financial Holdings Inc.	6	868	287	
Casa Systems Inc.	66	439	335	
Ceva Inc.	7	391	303	
Concentrix Corp.	2	207	350	
Coupa Software Inc.	337	37 077	24 822	
Daktronics Inc.	72	456	280	
Dell Technologies Inc.	8	440	477	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
DocuSign Inc.	64	4 963	4 737	
Edgio Inc.	426	2 239	1 269	
Everbridge Inc.	147	7 819	5 289	
Guidewire Software Inc.	17	1 675	1 557	
II-VI Inc.	10	725	657	
Infinera Corp.	405	4 069	2 800	
International Money Express Inc.	17	386	449	
LivePerson Inc.	89	3 981	1 623	
LiveRamp Holdings Inc.	58	2 597	1 931	
Momentive Global Inc.	493	8 263	5 596	
MongoDB Inc.	8	2 539	2 678	
New Relic Inc.	64	4 703	4 132	
Nutanix Inc.	258	5 984	4 869	
Okta Inc.	21	2 507	2 449	
OneSpan Inc.	56	993	860	
Pagerduty Inc.	45	1 623	1 438	
Palo Alto Networks Inc.	69	46 092	43 964	
PayPal Holdings Inc.	42	3 778	3 784	
Pegasystems Inc.	19	1 226	1 173	
Ping Identity Holding Corp.	406	13 011	9 500	
Pure Storage Inc.	231	8 413	7 661	
Q2 Holdings Inc.	27	2 318	1 343	
Rapid7 Inc.	173	24 300	14 907	
Sabre Corp.	1 063	13 496	7 994	
SecureWorks Corp.	174	3 313	2 438	
ServiceSource International Inc.	365	597	692	
Smartsheet Inc.	365	19 455	14 798	
SolarWinds Corp.	160	2 505	2 116	
Splunk Inc.	29	3 581	3 309	
SunPower Corp.	20	458	408	
Tenable Holdings Inc.	233	16 146	13 648	
Twilio Inc.	4	432	432	
Varonis Systems Inc.	84	4 493	3 177	
VirnetX Holding Corp.	457	712	690	
Wex Inc.	2	411	401	
Workiva Inc.	8	727	681	
Yext Inc.	427	5 354	2 633	
Zuora Inc.	317	5 524	3 660	
		304 397	235 795	1,27
Services de communication (31 décembre 2021: 0,69 %)				
Altice USA Inc.	1 076	12 640	12 839	
Angi Inc.	310	3 765	1 831	
Anterix Inc.	12	764	636	
Bandwidth Inc.	36	1 840	874	
comScore Inc.	605	2 677	1 608	
DHI Group Inc.	777	3 874	4 981	
EchoStar Corp.	48	1 337	1 195	
Fox Corp., cat. A	90	3 835	3 734	
Gaia Inc.	111	1 594	609	
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	98	4 576	4 557	
Loyalty Ventures Inc.	2	106	9	
NII Holdings Inc.	992	2 791	333	
Paramount Global	58	1 831	1 847	
Pinterest Inc.	132	3 657	3 092	
Sinclair Broadcast Group Inc.	41	1 265	1 079	
Skillz Inc.	354	3 648	566	
Spok Holdings Inc.	107	1 067	870	
TripAdvisor Inc.	714	25 022	16 394	
TrueCar Inc.	72	354	241	
Yelp Inc.	21	782	752	
		77 425	58 047	0,31

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Services publics (31 décembre 2021 : 0,01 %)				
Alliant Energy Corp.	12	866	907	
CenterPoint Energy Inc.	10	358	382	
Chesapeake Utilities Corp.	2	348	334	
Clearway Energy Inc., cat. C	18	736	809	
NextEra Energy Partners LP	3	319	287	
Northwest Natural Holding Co.	5	336	342	
OGE Energy Corp.	30	1 511	1 492	
ONE Gas Inc.	3	339	314	
Sempra Energy	2	396	388	
Star Group LP	40	570	473	
Sunnova Energy International Inc.	309	7 528	7 346	
		13 307	13 074	0,07
Immobilier (31 décembre 2021 : 0,15 %)				
Anywhere Real Estate Inc.	162	3 016	2 054	
Braemar Hotels & Resorts Inc.	605	4 438	3 348	
CatchMark Timber Trust Inc.	73	808	947	
Geo Group Inc.	373	3 309	3 176	
Healthcare Realty Trust Inc.	10	343	351	
Healthpeak Properties Inc.	101	3 214	3 376	
Independence Realty Trust Inc.	494	14 558	13 210	
Prologis Inc.	18	2 609	2 732	
Redfin Corp.	180	2 853	1 913	
Zillow Group Inc.	262	10 373	10 731	
		45 521	41 838	0,23
Total des actions américaines – position acheteur		1 579 893	1 302 342	7,03
Actions américaines – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2021 : -1,43 %)				
Alto Ingredients Inc.	(2)	(14)	(10)	
Antero Resources Corp.	(232)	(11 082)	(9 173)	
APA Corp.	(1 036)	(35 552)	(46 640)	
ChampionX Corp.	(723)	(21 969)	(18 513)	
CNX Resources Corp.	(95)	(2 197)	(2 017)	
Comstock Resources Inc.	(120)	(2 057)	(1 870)	
Continental Resources Inc.	(19)	(1 676)	(1 602)	
Diamondback Energy Inc.	(116)	(20 267)	(18 128)	
EOG Resources Inc.	(346)	(52 390)	(49 292)	
EQT Corp.	(709)	(21 220)	(31 462)	
Gevo Inc.	(486)	(1 586)	(1 473)	
Hess Corp.	(251)	(32 189)	(34 301)	
Marathon Oil Corp.	(1 313)	(29 628)	(38 075)	
Occidental Petroleum Corp.	(870)	(69 257)	(66 079)	
ONEOK Inc.	(10)	(853)	(716)	
Ovintiv Inc.	(1 100)	(71 198)	(62 624)	
Patterson-UTI Energy Inc.	(454)	(7 285)	(9 230)	
Range Resources Corp.	(142)	(5 420)	(4 534)	
RPC Inc.	(1 237)	(9 407)	(11 026)	
SM Energy Co.	(73)	(3 374)	(3 220)	
TETRA Technologies Inc.	(197)	(905)	(1 032)	
		(399 526)	(411 017)	(2,22)
Matières premières (31 décembre 2021 : -0,14 %)				
Amyris Inc.	(773)	(1 794)	(1 845)	
Century Aluminum Co.	(64)	(607)	(608)	
Flotek Industries Inc.	(367)	(588)	(470)	
Greif Inc.	(6)	(536)	(483)	
Marrone Bio Innovations Inc.	(235)	(411)	(352)	
Materion Corp.	(3)	(349)	(285)	
NewMarket Corp.	(5)	(2 072)	(1 941)	
Ranpak Holdings Corp.	(7)	(353)	(63)	
RPM International Inc.	(15)	(1 520)	(1 523)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Scotts Miracle-Gro Co.	(9)	(1 235)	(917)	
Southern Copper Corp.	(520)	(36 006)	(33 411)	
Stepan Co.	(19)	(2 887)	(2 484)	
United States Steel Corp.	(67)	(1 641)	(1 548)	
Westlake Corp.	(2)	(306)	(253)	
		(50 305)	(46 183)	(0,25)
Industries (31 décembre 2021: -0,80 %)				
AAON Inc.	(14)	(970)	(989)	
Aerovironment Inc.	(31)	(2 917)	(3 287)	
Alamo Group Inc.	(2)	(371)	(300)	
Albany International Corp.	(13)	(1 296)	(1 321)	
Allegiant Travel Co.	(2)	(306)	(292)	
API Group Corp.	(67)	(1 470)	(1 294)	
Apogee Enterprises Inc.	(22)	(1 299)	(1 113)	
Argan Inc.	(16)	(793)	(770)	
Armstrong World Industries Inc.	(12)	(1 167)	(1 160)	
Astec Industries Inc.	(40)	(3 584)	(2 104)	
Avis Budget Group Inc.	(64)	(22 396)	(12 143)	
Axon Enterprise Inc.	(15)	(2 502)	(1 803)	
Babcock & Wilcox Enterprises Inc.	(78)	(547)	(607)	
Boeing Co.	(146)	(25 709)	(25 749)	
Brady Corp.	(138)	(7 907)	(8 409)	
ChargePoint Holdings Inc.	(1 649)	(34 571)	(29 121)	
Crane Holdings Co.	(109)	(13 068)	(12 311)	
Custom Truck One Source Inc.	(78)	(560)	(563)	
Daseke Inc.	(239)	(1 906)	(1 970)	
Desktop Metal Inc.	(1 517)	(12 585)	(4 305)	
Donaldson Co Inc.	(8)	(497)	(497)	
Dycom Industries Inc.	(3)	(302)	(360)	
Energous Corp.	(466)	(757)	(601)	
Energy Recovery Inc.	(59)	(1 593)	(1 478)	
Enerpac Tool Group Corp.	(17)	(441)	(417)	
Franklin Electric Co Inc.	(76)	(7 045)	(7 182)	
FTI Consulting Inc.	(56)	(12 175)	(13 064)	
FuelCell Energy Inc.	(464)	(2 339)	(2 245)	
GATX Corp.	(2)	(292)	(243)	
Gibraltar Industries Inc.	(49)	(2 591)	(2 449)	
Gorman-Rupp Co.	(8)	(372)	(292)	
Graham Corp.	(257)	(4 016)	(2 294)	
Helios Technologies Inc.	(3)	(417)	(256)	
Hillenbrand Inc.	(25)	(1 402)	(1 321)	
HNI Corp.	(27)	(1 321)	(1 208)	
Huron Consulting Group Inc.	(7)	(481)	(587)	
Hyllion Holdings Corp.	(736)	(4 075)	(3 057)	
Hyster-Yale Materials Handling Inc.	(4)	(482)	(166)	
Ideanomics Inc.	(4 010)	(9 565)	(3 427)	
Ingersoll Rand Inc.	(16)	(894)	(869)	
JELD-WEN Holding Inc.	(11)	(354)	(207)	
John Bean Technologies Corp.	(10)	(1 401)	(1 424)	
KAR Auction Services Inc.	(136)	(2 342)	(2 591)	
Kforce Inc.	(11)	(1 018)	(870)	
Kimball International Inc.	(73)	(728)	(722)	
Lennox International Inc.	(3)	(812)	(799)	
Manpowergroup Inc.	(14)	(1 409)	(1 380)	
Matson Inc.	(9)	(1 331)	(846)	
MSA Safety Inc.	(3)	(521)	(469)	
Nikola Corp.	(903)	(9 431)	(5 545)	
Orbital Energy Group Inc.	(101)	(416)	(82)	
Orion Energy Systems Inc.	(83)	(335)	(215)	
Orion Group Holdings Inc.	(157)	(1 040)	(462)	
Otis Worldwide Corp.	(135)	(12 224)	(12 307)	
Parsons Corp.	(144)	(6 961)	(7 508)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
REV Group Inc.	(17)	(360)	(238)	
Skillssoft Corp.	(616)	(5 962)	(2 797)	
Snap-on Inc.	(28)	(7 275)	(7 116)	
Spirit Aerosystems Holdings Inc.	(181)	(7 570)	(6 841)	
SPX Corp.	(43)	(2 917)	(2 931)	
Stanley Black & Decker Inc.	(131)	(18 159)	(17 720)	
Tennant Co.	(22)	(1 723)	(1 681)	
Textron Inc.	(1)	(47)	(79)	
Titan International Inc.	(249)	(3 644)	(4 850)	
TPI Composites Inc.	(7)	(388)	(113)	
UFP Industries Inc.	(4)	(344)	(352)	
Unifirst Corp.	(1)	(259)	(222)	
Watts Water Technologies Inc.	(21)	(3 714)	(3 328)	
Welbilt Inc.	(1)	(24)	(31)	
Willdan Group Inc.	(25)	(1 012)	(889)	
		(280 702)	(236 239)	(1,27)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -1,08 %)				
Acushnet Holdings Corp.	(38)	(2 478)	(2 043)	
AMMO Inc.	(1 238)	(9 694)	(6 148)	
Boot Barn Holdings Inc.	(12)	(1 110)	(1 067)	
Caesars Entertainment Inc.	(45)	(2 757)	(2 223)	
CarParts.com Inc.	(32)	(337)	(286)	
Carter's Inc.	(3)	(367)	(273)	
Chico's FAS Inc.	(875)	(5 544)	(5 610)	
Crocs Inc.	(245)	(17 170)	(15 382)	
Denny's Corp.	(70)	(975)	(784)	
Domino's Pizza Inc.	(6)	(2 651)	(3 016)	
El Pollo Loco Holdings Inc.	(46)	(643)	(584)	
Ethan Allen Interiors Inc.	(366)	(11 876)	(9 542)	
Flexsteel Industries Inc.	(13)	(442)	(302)	
Foot Locker Inc.	(9)	(364)	(293)	
Fossil Group Inc.	(291)	(4 441)	(1 941)	
General Motors Co.	(45)	(2 009)	(1 844)	
Genesco Inc.	(13)	(1 061)	(837)	
Gentherm Inc.	(25)	(2 424)	(2 013)	
GoPro Inc.	(71)	(597)	(506)	
Graham Holdings Co.	(3)	(2 192)	(2 194)	
Groupon Inc.	(28)	(551)	(408)	
GrowGeneration Corp.	(544)	(21 225)	(2 519)	
Haverty Furniture Cos Inc.	(31)	(1 057)	(927)	
Horizon Global Corp.	(347)	(2 144)	(730)	
Inspired Entertainment Inc.	(39)	(588)	(433)	
Johnson Outdoors Inc.	(3)	(379)	(237)	
Kandi Technologies Group Inc.	(521)	(6 355)	(1 613)	
Laureate Education Inc.	(328)	(4 908)	(4 895)	
La-Z-Boy Inc.	(23)	(741)	(703)	
Lear Corp.	(2)	(435)	(325)	
LL Flooring Holdings Inc.	(49)	(797)	(592)	
Lordstown Motors Corp.	(360)	(747)	(734)	
Lovesac Co.	(183)	(13 921)	(6 492)	
Luminar Technologies Inc.	(489)	(7 826)	(3 741)	
MercadoLibre Inc.	(15)	(12 682)	(12 323)	
Modine Manufacturing Co.	(19)	(381)	(258)	
Monarch Casino & Resort Inc.	(5)	(413)	(378)	
Motorcar Parts of America Inc.	(450)	(11 345)	(7 616)	
Party City Holdco Inc.	(450)	(749)	(766)	
Patrick Industries Inc.	(33)	(2 471)	(2 207)	
Peloton Interactive Inc.	(1 343)	(24 453)	(15 904)	
Pool Corp.	(3)	(1 386)	(1 359)	
PulteGroup Inc.	(5)	(338)	(256)	
Purple Innovation Inc.	(943)	(26 401)	(3 722)	
RealReal Inc.	(218)	(1 068)	(700)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Rent-A-Center Inc.	(20)	(525)	(502)	
RH	(6)	(2 037)	(1 643)	
Shift Technologies Inc.	(167)	(416)	(145)	
Skechers USA Inc.	(8)	(385)	(367)	
Skyline Champion Corp.	(15)	(933)	(918)	
Stoneridge Inc.	(15)	(372)	(332)	
Sturm Ruger & Co Inc.	(11)	(975)	(903)	
Visteon Corp.	(60)	(8 022)	(8 017)	
Whirlpool Corp.	(1)	(270)	(200)	
XL Fleet Corp.	(1 329)	(10 746)	(1 972)	
XPEL Inc.	(22)	(1 815)	(1 303)	
		(238 989)	(143 028)	(0,77)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021: -0,62 %)				
Calavo Growers Inc.	(141)	(6 653)	(7 588)	
Celsius Holdings Inc.	(602)	(50 667)	(50 678)	
Central Garden & Pet Co.	(18)	(1 084)	(929)	
Chefs' Warehouse Inc.	(228)	(6 153)	(11 438)	
Freshpet Inc.	(84)	(7 075)	(5 623)	
Hain Celestial Group Inc.	(27)	(927)	(827)	
LifeMD Inc.	(107)	(848)	(282)	
MedAvail Holdings Inc.	(394)	(823)	(778)	
Medifast Inc.	(8)	(1 864)	(1 863)	
Nu Skin Enterprises Inc.	(17)	(934)	(950)	
Vector Group Ltd.	(20)	(383)	(271)	
Walgreens Boots Alliance Inc.	(5)	(338)	(244)	
		(77 749)	(81 471)	(0,44)
Soins de santé (31 décembre 2021: -1,61 %)				
Acadia Healthcare Co Inc.	(6)	(512)	(523)	
Accuray Inc.	(192)	(663)	(485)	
AdaptHealth Corp.	(817)	(24 542)	(19 012)	
ADMA Biologics Inc.	(29)	(63)	(74)	
Aerie Pharmaceuticals Inc.	(34)	(353)	(329)	
Agenus Inc.	(703)	(1 440)	(1 759)	
Alaunos Therapeutics Inc.	(913)	(4 511)	(1 460)	
Alphatec Holdings Inc.	(607)	(7 674)	(5 121)	
ANI Pharmaceuticals Inc.	(49)	(2 307)	(1 875)	
Ardelyx Inc.	(798)	(739)	(607)	
Asensus Surgical Inc.	(956)	(1 491)	(491)	
Avid Bioservices Inc.	(205)	(5 133)	(4 035)	
Axsome Therapeutics Inc.	(10)	(483)	(494)	
Baxter International Inc.	(3)	(330)	(249)	
Beam Therapeutics Inc.	(206)	(12 519)	(10 286)	
BioLife Solutions Inc.	(299)	(7 799)	(5 326)	
Celcuity Inc.	(27)	(807)	(317)	
Checkpoint Therapeutics Inc.	(110)	(376)	(146)	
Citius Pharmaceuticals Inc.	(813)	(1 057)	(965)	
ContraFect Corp.	(100)	(439)	(396)	
CTI BioPharma Corp.	(618)	(3 699)	(4 759)	
Danaher Corp.	(17)	(5 593)	(5 560)	
Deciphera Pharmaceuticals Inc.	(37)	(460)	(628)	
DENTSPLY SIRONA Inc.	(134)	(6 884)	(6 176)	
DermTech Inc.	(185)	(2 298)	(1 322)	
Equillum Inc.	(111)	(355)	(292)	
Evolus Inc.	(25)	(376)	(374)	
Fulgent Genetics Inc.	(53)	(3 776)	(3 728)	
Galectin Therapeutics Inc.	(604)	(2 445)	(1 021)	
Geron Corp.	(622)	(1 088)	(1 244)	
HealthEquity Inc.	(10)	(896)	(792)	
Humanigen Inc.	(109)	(339)	(249)	
iBio Inc.	(3 002)	(4 632)	(1 022)	
Ideaya Biosciences Inc.	(20)	(608)	(356)	
IGM Biosciences Inc.	(44)	(1 264)	(1 023)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
ImmunityBio Inc.	(1 004)	(5 988)	(4 818)	
Immunogen Inc.	(917)	(5 094)	(5 323)	
Inovio Pharmaceuticals Inc.	(1 048)	(2 552)	(2 339)	
Insulet Corp.	(12)	(3 212)	(3 374)	
Intuitive Surgical Inc.	(1)	(466)	(259)	
Invitae Corp.	(436)	(13 968)	(1 372)	
Iovance Biotherapeutics Inc.	(261)	(3 339)	(3 717)	
iRhythm Technologies Inc.	(11)	(1 864)	(1 533)	
Karyopharm Therapeutics Inc.	(57)	(339)	(332)	
Lantheus Holdings Inc.	(29)	(2 370)	(2 470)	
LeMaitre Vascular Inc.	(6)	(408)	(353)	
Ligand Pharmaceuticals Inc., cat. B	(47)	(7 839)	(5 409)	
Magenta Therapeutics Inc.	(48)	(397)	(74)	
Marinus Pharmaceuticals Inc.	(110)	(1 350)	(687)	
MediciNova Inc.	(65)	(575)	(212)	
Meridian Bioscience Inc.	(77)	(2 337)	(3 022)	
Mersana Therapeutics Inc.	(174)	(900)	(1 037)	
MiMedx Group Inc.	(361)	(2 297)	(1 616)	
Moderna Inc.	(275)	(50 712)	(50 674)	
NightHawk Biosciences Inc.	(198)	(1 548)	(651)	
Ocugen Inc.	(814)	(4 271)	(2 384)	
Omeros Corp.	(91)	(346)	(323)	
OptimizeRx Corp.	(48)	(4 955)	(1 696)	
Oramed Pharmaceuticals Inc.	(235)	(1 407)	(1 388)	
Organogenesis Holdings Inc.	(277)	(1 930)	(1 744)	
Otonomy Inc.	(154)	(370)	(413)	
Outlook Therapeutics Inc.	(1 297)	(2 378)	(1 707)	
Pacific Biosciences of California Inc.	(515)	(3 610)	(2 936)	
Palatin Technologies Inc.	(606)	(547)	(219)	
PAVmed Inc.	(801)	(2 056)	(966)	
Pennant Group Inc.	(43)	(1 416)	(711)	
PerkinElmer Inc.	(11)	(2 006)	(2 018)	
Personalis Inc.	(30)	(365)	(134)	
Pfizer Inc.	(526)	(34 434)	(35 575)	
Progyny Inc.	(20)	(814)	(749)	
Provention Bio Inc.	(65)	(480)	(335)	
QuidelOrtho Corp.	(5)	(571)	(627)	
Regeneron Pharmaceuticals Inc.	(3)	(2 334)	(2 288)	
Revanche Therapeutics Inc.	(110)	(1 922)	(1 961)	
Rigel Pharmaceuticals Inc.	(10)	(43)	(15)	
SCYNEXIS Inc.	(148)	(719)	(355)	
Seagen Inc.	(7)	(1 595)	(1 598)	
Seelos Therapeutics Inc.	(378)	(720)	(332)	
Simulations Plus Inc.	(18)	(1 160)	(1 145)	
Solid Biosciences Inc.	(27)	(343)	(21)	
Spectrum Pharmaceuticals Inc.	(585)	(840)	(589)	
Standard BioTools Inc.	(134)	(436)	(277)	
Stereotaxis Inc.	(52)	(429)	(123)	
Surgery Partners Inc.	(23)	(960)	(858)	
TG Therapeutics Inc.	(1 041)	(8 520)	(5 707)	
Twist Bioscience Corp.	(90)	(5 159)	(4 059)	
Vapotherm Inc.	(243)	(1 224)	(793)	
Vaxart Inc.	(105)	(653)	(474)	
Veracyte Inc.	(80)	(3 008)	(2 054)	
ViewRay Inc.	(104)	(736)	(356)	
Vir Biotechnology Inc.	(49)	(1 413)	(1 610)	
VistaGen Therapeutics Inc.	(1 154)	(2 160)	(1 310)	
Xencor Inc.	(51)	(2 507)	(1 801)	
Xeris Biopharma Holdings Inc.	(192)	(527)	(381)	
Zentalis Pharmaceuticals Inc.	(302)	(9 138)	(10 947)	
		(324 008)	(264 747)	(1,43)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Services financiers (31 décembre 2021 : -0,28 %)				
AG Mortgage Investment Trust Inc.	(214)	(2 062)	(1 863)	
Ambac Financial Group Inc.	(768)	(7 835)	(11 244)	
Apollo Commercial Real Estate Finance Inc.	(21)	(361)	(283)	
Apollo Global Management Inc.	(24)	(1 502)	(1 501)	
Ares Commercial Real Estate Corp.	(19)	(359)	(300)	
Arlington Asset Investment Corp.	(269)	(1 958)	(1 128)	
ARMOUR Residential REIT Inc.	(794)	(8 862)	(7 211)	
Bancorp Inc.	(13)	(506)	(327)	
BrightSpire Capital Inc.	(526)	(5 708)	(5 123)	
Broadmark Realty Capital Inc.	(119)	(1 087)	(1 030)	
Citizens & Northern Corp.	(20)	(623)	(624)	
Civista Bancshares Inc.	(100)	(2 743)	(2 742)	
Comerica Inc.	(3)	(381)	(284)	
First American Financial Corp.	(4)	(360)	(273)	
First Interstate Bancsystem Inc.	(26)	(1 134)	(1 278)	
Franklin Resources Inc.	(33)	(1 060)	(992)	
Hope Bancorp Inc.	(18)	(363)	(321)	
Houlihan Lokey Inc.	(3)	(314)	(305)	
Invesco Mortgage Capital Inc.	(256)	(11 895)	(4 848)	
KKR Real Estate Finance Trust Inc.	(105)	(2 473)	(2 364)	
Ladder Capital Corp.	(28)	(397)	(381)	
Live Oak Bancshares Inc.	(49)	(3 449)	(2 142)	
MBIA Inc.	(67)	(1 151)	(1 067)	
Northfield Bancorp Inc.	(60)	(951)	(1 008)	
Orchid Island Capital Inc.	(283)	(1 156)	(1 040)	
Origin Bancorp Inc.	(21)	(1 050)	(1 051)	
Provident Financial Services Inc.	(14)	(404)	(402)	
Republic Bancorp Inc.	(7)	(423)	(436)	
Silvergate Capital Corp.	(63)	(7 787)	(4 350)	
Southern Missouri Bancorp Inc.	(100)	(5 754)	(5 838)	
StoneX Group Inc.	(5)	(395)	(504)	
Valley National Bancorp	(38)	(571)	(510)	
Walker & Dunlop Inc.	(3)	(385)	(373)	
Washington Federal Inc.	(38)	(1 513)	(1 472)	
Westamerica BanCorp	(5)	(364)	(359)	
WisdomTree Investments Inc.	(733)	(5 486)	(4 794)	
World Acceptance Corp.	(10)	(2 775)	(1 448)	
		(85 597)	(71 216)	(0,38)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -1,55 %)				
3D Systems Corp.	(355)	(6 369)	(4 442)	
Aeva Technologies Inc.	(38)	(369)	(153)	
Amphenol Corp.	(3)	(336)	(249)	
Arlo Technologies Inc.	(82)	(914)	(663)	
Aspen Technology Inc.	(3)	(698)	(711)	
Badger Meter Inc.	(8)	(986)	(835)	
Bill.Com Holdings Inc.	(39)	(6 094)	(5 531)	
Block Inc.	(41)	(4 346)	(3 251)	
BTRS Holdings Inc.	(502)	(4 176)	(3 225)	
Cleantech Inc.	(425)	(7 238)	(2 149)	
CloudFlare Inc.	(22)	(1 269)	(1 242)	
Corning Inc.	(8)	(385)	(325)	
CSG Systems International Inc.	(35)	(2 600)	(2 694)	
CTS Corp.	(21)	(959)	(922)	
Diebold Nixdorf Inc.	(59)	(528)	(173)	
Digital Turbine Inc.	(658)	(34 367)	(14 828)	
Diodes Inc.	(4)	(424)	(333)	
Eastman Kodak Co.	(116)	(579)	(694)	
ePlus Inc.	(22)	(1 723)	(1 507)	
Fastly Inc.	(1 058)	(17 087)	(15 845)	
Hims & Hers Health Inc.	(67)	(347)	(392)	
Immersion Corp.	(447)	(3 921)	(3 079)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Impinj Inc.	(6)	(542)	(454)	
InterDigital Inc.	(21)	(1 668)	(1 647)	
Kaleyra Inc.	(173)	(782)	(455)	
Kopin Corp.	(111)	(361)	(160)	
Lam Research Corp.	(5)	(2 937)	(2 749)	
Littelfuse Inc.	(47)	(15 263)	(15 402)	
Marathon Digital Holdings Inc.	(713)	(16 689)	(4 911)	
Meta Materials Inc.	(1 323)	(3 006)	(1 758)	
MicroStrategy Inc.	(3)	(651)	(636)	
MICT Inc.	(738)	(1 352)	(541)	
Mitek Systems Inc.	(191)	(2 553)	(2 277)	
Napco Security Technologies Inc.	(50)	(721)	(1 328)	
National Instruments Corp.	(13)	(573)	(524)	
Onto Innovation Inc.	(4)	(436)	(360)	
OSI Systems Inc.	(6)	(637)	(661)	
PAR Technology Corp.	(39)	(2 323)	(1 886)	
Paysign Inc.	(121)	(350)	(237)	
PC Connection Inc.	(8)	(540)	(455)	
PDF Solutions Inc.	(26)	(551)	(721)	
PFSweb Inc.	(82)	(1 265)	(1 244)	
Photonics Inc.	(25)	(540)	(628)	
Plexus Corp.	(8)	(873)	(810)	
Rekor Systems Inc.	(220)	(1 526)	(499)	
Repay Holdings Corp.	(131)	(3 073)	(2 171)	
Riot Blockchain Inc.	(1 086)	(31 121)	(5 870)	
Sanmina Corp.	(7)	(349)	(368)	
ShotSpotter Inc.	(75)	(4 358)	(2 603)	
SiTime Corp.	(10)	(2 866)	(2 103)	
Smith Micro Software Inc.	(73)	(283)	(233)	
Super Micro Computer Inc.	(7)	(463)	(364)	
TD Synnex Corp.	(342)	(43 224)	(40 190)	
Teradyne Inc.	(4)	(623)	(462)	
Turtle Beach Corp.	(100)	(3 846)	(1 578)	
Tyler Technologies Inc.	(1)	(431)	(429)	
Ubiquiti Inc.	(11)	(4 107)	(3 522)	
Universal Display Corp.	(2)	(490)	(261)	
Velodyne Lidar Inc.	(2 351)	(20 674)	(2 897)	
Veritone Inc.	(186)	(6 038)	(1 567)	
Verra Mobility Corp.	(92)	(1 658)	(1 864)	
Wrap Technologies Inc.	(268)	(1 042)	(643)	
Zoom Video Communications Inc.	(63)	(9 383)	(8 774)	
		(285 883)	(179 485)	(0,97)
Services de communication (31 décembre 2021 : -0,19 %)				
Cardlytics Inc.	(13)	(491)	(374)	
Cinedigm Corp.	(825)	(1 670)	(524)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	(1 151)	(3 754)	(1 589)	
CuriosityStream Inc.	(48)	(412)	(105)	
Daily Journal Corp.	(1)	(479)	(334)	
DISH Network Corp.	(8)	(360)	(185)	
Eventbrite Inc.	(21)	(386)	(278)	
EW Scripps Co.	(61)	(1 006)	(981)	
Gannett Co Inc.	(205)	(1 025)	(767)	
Globalstar Inc.	(4 920)	(8 301)	(7 806)	
IAC/InterActiveCorp	(4)	(415)	(392)	
iHeartMedia Inc.	(190)	(2 138)	(1 934)	
John Wiley & Sons Inc.	(24)	(1 674)	(1 479)	
Madison Square Garden Sports Corp.	(3)	(650)	(584)	
Magnite Inc.	(32)	(384)	(367)	
Marchex Inc., cat. B	(146)	(343)	(249)	
Marcus Corp.	(37)	(740)	(705)	
Match Group Inc.	(20)	(2 092)	(1 798)	
National CineMedia Inc.	(173)	(325)	(204)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Netflix Inc.	(135)	(31 178)	(30 453)	
Stagwell Inc.	(49)	(345)	(343)	
TechTarget Inc.	(4)	(344)	(339)	
Townsquare Media Inc.	(100)	(1 287)	(1 056)	
WideOpenWest Inc.	(39)	(995)	(916)	
World Wrestling Entertainment Inc.	(63)	(5 085)	(5 078)	
		(65 879)	(58 840)	(0,32)
Services publics (31 décembre 2021 : -0,01 %)				
American States Water Co.	(5)	(544)	(526)	
Cadiz Inc.	(254)	(752)	(763)	
Middlesex Water Co.	(3)	(301)	(339)	
Pure Cycle Corp.	(71)	(1 040)	(965)	
SJW Group	(5)	(391)	(403)	
		(3 028)	(2 996)	(0,02)
Immobilier (31 décembre 2021 : -0,16 %)				
Apartment Investment and Management Co.	(142)	(1 059)	(1 172)	
Armada Hoffer Properties Inc.	(286)	(4 838)	(4 737)	
Douglas Elliman Inc.	(10)	(128)	(62)	
EastGroup Properties Inc.	(6)	(1 184)	(1 194)	
Essential Properties Realty Trust Inc.	(11)	(341)	(305)	
eXp World Holdings Inc.	(947)	(26 205)	(14 378)	
Highwoods Properties Inc.	(8)	(346)	(353)	
Innovative Industrial Properties Inc.	(7)	(1 732)	(992)	
iStar Inc.	(48)	(1 027)	(849)	
Jones Lang LaSalle Inc.	(1)	(309)	(226)	
Life Storage Inc.	(2)	(376)	(288)	
Marcus & Millichap Inc.	(5)	(353)	(239)	
Maui Land & Pineapple Co Inc.	(100)	(1 478)	(1 222)	
Paramount Group Inc.	(247)	(2 378)	(2 304)	
RLJ Lodging Trust	(78)	(1 309)	(1 110)	
RPT Realty	(24)	(361)	(304)	
SBA Communications Corp.	(1)	(495)	(413)	
Stratus Properties Inc.	(100)	(3 858)	(4 157)	
Tejon Ranch Co.	(100)	(1 964)	(2 002)	
Veris Residential Inc.	(73)	(1 527)	(1 247)	
Whitestone REIT	(217)	(2 974)	(3 009)	
		(54 242)	(40 563)	(0,22)
Total des actions américaines – position vendeur		(1 865 908)	(1 535 785)	(8,29)
Actions étrangères – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2021 : 0,91 %)				
Aker Bp ASA	15	735	670	
Aker Solutions ASA	2 608	7 291	9 112	
Ardmore Shipping Corp.	75	349	674	
Borr Drilling Ltd.	217	866	1 247	
BP PLC	98	3 631	3 584	
BW Energy Ltd.	129	477	431	
BW LPG Ltd.	61	358	581	
BW Offshore Ltd.	256	1 057	889	
Delek Group Ltd.	40	6 917	6 702	
DHT Holdings Inc.	383	2 674	3 029	
DNO ASA	871	1 567	1 553	
Dorian LPG Ltd.	309	6 018	6 059	
Elixir Energy Ltd.	2 578	345	309	
Equinor ASA, CAAE	623	28 170	27 935	
FLEX LNG Ltd.	307	7 760	10 919	
Frontline Ltd., NYSE	129	1 563	1 474	
International Seaways Inc.	388	8 474	10 611	
Japan Petroleum Exploration Co., Ltd.	200	4 773	6 086	
Magnora ASA	540	1 618	1 227	
MOL Hungarian Oil & Gas PLC	483	4 844	4 790	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Nabors Industries Ltd.	41	7 092	7 082	
Nabors Industries Ltd., bons de souscription, éch. le 11 juin 2026	26	-	1 073	
Nippon Coke & Engineering Co., Ltd.	300	454	330	
Nordic American Tankers Ltd.	1 642	5 081	4 512	
Panoro Energy ASA	68	209	249	
Petroleo Brasileiro SA, parts	146	2 575	2 200	
PGS ASA	815	820	707	
Saras SpA	3 914	3 793	7 321	
Schlumberger NV	50	2 380	2 306	
Scorpio Tankers Inc.	254	8 461	11 307	
Semirara Mining & Power Corp.	700	502	575	
SFL Corp. Ltd.	1 712	15 981	20 958	
Teekay Corp.	268	1 136	996	
Teekay Tankers Ltd.	25	434	569	
TORM PLC	32	505	558	
Transocean Ltd.	5 477	23 952	23 527	
Transport de Gas del Sur S.A., CAAE	39	359	259	
YPF SA	5 863	32 439	24 655	
		195 660	207 066	1,12
Matières premières (31 décembre 2021 : 0,81 %)				
Aluminum Corp. of China Ltd., CAAE	100	1 721	1 227	
Asahi Kasei Corp.	300	3 534	2 951	
Borregaard ASA	12	369	251	
Cemex SAB de CV	1	7	5	
CRH PLC	153	7 442	6 872	
Dottikon Es Holding AG	1	405	276	
Elkem ASA	74	326	303	
Ferroglobe PLC	38	398	291	
Fujikura Kasei Co., Ltd.	200	1 390	877	
Gerdau SA	163	976	902	
Grange Resources Ltd.	5 050	1 286	5 667	
Harmony Gold Mining Co., Ltd.	3	21	12	
Hexpol AB	25	403	274	
Israel Corp. Ltd.	21	12 195	11 873	
Konoshima Chemical Co., Ltd.	100	1 692	1 055	
Kuraray Co., Ltd.	200	2 253	2 079	
Linde PLC	1	379	371	
Mitsubishi Gas Chemical Co Inc.	400	9 037	7 425	
Nissan Chemical Corp.	100	7 490	5 934	
Norsk Hydro ASA	2 638	30 831	18 999	
Norske Skog ASA	647	5 025	4 621	
Novozymes A/S	23	1 833	1 777	
Orica Ltd.	285	4 201	3 987	
Philex Mining Corp.	10 800	1 434	869	
Philex Mining Corp., droits, éch. le 25 juill. 2022	1 840	-	12	
POSCO Holdings Inc.	9	757	517	
Regis Resources Ltd.	377	711	435	
Sandfire Resources Ltd.	642	3 300	2 534	
Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	400	82 163	58 110	
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	493	56 339	53 121	
Stora Enso OYJ	31	769	626	
Suzano SA	46	569	563	
Ten Sixty Four Ltd.	1 777	1 048	1 088	
Tokuyama Corp.	500	11 516	8 194	
Tokyo Steel Manufacturing Co., Ltd.	400	5 731	5 682	
Tosoh Corp.	100	1 913	1 600	
UPM-Kymmene OYJ	8	356	313	
Vale SA	840	18 647	15 853	
Venator Materials PLC	993	3 375	2 664	
Yara International ASA	15	872	806	
		282 714	231 016	1,25

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Industries (31 décembre 2021: 3,11 %)				
2020 Bulkers Ltd.	79	1 427	1 159	
AddTech AB	159	4 263	2 670	
Alfa Laval AB	238	9 345	7 388	
ANA Holdings Inc.	300	7 925	7 120	
Belimo Holding AG	7	3 784	3 169	
Bossard Holding AG	4	1 681	996	
Bystronic AG	1	1 701	935	
CNH Industrial NV	391	7 429	5 811	
Coor Service Management Holding AB	49	551	495	
Corp America Airports SA	625	3 587	4 499	
Costamare Inc.	37	710	578	
D/S Norden A/S	16	759	714	
Dai Nippon Printing Co., Ltd.	100	3 223	2 778	
Dfds A/S	5	371	195	
Elbit Systems Ltd.	43	11 201	12 626	
Elco Ltd.	37	1 980	3 064	
Embraer SA	1 162	16 746	13 161	
Endo Lighting Corp.	100	831	732	
Epiroc AB, cat. A	53	1 522	1 054	
FISmith & Co A/S	180	6 447	5 694	
Flughafen Zurich AG	34	7 818	6 611	
FNM SpA	1 461	1 017	860	
FSE Lifestyle Services Ltd.	994	650	842	
Gol Linhas Aereas Inteligentes SA	437	3 549	1 922	
Golden Ocean Group Ltd., NASD	1 656	20 882	24 865	
H+H International A/S	7	355	169	
Hexatronic Group AB	1 355	17 137	12 997	
Hino Motors Ltd.	100	1 093	662	
Huber + Suhner AG	3	365	308	
Indutrade AB	125	3 504	2 935	
International Container Terminal Services Inc.	160	571	691	
Investment AB Latour	8	360	204	
Inwido AB	8	72	114	
ISS A/S	200	4 413	4 058	
Japan Airlines Co., Ltd.	300	7 579	6 765	
JGC Holdings Corp.	400	4 446	6 662	
JMT Network Services PCL	100	303	267	
Kone OYJ	8	478	489	
Kongsberg Gruppen ASA	96	4 169	4 425	
Kornit Digital Ltd.	6	1 193	245	
Leonardo SpA	1 584	19 523	20 674	
Lifco AB	236	7 562	4 880	
Mitsui E&S Holdings Co., Ltd.	500	2 392	1 590	
Mitsui OSK Lines Ltd.	500	13 008	14 741	
Munters Group AB	75	506	558	
Nakano Corp.	100	575	284	
Nibe Industrier AB	1 870	28 859	18 079	
Nihon M&A Center Holdings Inc.	700	19 036	9 591	
Nilfisk Holding A/S	8	345	218	
Nippon Hume Corp.	100	710	618	
Nippon Sheet Glass Co., Ltd.	100	679	363	
Nitto Kogyo Corp.	200	4 926	4 457	
NKT A/S	107	6 161	5 852	
Okabe Co., Ltd.	200	1 480	1 155	
Openjobmetis Spa agenzia per il lavoro	24	366	291	
Pegasus Sewing Machine Manufacturing Co., Ltd.	200	1 079	1 134	
Pronexus Inc.	100	1 057	1 017	
Prysmian SpA	23	921	813	
Recruit Holdings Co., Ltd.	200	13 958	7 587	
RELX PLC, CAEE	81	2 721	2 815	
Rheinmetall AG	1	257	297	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Rieter Holding AG	6	1 741	886	
ROCKWOOL A/S	9	4 081	2 607	
Safe Bulkers Inc.	1 426	2 373	7 027	
Sandvik AB	819	20 589	17 099	
Sansha Electric Manufacturing Co., Ltd.	300	3 178	2 552	
Sanyo Trading Co., Ltd.	100	1 111	927	
Sato Shoji Corp.	100	1 185	1 062	
Scope Metals Group Ltd.	44	2 355	2 468	
Shikun & Binui Ltd.	6	28	31	
Shinwa Co., Ltd.	100	2 952	1 989	
Sinfonia Technology Co., Ltd.	100	1 474	1 270	
Skanska AB	38	894	750	
SKF AB	105	2 337	1 989	
Solar A/S	3	378	330	
Sumitomo Corp.	600	11 482	10 579	
Systemair AB	160	798	1 003	
Tobishima Corp.	100	1 007	969	
Toli Corp.	600	1 647	1 162	
TOMRA Systems ASA	166	4 379	3 959	
Tornos Holding AG	38	366	282	
TOTO Ltd.	100	6 223	4 254	
Toyo Engineering Corp.	200	2 321	1 225	
Trelleborg AB	18	490	467	
Troax Group AB	13	697	290	
Ushio Inc.	100	2 299	1 593	
Wallenius Wilhelmsen ASA	1 370	9 491	9 489	
Yasuda Logistics Corp.	100	987	882	
Yushin Precision Equipment Co., Ltd.	100	664	663	
		379 085	325 747	1,76
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 2,32 %)				
Aeffe SpA	261	758	514	
After You PCL	2	1	1	
Arcos Dorados Holdings Inc.	918	7 182	7 981	
Autogrill SpA	603	5 549	5 152	
BAIC Motor Corp. Ltd.	494	311	212	
Bloomberry Resorts Corp.	2 400	358	327	
Byggmax Group AB	33	353	221	
Carnival Corp.	14	366	156	
China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd.	2 500	3 349	3 049	
Clas Ohlson AB	50	881	666	
Cleanup Corp.	300	2 091	1 632	
Delek Automotive Systems Ltd.	244	3 333	3 415	
Delta Galil Industries Ltd.	63	3 008	3 977	
Dometic Group AB	38	365	287	
Elica SpA	100	420	371	
Farfetch Ltd.	103	1 186	951	
Ferrari NV	53	13 568	12 522	
Fiverr International Ltd.	115	5 776	5 102	
Flight Centre Travel Group Ltd.	73	1 361	1 124	
Fox Wixel Ltd.	2	434	292	
Geox SpA	216	373	215	
H & M Hennes & Mauritz AB	175	2 971	2 691	
H-One Co., Ltd.	400	3 435	2 264	
Hugo Boss AG	6	401	407	
Husqvarna AB	92	1 755	871	
IJTT Co., Ltd.	100	607	498	
JVCKenwood Corp.	200	665	336	
Komatsu Matere Co., Ltd.	100	1 107	1 068	
Lastminute.com NV	36	1 208	1 484	
Mazda Motor Corp.	800	8 911	8 432	
MIPS AB	9	729	506	
Mitchells & Butlers PLC	29	135	84	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Moncler SpA	96	7 108	5 299	
Nikon Corp.	1 900	23 875	28 306	
Nissan Motor Co., Ltd.	100	673	502	
Nissan Tokyo Sales Holdings Co., Ltd.	800	2 368	1 998	
Niu Technologies	602	16 369	6 678	
Oriental Land Co., Ltd.	100	20 082	17 965	
Pandora A/S	260	29 923	21 052	
Playtech Plc	114	843	967	
Sabaf SpA	9	355	285	
Salvatore Ferragamo SpA	73	1 778	1 447	
Sanlorenzo SpA	7	348	303	
Sandic Hotels Group AB	293	1 632	1 456	
Sega Sammy Holdings Inc.	100	2 128	2 068	
Sekisui Chemical Co., Ltd.	100	2 080	1 763	
Signet Jewelers Ltd.	11	801	759	
SkiStar AB	53	1 187	925	
Sony Group Corp.	100	14 297	10 535	
Sony Group Corp., CAAE	9	1 009	949	
Valora Holding AG	1	266	223	
Webjet Ltd.	209	1 137	990	
Yachiyo Industry Co., Ltd.	800	5 324	4 831	
		206 530	176 109	0,95
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 0,43 %)				
a2 Milk Co., Ltd.	539	2 272	2 131	
Adecoagro SA	458	7 221	4 998	
Ambev SA	2 428	8 099	7 861	
Anheuser-Busch InBev SA	575	41 494	40 016	
Axfood AB	37	1 380	1 371	
BRF SA	219	710	723	
Carlsberg AS	53	8 324	8 689	
Cia Cervecerias Unidas SA	20	357	326	
Cloetta AB	89	359	235	
Coca-Cola Femsa SAB de CV, NYSE	6	373	428	
CP ALL PCL	200	473	438	
Davide Campari-Milano NV	84	1 157	1 137	
Eco's Co., Ltd.	200	4 226	4 163	
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	44	4 046	3 831	
Grieg Seafood ASA	154	2 774	2 813	
Lucas Bols NV	100	1 395	1 362	
Mowi ASA	176	5 270	5 150	
Rami Levy Chain Stores Hashikma Marketing 2006 Ltd.	8	751	735	
Scandinavian Tobacco Group A/S	48	1 318	1 208	
		91 999	87 615	0,47
Soins de santé (31 décembre 2021 : 1,11 %)				
Affimed NV	59	353	211	
Alkermes PLC	149	5 423	5 726	
Ambu A/S	287	4 864	3 587	
Amplifon SpA	45	2 405	1 775	
Argenx SE, CAAE	48	22 267	23 459	
Arjo AB	44	588	358	
AstraZeneca PLC, CAAE	131	10 863	11 165	
Biohaven Pharmaceutical Holding Co., Ltd.	3	449	564	
Calliditas Therapeutics AB	65	1 041	756	
Chemometec A/S	41	6 100	5 628	
CRISPR Therapeutics AG	60	4 856	4 703	
Daiichi Sankyo Co., Ltd.	200	6 214	6 527	
Demant A/S	7	449	338	
Ebos Group Ltd.	264	9 333	8 260	
Eisai Co., Ltd.	200	15 695	10 872	
El.En. SpA	569	10 342	9 477	
Elekta AB	57	733	507	
Endo International PLC	594	1 335	357	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Galenica AG	17	1 545	1 679	
Genmab A/S	12	4 626	4 999	
GSK PLC	242	13 332	13 589	
Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc.	100	4 496	3 319	
Horizon Therapeutics Plc	3	344	309	
Humana AB	25	250	140	
Jazz Pharmaceuticals PLC	17	3 302	3 421	
Jeol Ltd.	200	18 907	9 932	
Koninklijke Philips NV, NYSE	386	10 413	10 720	
Linical Co., Ltd.	100	858	765	
Medicover AB	13	502	218	
Novartis AG, CAAE	164	17 574	17 883	
Novo Nordisk A/S	339	45 447	48 393	
Novo Nordisk A/S, CAAE	130	17 840	18 686	
Novocure Ltd.	14	1 127	1 255	
Perrigo Co PLC	11	551	576	
Prothena Corp. PLC	25	850	876	
Richter Gedeon Nyrt	20	596	464	
Sanofi, CAAE	485	32 489	31 300	
Sectra AB	72	1 480	1 245	
Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd.	500	9 253	9 391	
Thonburi Healthcare Group PCL	400	1 053	898	
uniQure NV	75	2 605	1 803	
Xvivo Perfusion AB	13	400	351	
Ypsomed Holding AG	2	503	349	
Zai Lab Ltd.	164	22 664	7 337	
		316 317	284 168	1,53
Services financiers (31 décembre 2021 : 0,30 %)				
ABG Sundal Collier Holding ASA	264	361	203	
Assicurazioni Generali SpA	1 262	30 571	25 912	
Avanza Bank Holding AB	247	9 315	5 337	
Axis Capital Holdings Ltd.	6	413	442	
Banca Generali SpA	93	4 223	3 381	
Banca IFIS SpA	18	366	328	
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, CAAE	706	5 434	4 116	
Banco BPM SpA	314	1 218	1 150	
Banco Bradesco SA	100	471	421	
BFF Bank SpA	172	1 925	1 488	
BPER Banca	3 125	8 034	6 606	
Burford Capital Ltd., NYSE	184	2 071	2 395	
Chiba Kogyo Bank Ltd.	200	741	488	
DNB Bank ASA	421	11 635	9 705	
Everest Re Group Ltd.	1	300	362	
FIBI Holdings Ltd.	56	3 238	3 020	
FinecoBank Banca Fineco SpA	237	3 862	3 650	
First International Bank Of Israel Ltd.	58	3 055	2 779	
Gjensidige Forsikring ASA	12	374	313	
Grupo Aval Acciones y Valores SA	106	713	485	
Helvetia Holding AG	7	1 077	1 054	
Humm Group Ltd.	275	426	100	
IDI Insurance Co., Ltd.	18	818	603	
Intesa Sanpaolo SpA	4 872	12 222	11 695	
ISX Financial EU Ltd.	375	-	-	
KB Financial Group Inc., CAAE	18	864	864	
Krung Thai Bank PCL	1 600	898	905	
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	28	359	312	
Olav Thon Eiendomsselskap ASA	13	355	283	
OTP Bank Nyrt	320	14 142	9 160	
Phoenix Holdings Ltd.	157	2 414	1 993	
Sparebank 1 Oestlandet	100	1 573	1 530	
Swiss Re AG	56	5 762	5 582	
Swissquote Group Holding SA	1	249	131	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Sydbank AS	17	815	670	
T&D Holdings Inc.	100	1 813	1 542	
Tamburi Investment Partners SpA	67	835	662	
Tochigi Bank Ltd.	1 400	3 375	3 403	
TOMONY Holdings Inc.	400	1 713	1 185	
Tryg A/S	361	10 544	10 432	
UniCredit SpA	4 785	65 084	58 496	
Willis Towers Watson PLC	1	254	255	
Yiren Digital Ltd.	107	363	248	
		214 275	183 686	0,99
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 1,57 %)				
A&D HOLON Holdings Co., Ltd.	100	1 223	856	
ASE Technology Holding Co., Ltd.	262	1 900	1 747	
AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	18	371	1 238	
Axell Corp.	400	4 020	2 966	
Cheetah Mobile Inc.	440	1 492	392	
China Aerospace International Holdings Ltd.	11 983	939	916	
Citizen Watch Co., Ltd.	500	2 603	2 621	
CMK Corp.	400	3 016	1 626	
Comet Holding AG	2	926	405	
CyberArk Software Ltd.	247	49 628	40 771	
Daitron Co., Ltd.	100	1 526	1 689	
Datalogic SpA	33	760	315	
Fingerprint Cards AB	252	759	284	
HMS Networks AB	8	458	440	
Hochiki Corp.	300	5 719	3 669	
ID Holdings Corp.	100	847	784	
ISB Corp.	600	9 176	5 765	
JinkoSolar Holding Co., Ltd.	285	17 232	25 433	
Kainos Group PLC	164	1 678	2 849	
Kyowa Electronic Instruments Co., Ltd.	1 000	5 020	2 962	
Lagercrantz Group AB	77	1 271	803	
LG Display Co., Ltd.	28	359	202	
Metaps Inc.	100	823	562	
Netbay PCL	1	1	1	
Nordic Semiconductor ASA	83	1 866	1 656	
Nova Ltd.	188	7 802	21 023	
NXP Semiconductors NV	2	385	382	
Radware Ltd.	63	2 523	1 761	
Reply SpA	46	9 750	7 177	
Saxa Holdings Inc.	200	4 506	2 512	
Southern Cross Payments Ltd.	3 745	3 967	3 554	
Sumco Corp.	600	16 078	10 021	
Sun-Wa Technos Corp.	200	2 875	2 442	
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	11	1 252	1 160	
Thine Electronics Inc.	100	988	1 223	
Tobii AB	489	4 009	1 087	
Truly International Holdings Ltd.	4 000	809	1 578	
Wiit SpA	16	781	375	
Wix.com Ltd.	186	21 891	15 728	
Xunlei Ltd.	153	1 163	312	
Yokogawa Electric Corp.	400	9 678	8 511	
		202 070	179 798	0,97
Services de communication (31 décembre 2021 : 1,36 %)				
Asahi Net Inc.	300	1 893	1 652	
Avex Inc.	100	1 721	1 280	
Cairo Communication SpA	511	1 294	1 188	
Chunghwa Telecom Co., Ltd.	389	20 817	20 699	
Citic Telecom International Holdings Ltd.	1 000	472	427	
Embracer Group AB	39	363	383	
G5 Entertainment AB	31	1 138	744	
Inke Ltd.	1 994	416	459	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Mediaset Espana Comunicacion SA	25	258	132	
Millicom International Cellular SA	448	13 056	8 234	
Paradox Interactive AB	17	437	382	
Partner Communications Co., Ltd., TLV	98	1 083	896	
Schibsted ASA	137	3 953	3 146	
SK Telecom Co., Ltd., CAAE	1 180	42 291	33 974	
Telecom Italia SpA	39 461	16 648	13 288	
Telefonica Brasil SA	642	8 435	7 503	
Telkom Indonesia Persero Tbk PT, CAAE	1 047	39 602	36 520	
TIM SA	113	2 092	1 771	
Tobii Dynavox AB	102	498	308	
Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	6 542	23 504	21 097	
TX Group AG	8	1 458	1 240	
		181 429	155 323	0,84
Services publics (31 décembre 2021 : 1,13 %)				
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC	347	15 122	14 440	
Brookfield Infrastructure Partners LP, TSE	2 499	118 072	122 901	
China Oil & Gas Group Ltd.	20 000	1 211	1 151	
Cia Energetica de Minas Gerais, CAAE	374	1 113	975	
Cia Paranaense de Energia, CAAE	206	1 953	1 690	
Infratil Ltd.	537	3 726	3 308	
Iren SPA	93	357	261	
Kenon Holdings Ltd.	315	16 557	16 232	
Korea Electric Power Corp.	28	360	317	
National Grid PLC, CAAE	52	4 981	4 339	
OPC Energy Ltd.	88	1 287	1 110	
Pampa Energia SA	12	374	317	
Snam SpA	166	1 236	1 119	
		166 349	168 160	0,91
Immobilier (31 décembre 2021 : 0,42 %)				
Airport City Ltd.	492	14 500	10 797	
Azrieli Group Ltd.	20	2 266	1 800	
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	2 080	1 223	1 347	
Country Garden Holdings Co., Ltd.	2 003	1 487	1 600	
Cresud SACIF y A	207	1 387	1 346	
Dios Fastigheter AB	31	441	277	
Eastnine AB	125	1 869	1 353	
G City Ltd.	275	3 513	2 014	
Goodman Property Trust	169	362	271	
Israel Land Development - Urban Renewal Ltd.	18	389	355	
Isras Investment Co., Ltd.	1	335	246	
Japan Excellent Inc.	1	1 551	1 163	
Nisshin Group Holdings Co., Ltd.	400	2 439	1 671	
Orix JREIT Inc.	3	5 847	5 247	
Peach Property Group AG	100	4 519	4 763	
Reit 1 Ltd.	5	42	34	
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, cat. B	62	525	133	
Selvaag Bolig ASA	412	2 906	1 912	
Unibail-Rodamco-Westfield	13	1 163	853	
Wihlborgs Fastigheter AB	30	436	270	
		47 200	37 452	0,20
Total des actions étrangères – position acheteur		2 283 628	2 036 140	10,99
Actions étrangères – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2021 : -0,88 %)				
Akastor ASA	(6 035)	(9 633)	(6 564)	
Beach Energy Ltd.	(416)	(457)	(637)	
Cooper Energy Ltd.	(8 968)	(3 057)	(1 949)	
Cooper Energy Ltd., droits, éch. le 7 juill. 2022	(3 586)	-	-	
CropEnergies AG	(318)	(5 486)	(5 446)	
d'Amico International Shipping SA	(9)	(1)	(2)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Deutsche Rohstoff AG	(68)	(2 649)	(2 696)	
Ecopetrol SA	(155)	(2 398)	(2 171)	
ENI SpA	(258)	(4 035)	(3 941)	
Eni SpA	(25)	(795)	(768)	
ERG SpA	(83)	(3 391)	(3 318)	
Euronav NV	(147)	(2 031)	(2 278)	
Galp Energia SGPS SA	(768)	(12 450)	(11 584)	
Orron Energy AB	(105)	(5 245)	(92)	
Paz Oil Co., Ltd.	(4)	(657)	(616)	
SBM Offshore NV	(137)	(2 679)	(2 390)	
Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	(33)	(2 149)	(2 390)	
Subsea 7 SA	(565)	(6 217)	(5 809)	
Tenaris SA	(1 524)	(59 642)	(50 504)	
TGS ASA	(505)	(10 564)	(9 119)	
Ultrapar Participacoes SA	(298)	(1 102)	(903)	
Woodside Energy Group Ltd., CAAE	(221)	(6 406)	(6 146)	
Worley Ltd.	(1 451)	(15 776)	(18 328)	
		(156 820)	(137 651)	(0,74)
Matières premières (31 décembre 2021 : -1,89 %)				
Accsys Technologies PLC	(463)	(812)	(799)	
Altri SGPS SA	(44)	(373)	(378)	
AMG Advanced Metallurgical Group NV	(35)	(1 527)	(1 161)	
AngloGold Ashanti Ltd.	(1 773)	(44 855)	(33 826)	
ArcelorMittal SA, NYSE	(35)	(1 192)	(1 020)	
Bellevue Gold Ltd.	(34 634)	(26 520)	(19 662)	
BHP Group Ltd.	(714)	(65 096)	(51 743)	
Buzzi Unicem SpA	(80)	(1 950)	(1 684)	
Cementir Holding NV	(100)	(878)	(835)	
Chr Hansen Holding A/S	(48)	(4 521)	(4 497)	
Cia de Minas Buenaventura SAA	(1 989)	(22 164)	(16 934)	
Cia Siderurgica Nacional SA	(3 154)	(17 736)	(11 921)	
Covestro AG	(5)	(287)	(222)	
Daicel Corp.	(300)	(2 921)	(2 390)	
Daiichi Kigenso Kagaku-Kogyo Co., Ltd.	(100)	(1 051)	(1 121)	
Fortescue Metals Group Ltd.	(45)	(834)	(700)	
GCC SAB de CV	(15)	(106)	(121)	
Gold Fields Ltd.	(5 232)	(67 801)	(61 551)	
Humble Group AB	(611)	(1 500)	(1 114)	
ICL Group Ltd.	(24)	(374)	(280)	
James Hardie Industries Plc	(450)	(17 335)	(12 682)	
Kemira OYJ	(185)	(3 050)	(2 909)	
Kobe Steel Ltd.	(400)	(2 532)	(2 343)	
Loma Negra Cia Industrial Argentina SA	(334)	(2 588)	(2 189)	
Mineral Resources Ltd.	(378)	(17 597)	(16 185)	
Mitsubishi Chemical Group Corp.	(700)	(5 944)	(4 899)	
Nippon Denko Co., Ltd.	(100)	(358)	(329)	
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	(5 300)	(85 995)	(50 878)	
OCI NV	(49)	(2 338)	(2 080)	
Oji Holdings Corp.	(300)	(1 859)	(1 675)	
Orora Ltd.	(109)	(359)	(353)	
Perenti Global Ltd.	(1 354)	(996)	(787)	
Ramelius Resources Ltd.	(448)	(646)	(346)	
Red 5 Ltd.	(1 675)	(433)	(371)	
Rio Tinto PLC	(16)	(1 262)	(1 259)	
Sasol Ltd.	(21)	(603)	(625)	
Showa Denko KK	(300)	(9 057)	(6 569)	
Sibanye Stillwater Ltd.	(1 378)	(19 645)	(17 722)	
Sinopec Shanghai Petrochemical Co., Ltd., CAAE	(175)	(5 148)	(3 820)	
SSAB AB, série B	(420)	(2 953)	(2 237)	
Sumitomo Chemical Co., Ltd.	(100)	(633)	(504)	
Sunrise Energy Metals Ltd.	(480)	(1 380)	(958)	
Syrah Resources Ltd.	(690)	(845)	(756)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Takemoto Yohki Co., Ltd.	(100)	(1 106)	(748)	
Tata Steel Bsl Ltd.	(14)	(354)	(196)	
Vulcan Energy Resources Ltd.	(315)	(1 521)	(1 514)	
W-Scope Corp.	(100)	(1 052)	(2 156)	
Zignago Vetro SpA	(100)	(2 310)	(1 567)	
		(452 397)	(350 616)	(1,89)
Industries (31 décembre 2021 : -2,04 %)				
Adecco Group AG	(1)	(73)	(44)	
AerCap Holdings NV	(1 263)	(82 179)	(66 696)	
Air New Zealand Ltd.	(791)	(653)	(362)	
Aker Carbon Capture ASA	(12)	(8)	(26)	
Alinco Inc.	(100)	(844)	(813)	
Amada Co., Ltd.	(100)	(1 102)	(947)	
AP Moller - Maersk A/S	(2)	(6 308)	(6 004)	
Atlantia SpA	(2 212)	(60 150)	(66 761)	
Atlas Corp.	(151)	(2 273)	(2 086)	
Auckland International Airport Ltd.	(723)	(4 612)	(4 163)	
Benefit One Inc.	(200)	(6 064)	(3 464)	
Bilfinger SE	(36)	(1 532)	(1 354)	
bpost SA	(149)	(1 301)	(1 132)	
Brambles Ltd.	(25)	(230)	(238)	
CIR SpA-Compagnie Industriali	(2 696)	(1 769)	(1 465)	
Cleanaway Waste Management Ltd.	(610)	(1 707)	(1 364)	
Controladora Vuela Cia de Aviacion SAB de CV, NYSE	(613)	(11 814)	(8 121)	
Copa Holdings SA	(19)	(1 532)	(1 553)	
DMG Mori Co., Ltd.	(100)	(1 727)	(1 595)	
dormakaba Holding AG	(2)	(1 217)	(1 122)	
DSV A/S	(16)	(2 954)	(2 876)	
Electro Optic Systems Holdings Ltd.	(520)	(2 581)	(480)	
Enav SpA	(484)	(2 672)	(2 602)	
Endur ASA	(76)	(361)	(242)	
Eolus Vind AB	(15)	(368)	(146)	
EXEO Group Inc.	(100)	(2 694)	(2 016)	
Fletcher Building Ltd.	(116)	(628)	(469)	
Freightways Ltd.	(156)	(1 672)	(1 145)	
Fujikura Ltd.	(1 800)	(14 004)	(13 143)	
Grafton Group PLC	(22)	(444)	(268)	
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV, CAAE	(9)	(2 359)	(2 280)	
Hexagon Composites ASA	(157)	(582)	(552)	
Hitachi Construction Machinery Co., Ltd.	(200)	(6 885)	(5 707)	
Hitachi Zosen Corp.	(200)	(2 051)	(1 622)	
Huhtamaki OYJ	(127)	(5 932)	(6 474)	
Ilika PLC	(380)	(357)	(354)	
Instalco AB	(40)	(347)	(213)	
Intertrust NV	(200)	(5 453)	(5 162)	
Japan Foundation Engineering Co., Ltd.	(100)	(652)	(565)	
JET2 PLC	(265)	(5 393)	(3 760)	
Kelsian Group Ltd.	(56)	(351)	(283)	
KION Group AG	(10)	(719)	(534)	
Kloeckner & Co SE	(59)	(895)	(578)	
Komax Holding AG	(8)	(2 726)	(2 522)	
Kuehne + Nagel International AG	(7)	(2 694)	(2 132)	
Link And Motivation Inc.	(300)	(1 630)	(1 359)	
Loomis AB	(8)	(290)	(251)	
Luckland Co., Ltd.	(100)	(2 998)	(2 830)	
Mainfreight Ltd.	(8)	(564)	(448)	
Maire Tecnimont SpA	(542)	(2 188)	(2 003)	
Makita Corp.	(200)	(8 190)	(6 422)	
Matching Service Japan Co., Ltd.	(100)	(805)	(843)	
Midac Holdings Co., Ltd.	(100)	(4 767)	(2 652)	
MTU Aero Engines AG	(4)	(1 047)	(937)	
Nakabayashi Co., Ltd.	(100)	(711)	(473)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
NCC AB	(17)	(377)	(220)	
NEL ASA	(7 997)	(17 949)	(12 493)	
NHOA	(42)	(872)	(555)	
Nikkiso Co., Ltd.	(200)	(2 247)	(1 521)	
Nippon Thompson Co., Ltd.	(100)	(689)	(490)	
Nippon Yusen KK	(400)	(46 230)	(35 208)	
Nisshinbo Holdings Inc.	(100)	(1 086)	(969)	
NSK Ltd.	(1 200)	(10 448)	(8 318)	
NTN Corp.	(600)	(1 732)	(1 476)	
Oesterreichische Post AG	(8)	(380)	(293)	
OHB SE	(89)	(4 489)	(4 165)	
Okamura Corp.	(200)	(4 014)	(2 302)	
Peab AB	(24)	(368)	(181)	
PeopleIN Ltd.	(121)	(357)	(310)	
PNE AG	(918)	(10 858)	(16 441)	
Powerhouse Energy Group PLC	(5 367)	(359)	(137)	
Prosegur Cia de Seguridad SA	(50)	(292)	(114)	
Raiznext Corp.	(100)	(1 254)	(1 086)	
Reece Ltd.	(272)	(4 730)	(3 325)	
Reliance Worldwide Corp. Ltd.	(6 163)	(25 422)	(22 086)	
Ryanair Holdings PLC	(13)	(1 221)	(1 128)	
SATS Ltd.	(300)	(1 117)	(1 084)	
Shapir Engineering and Industry Ltd.	(89)	(840)	(934)	
Sotetsu Holdings Inc.	(100)	(2 431)	(2 229)	
Stabilus SE	(5)	(465)	(315)	
Talenom Oyj	(65)	(993)	(850)	
Textainer Group Holdings Ltd.	(302)	(13 145)	(10 678)	
THK Co., Ltd.	(100)	(3 233)	(2 418)	
Traton SE	(17)	(392)	(320)	
Tsugami Corp.	(200)	(4 563)	(2 142)	
UT Group Co., Ltd.	(200)	(8 545)	(4 244)	
Vestas Wind Systems A/S	(158)	(5 484)	(4 295)	
Vow ASA	(73)	(344)	(217)	
Yamashina Corp.	(400)	(327)	(262)	
Yamato Holdings Co., Ltd.	(100)	(2 400)	(2 060)	
		(455 712)	(388 519)	(2,10)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -2,93 %)				
AB Dynamics PLC	(11)	(347)	(200)	
Aisin Corp.	(100)	(4 465)	(3 988)	
ARB Corp. Ltd.	(35)	(1 365)	(877)	
ASKUL Corp.	(200)	(3 564)	(3 073)	
Autoneum Holding AG	(2)	(321)	(244)	
Avantia Co., Ltd.	(100)	(936)	(791)	
Azorim-Investment Development & Construction Co., Ltd.	(181)	(856)	(874)	
Baby Bunting Group Ltd.	(98)	(430)	(355)	
Bapcor Ltd.	(1 072)	(6 811)	(5 781)	
Bayerische Motoren Werke AG	(5)	(511)	(495)	
Benesse Holdings Inc.	(300)	(8 187)	(6 258)	
Betsson AB	(154)	(1 032)	(1 199)	
Betsson AB, actions visées par un rachat	(154)	-	(38)	
BHG Group AB	(432)	(6 384)	(1 763)	
Bic Camera Inc.	(300)	(3 433)	(3 338)	
Boozt AB	(16)	(376)	(136)	
Brembo SpA	(144)	(1 921)	(1 800)	
Breville Group Ltd.	(20)	(489)	(319)	
Brunello Cucinelli SpA	(6)	(362)	(348)	
CHIMNEY Co., Ltd.	(100)	(1 505)	(1 189)	
Cie Financière Richemont SA	(1)	(143)	(137)	
Collins Foods Ltd.	(145)	(1 636)	(1 275)	
Corporate Travel Management Ltd.	(18)	(345)	(296)	
Create Restaurants Holdings Inc.	(200)	(1 461)	(1 774)	
DCM Holdings Co., Ltd.	(200)	(2 335)	(1 971)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
DD Holdings Co., Ltd.	(300)	(1 657)	(1 721)	
De' Longhi SpA	(9)	(396)	(215)	
Demae-Can Co., Ltd.	(300)	(5 850)	(1 225)	
Despegar.com Corp.	(808)	(12 010)	(8 443)	
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	(44)	(3 406)	(2 654)	
Dufry AG	(343)	(21 641)	(14 262)	
Eagers Automotive Ltd.	(808)	(9 873)	(6 967)	
EDION Corp.	(400)	(4 876)	(4 835)	
ES-Con Japan Ltd.	(1 000)	(8 447)	(7 264)	
Europris ASA	(37)	(366)	(222)	
Fielmann AG	(28)	(1 945)	(1 794)	
Fiverr International Ltd.	(125)	(27 390)	(5 545)	
Food & Life Cos Ltd.	(400)	(21 777)	(10 999)	
Furukawa Battery Co., Ltd.	(400)	(6 033)	(4 622)	
Gfoot Co., Ltd.	(100)	(448)	(325)	
GUD Holdings Ltd.	(282)	(3 088)	(1 999)	
Harvey Norman Holdings Ltd.	(75)	(367)	(247)	
Haseko Corp.	(100)	(1 562)	(1 509)	
Hella GmbH & Co KGaA	(29)	(2 542)	(2 517)	
Home24 SE	(22)	(372)	(107)	
Hoosiers Holdings Co., Ltd.	(100)	(818)	(762)	
Hoteles City Express SAB de CV	(3 980)	(1 371)	(1 028)	
Iida Group Holdings Co., Ltd.	(400)	(12 279)	(7 934)	
Isuzu Motors Ltd.	(100)	(1 692)	(1 425)	
Iveco Group NV	(18)	(291)	(122)	
JM AB	(114)	(5 420)	(2 430)	
JTEKT Corp.	(300)	(3 411)	(2 906)	
Just Eat Takeaway.com NV	(57)	(4 871)	(1 158)	
KeyHolder Inc.	(100)	(670)	(636)	
Kindred Group PLC	(168)	(1 964)	(1 799)	
KMD Brands Ltd.	(840)	(955)	(741)	
Kogan.com Ltd.	(260)	(2 634)	(641)	
Konaka Co., Ltd.	(100)	(408)	(316)	
Kongsberg Automotive ASA	(4 978)	(1 827)	(1 550)	
Kourakuen Holdings Corp.	(100)	(1 642)	(1 234)	
K's Holdings Corp.	(400)	(5 190)	(5 021)	
Landi Renzo SpA	(377)	(436)	(375)	
Lovisa Holdings Ltd.	(36)	(575)	(441)	
Marui Group Co., Ltd.	(100)	(2 467)	(2 255)	
Maytronics Ltd.	(126)	(3 294)	(2 281)	
Melco Resorts & Entertainment Ltd.	(1 017)	(7 502)	(7 543)	
Mercari Inc.	(100)	(7 291)	(1 852)	
Minor International PCL, bons de souscription éch. le 31 juill. 2023	(45)	-	(20)	
Mitsubishi Motors Corp.	(600)	(2 655)	(2 615)	
Miyakoshi Holdings Inc.	(100)	(833)	(892)	
Musti Group Oyj	(51)	(1 641)	(1 172)	
Nick Scali Ltd.	(355)	(3 002)	(2 601)	
Nishimatsuya Chain Co., Ltd.	(200)	(2 981)	(2 714)	
Nokian Renkaat OYJ	(517)	(10 760)	(7 272)	
Open House Group Co., Ltd.	(200)	(11 095)	(10 255)	
Panasonic Holdings Corp.	(100)	(1 534)	(1 041)	
Puma SE	(9)	(801)	(763)	
Resorttrust Inc.	(200)	(4 073)	(4 216)	
Restaurant Group PLC	(1)	(2)	(1)	
Riso Kyoiku Co., Ltd.	(500)	(2 053)	(1 514)	
Sharp Corp.	(1 200)	(22 587)	(11 952)	
Shimajima Co., Ltd.	(100)	(1 257)	(912)	
SKYCITY Entertainment Group Ltd.	(145)	(381)	(338)	
Small and medium sized Enterprises Holdings Inc.	(800)	(361)	(281)	
Sumitomo Electric Industries Ltd.	(200)	(2 863)	(2 847)	
Sumitomo Rubber Industries Ltd.	(400)	(5 198)	(4 402)	
Syuppin Co., Ltd.	(100)	(1 455)	(1 379)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Tata Motors Ltd.	(14)	(447)	(467)	
TCM Group A/S	(14)	(373)	(186)	
Technogym SpA	(34)	(372)	(285)	
Tokmanni Group Corp.	(175)	(4 258)	(2 650)	
Tokyo Individualized Educational Institute Inc.	(100)	(582)	(592)	
Toridoll Holdings Corp.	(400)	(9 929)	(8 758)	
Toyota Boshoku Corp.	(100)	(2 278)	(1 913)	
Uxin Ltd.	(1 995)	(3 972)	(1 081)	
Verkkokauppa.com Oyj	(100)	(578)	(548)	
Wesfarmers Ltd.	(6)	(335)	(223)	
Yoshinoya Holdings Co., Ltd.	(100)	(2 334)	(2 368)	
Zensho Holdings Co., Ltd.	(400)	(11 787)	(12 382)	
ZOZO Inc.	(100)	(4 098)	(2 322)	
		(367 144)	(251 403)	(1,36)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -1,52 %)				
111 Inc.	(1 578)	(6 393)	(4 193)	
Agrana Beteiligungs AG	(25)	(657)	(573)	
Atlantic Sapphire ASA	(156)	(2 123)	(392)	
Bakkafrost P/F	(99)	(8 324)	(8 143)	
BrasilAgro - Co Brasileira de Propriedades Agricolas	(249)	(2 127)	(1 522)	
Cia Brasileira de Distribuicao	(63)	(339)	(252)	
Coca-Cola Europacific Partners PLC	(531)	(32 268)	(35 351)	
Ebro Foods SA	(42)	(934)	(912)	
ForFarmers NV	(77)	(375)	(276)	
Fuji Oil Holdings Inc.	(100)	(2 476)	(2 034)	
GrainCorp Ltd.	(153)	(1 235)	(1 291)	
Italian Wine Brands SpA	(100)	(3 746)	(3 587)	
Ito En Ltd.	(100)	(7 556)	(5 773)	
Kagome Co., Ltd.	(100)	(3 204)	(3 143)	
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	(200)	(410)	(348)	
Kobe Bussan Co., Ltd.	(600)	(25 341)	(18 943)	
MARR SpA	(32)	(658)	(568)	
MatsukiyoCocokara & Co.	(300)	(13 856)	(15 638)	
Nichirei Corp.	(200)	(5 351)	(4 480)	
Nippon Suisan Kaisha Ltd.	(500)	(3 093)	(2 720)	
Norway Royal Salmon ASA	(64)	(1 657)	(2 097)	
Rohto Pharmaceutical Co., Ltd.	(100)	(3 695)	(3 722)	
Royal Unibrew A/S	(17)	(2 014)	(1 937)	
Sanford Ltd.	(528)	(2 123)	(1 740)	
Schouw & Co A/S	(74)	(7 850)	(6 636)	
Select Harvests Ltd.	(69)	(429)	(288)	
Suominen OYJ	(100)	(376)	(403)	
Synlait Milk Ltd.	(136)	(362)	(340)	
Treasury Wine Estates Ltd.	(52)	(585)	(524)	
Unilever PLC	(601)	(35 403)	(35 530)	
Welcia Holdings Co., Ltd.	(500)	(16 253)	(12 913)	
Woolworths Group Ltd.	(42)	(1 396)	(1 326)	
YA-MAN Ltd.	(100)	(1 441)	(1 641)	
Yamazaki Baking Co., Ltd.	(100)	(1 534)	(1 573)	
Zur Rose Group AG	(44)	(9 411)	(4 248)	
		(204 995)	(185 057)	(1,00)
Soins de santé (31 décembre 2021 : -2,03 %)				
3-D Matrix Ltd.	(200)	(795)	(591)	
Addlife AB	(13)	(389)	(251)	
Alcon Inc., NYSE	(13)	(1 234)	(1 172)	
Amvis Holdings Inc.	(100)	(5 081)	(3 589)	
Atrys Health SA	(183)	(2 656)	(1 619)	
Basilea Pharmaceutica AG	(12)	(761)	(624)	
Bavarian Nordic A/S	(287)	(9 219)	(12 173)	
Bergenbio ASA	(399)	(1 119)	(585)	
BICO Group AB	(644)	(24 613)	(7 192)	
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	(100)	(3 991)	(3 295)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Clinuvel Pharmaceuticals Ltd.	(262)	(8 902)	(3 451)	
Coloplast A/S	(123)	(21 887)	(18 032)	
Compugen Ltd.	(285)	(1 205)	(680)	
CompuGroup Medical SE & Co KGaA	(17)	(1 105)	(932)	
DiaSorin SPA	(107)	(18 459)	(18 066)	
Eurofins Scientific SE	(9)	(1 215)	(911)	
FINDEX Inc.	(100)	(1 032)	(619)	
Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.	(46)	(935)	(737)	
Formycon AG	(19)	(1 313)	(1 960)	
Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, CAAE	(23)	(982)	(740)	
GenSight Biologics SA	(122)	(352)	(368)	
GN Store Nord AS	(29)	(1 323)	(1 308)	
H Lundbeck A/S, cat. B	(60)	(446)	(375)	
Healius Ltd.	(268)	(1 189)	(872)	
Idorsia Ltd.	(13)	(370)	(239)	
Imugene Ltd.	(1 003)	(461)	(160)	
Inmode Ltd.	(251)	(9 643)	(7 256)	
Japan Hospice Holdings Inc.	(100)	(2 123)	(1 302)	
JCR Pharmaceuticals Co., Ltd.	(100)	(3 349)	(2 198)	
JMDC Inc.	(200)	(12 945)	(11 223)	
JMS Co., Ltd.	(100)	(999)	(528)	
Karo Pharma AB (KARO BTA)	(608)	(4 191)	(4 470)	
Karo Pharma AB (KARO)	(2 839)	(23 017)	(17 940)	
Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA	(4)	(353)	(315)	
M3 Inc.	(600)	(39 639)	(22 207)	
Medacta Group SA	(2)	(358)	(246)	
Merus NV	(76)	(2 631)	(2 220)	
Molecular Partners AG	(114)	(2 464)	(1 012)	
Morphosys AG	(93)	(3 011)	(2 355)	
Nicox	(353)	(877)	(818)	
Nipro Corp.	(500)	(6 546)	(5 066)	
Olympus Corp.	(1 000)	(22 675)	(25 888)	
Ono Pharmaceutical Co., Ltd.	(200)	(6 285)	(6 612)	
Open Orphan PLC	(1 549)	(357)	(285)	
Orion OYJ	(168)	(9 781)	(9 652)	
Pharma Foods International Co., Ltd.	(200)	(6 554)	(2 676)	
PolyNovo Ltd.	(812)	(2 171)	(976)	
Precision System Science Co., Ltd.	(400)	(3 368)	(1 975)	
Raffles Medical Group Ltd.	(1 213)	(1 078)	(1 259)	
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	(88)	(4 773)	(4 926)	
Sartorius AG	(3)	(1 433)	(1 349)	
Scancell Holdings PLC	(1 620)	(381)	(327)	
Summerset Group Holdings Ltd.	(30)	(332)	(231)	
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	(800)	(29 016)	(29 002)	
Terumo Corp.	(200)	(7 683)	(7 763)	
Teva Pharmaceutical Industries Ltd.	(3 533)	(39 399)	(34 272)	
Theravance Biopharma Inc.	(32)	(349)	(374)	
Tsumura & Co.	(100)	(4 006)	(2 891)	
		(362 821)	(290 155)	(1,57)
Services financiers (31 décembre 2021 : -1,55 %)				
Aegon NV, NYSE	(707)	(2 634)	(3 995)	
Ageas SA	(9)	(624)	(510)	
Aiful Corp.	(1 200)	(4 155)	(3 988)	
Akatsuki Corp.	(300)	(968)	(926)	
Alm Brand A/S	(360)	(705)	(680)	
AMP Ltd.	(12 205)	(14 847)	(10 339)	
Anima Holding SpA	(500)	(3 195)	(2 359)	
Axactor ASA	(291)	(348)	(226)	
Azimut Holding SpA	(13)	(362)	(291)	
Banca Popolare di Sondrio SPA	(219)	(937)	(970)	
Banco Macro SA	(202)	(3 527)	(2 918)	
Banco Santander Chile, NYSE	(737)	(17 641)	(15 487)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Banco Santander SA, CAAE	(95)	(347)	(343)	
Bank Hapoalim BM	(840)	(9 860)	(9 022)	
CA Immobilien Anlagen AG	(7)	(365)	(286)	
Challenger Ltd.	(861)	(4 882)	(5 224)	
Clal Insurance Enterprises Holdings Ltd.	(33)	(767)	(755)	
CNFinance Holdings Ltd.	(28)	(92)	(92)	
Cofinimmo SA	(2)	(356)	(279)	
Credicorp Ltd.	(38)	(6 997)	(5 878)	
Credit Saison Co., Ltd.	(100)	(1 558)	(1 480)	
Danske Bank A/S	(1 596)	(36 215)	(29 029)	
Fanhua Inc.	(125)	(2 323)	(834)	
Flow Traders	(250)	(10 847)	(9 211)	
GAM Holding AG	(1 744)	(3 830)	(1 856)	
Grupo Financiero Galicia SA	(722)	(8 410)	(6 436)	
Grupo Financiero Inbursa SAB de CV	(20)	(31)	(41)	
Grupo Supervielle SA	(148)	(379)	(260)	
Harel Insurance Investments & Financial Services Ltd.	(170)	(2 222)	(2 130)	
HDFC Bank Ltd.	(123)	(9 838)	(8 720)	
Hirogin Holdings Inc.	(100)	(672)	(600)	
HSBC Holdings PLC	(1 501)	(60 928)	(63 256)	
Illimity Bank SpA	(137)	(2 288)	(1 921)	
Immobil SA	(83)	(8 723)	(6 750)	
Insignia Financial Ltd.	(128)	(404)	(305)	
Itau CorpBanca Chile SA	(164)	(981)	(599)	
Japan Post Insurance Co., Ltd.	(100)	(2 318)	(2 061)	
Jyske Bank A/S	(153)	(10 370)	(9 614)	
Lloyds Banking Group PLC	(1 161)	(860)	(770)	
Lloyds Banking Group PLC, CAAE	(117)	(363)	(308)	
Lundin Energy MergerCo AB	(105)	-	(5 248)	
Migdal Insurance & Financial Holdings Ltd.	(710)	(1 011)	(1 356)	
Mitsubishi HC Capital Inc.	(200)	(1 179)	(1 189)	
MyState Ltd.	(299)	(1 077)	(1 082)	
Natwest Group PLC	(50)	(380)	(352)	
Netwealth Group Ltd.	(293)	(3 878)	(3 160)	
Nextensa SA	(106)	(9 418)	(7 448)	
ORIX Corp.	(500)	(11 502)	(10 805)	
Procrea Holdings Inc.	(100)	(2 050)	(1 847)	
Protector Forsikring ASA	(31)	(503)	(414)	
Ringkjoebing Landbobank A/S	(3)	(420)	(421)	
Shinhan Financial Group Co., Ltd.	(15)	(628)	(553)	
Shinsei Bank Ltd.	(100)	(2 418)	(1 942)	
SiriusPoint Ltd.	(512)	(4 804)	(3 580)	
Sparebank 1 SMN	(24)	(496)	(363)	
SpareBank 1 SR-Bank ASA	(590)	(11 670)	(8 220)	
Sparx Group Co., Ltd.	(800)	(2 054)	(2 013)	
St Galler Kantonalbank AG	(2)	(1 190)	(1 183)	
State Bank of India	(93)	(4 654)	(6 984)	
Storebrand ASA	(1 957)	(25 801)	(17 912)	
Suruga Bank Ltd.	(100)	(461)	(348)	
Tokai Tokyo Financial Holdings Inc.	(200)	(868)	(703)	
Topdanmark AS	(28)	(1 999)	(1 876)	
Zip Co., Ltd.	(362)	(3 410)	(141)	
Zurich Insurance Group AG	(1)	(534)	(559)	
		(329 574)	(290 448)	(1,57)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -1,52 %)				
Alpha & Omega Semiconductor Ltd.	(7)	(562)	(301)	
Amper SA	(1 021)	(350)	(279)	
ams-OSRAM AG	(19)	(459)	(220)	
Appen Ltd.	(384)	(3 263)	(1 911)	
ASM International NV	(44)	(15 082)	(14 158)	
Atlassian Corp. PLC	(1)	(495)	(242)	
AudioCodes Ltd.	(100)	(2 844)	(2 804)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Barco NV	(11)	(372)	(299)	
Bravura Solutions Ltd.	(124)	(347)	(156)	
CAICA DIGITAL Inc.	(490)	(1 345)	(703)	
Canon Inc., CAAE	(100)	(2 941)	(2 929)	
Codan Ltd.	(486)	(3 430)	(3 000)	
Cognyte Software Ltd.	(70)	(2 509)	(384)	
Crayon Group Holding ASA	(103)	(2 140)	(1 684)	
Feedforce Group Inc.	(100)	(441)	(380)	
Fortnox AB	(47)	(342)	(278)	
Freee KK	(400)	(22 693)	(12 458)	
GMO internet Inc.	(300)	(10 034)	(6 626)	
Hibino Corp.	(100)	(1 387)	(1 363)	
Hilan Ltd.	(7)	(567)	(474)	
Ituran Location and Control Ltd.	(100)	(2 516)	(3 159)	
Japan Cash Machine Co., Ltd.	(100)	(667)	(633)	
Kapsch TrafficCom AG	(21)	(421)	(357)	
Konica Minolta Inc.	(1 100)	(6 011)	(4 731)	
Matrix IT Ltd.	(221)	(6 462)	(6 591)	
Meyer Burger Technology AG	(15 718)	(8 789)	(8 569)	
Netcompany Group A/S	(219)	(16 779)	(15 401)	
Neurones	(100)	(4 888)	(4 801)	
Nexi SpA	(4 063)	(64 392)	(43 308)	
Nice Ltd., CAAE	(83)	(26 489)	(20 605)	
Optim Corp.	(100)	(2 190)	(710)	
Pexip Holding ASA	(298)	(1 548)	(528)	
Pricer AB	(473)	(1 291)	(917)	
Pushpay Holdings Ltd.	(266)	(348)	(271)	
PVA TePla AG	(10)	(346)	(247)	
Rakus Co., Ltd.	(500)	(18 839)	(7 591)	
SAES Getters SpA	(17)	(507)	(486)	
Sansan Inc.	(200)	(2 392)	(1 747)	
Sapiens International Corp. NV, NASD	(11)	(362)	(343)	
Secunet Security Networks AG	(1)	(821)	(381)	
SimCorp A/S	(234)	(27 695)	(21 862)	
Sinch AB	(3 118)	(47 956)	(13 068)	
Smart Eye AB	(38)	(1 028)	(290)	
Softwareone Holding AG	(98)	(1 618)	(1 511)	
Tamura Corp.	(200)	(1 362)	(1 073)	
TietoEVERY Oyj	(583)	(21 266)	(18 523)	
Traffic Systems SE	(100)	(6 838)	(2 987)	
Wallix Group	(100)	(2 108)	(1 937)	
WILLs Inc.	(100)	(595)	(547)	
Wipro Ltd.	(19)	(174)	(130)	
Xero Ltd.	(2)	(183)	(137)	
		(348 484)	(234 090)	(1,26)
Services de communication (31 décembre 2021 : -1,71 %)				
Adevinta ASA	(1 886)	(22 692)	(17 520)	
Ateam Inc.	(100)	(709)	(694)	
Bambuser AB	(287)	(381)	(141)	
Chorus Ltd.	(1 941)	(11 340)	(11 240)	
COLOPL Inc.	(200)	(1 596)	(1 244)	
Dena Co., Ltd.	(600)	(13 289)	(10 762)	
Domain Holdings Australia Ltd.	(263)	(1 047)	(702)	
Elisa OYJ	(18)	(1 357)	(1 302)	
Eros Media World PLC	(152)	(7 743)	(471)	
FAN Communications Inc.	(100)	(421)	(366)	
giftee Inc.	(200)	(7 536)	(2 254)	
Gree Inc.	(200)	(2 154)	(1 565)	
Grupo Televisa SAB	(2 348)	(29 484)	(24 776)	
Infrastrutture Wireless Italiane SpA	(579)	(7 323)	(7 562)	
Japan Communications Inc.	(400)	(911)	(763)	
Kadokawa Corp.	(200)	(7 200)	(5 551)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kahoot! ASA	(1 811)	(9 284)	(4 238)	
Kakaku.com Inc.	(200)	(5 913)	(4 250)	
KDDI Corp.	(100)	(4 234)	(4 072)	
KLab Inc.	(100)	(698)	(569)	
Koei Tecmo Holdings Co., Ltd.	(200)	(10 666)	(8 318)	
MFE-MediaForEurope NV	(308)	(369)	(279)	
Mobile TeleSystems PJSC	(911)	(8 419)	-	
Modern Times Group MTG AB	(119)	(1 264)	(1 231)	
Modern Times Group MTG AB, droits	(119)	(376)	(375)	
NOS SGPS SA	(659)	(3 343)	(3 409)	
Orange SA	(2 730)	(37 318)	(41 449)	
ProSiebenSat.1 Media SE	(26)	(392)	(309)	
RPA Holdings Inc.	(800)	(3 137)	(2 514)	
RTL Group SA	(6)	(419)	(322)	
Seek Ltd.	(643)	(18 427)	(11 978)	
Septeni Holdings Co., Ltd.	(400)	(2 266)	(1 986)	
Sky Network Television Ltd.	(214)	(685)	(405)	
Softbank Corp.	(1 600)	(23 793)	(22 887)	
Southern Cross Media Group Ltd.	(221)	(357)	(195)	
Spark New Zealand Ltd.	(831)	(3 351)	(3 199)	
SpeedCast International Ltd.	(4 877)	(11 289)	-	
Stillfront Group AB	(592)	(2 343)	(1 682)	
Storytel AB	(301)	(8 373)	(1 852)	
TBS Holdings Inc.	(100)	(1 656)	(1 613)	
Tele2 AB	(1 091)	(19 438)	(16 000)	
Telecom Argentina SA	(384)	(2 490)	(2 254)	
Telefonica SA	(2 933)	(17 519)	(19 409)	
Telenor ASA	(874)	(15 736)	(14 949)	
Vodafone Group PLC	(1 151)	(24 224)	(23 132)	
XLMedia PLC	(755)	(354)	(352)	
Z Holdings Corp.	(9 900)	(61 143)	(37 262)	
		(414 459)	(317 403)	(1,71)
Services publics (31 décembre 2021 : -0,32 %)				
Audax Renovables SA	(192)	(372)	(294)	
Central Puerto SA	(776)	(2 578)	(3 073)	
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	(38)	(439)	(392)	
Elmera Group ASA	(125)	(363)	(326)	
Enel Americas SA	(2 647)	(18 076)	(15 536)	
Enel Chile SA	(134)	(363)	(192)	
Enel SpA	(2 315)	(18 012)	(16 297)	
Enlight Renewable Energy Ltd.	(827)	(2 014)	(2 019)	
Genesis Energy Ltd.	(390)	(876)	(829)	
Grenergy Renovables SA	(9)	(377)	(411)	
Hera SpA	(494)	(2 399)	(1 839)	
Hokkaido Electric Power Co Inc.	(300)	(1 562)	(1 410)	
Kyushu Electric Power Co Inc.	(300)	(2 725)	(2 484)	
Meridian Energy Ltd.	(196)	(860)	(736)	
Naturgy Energy Group SA	(23)	(769)	(852)	
Nippon Gas Co., Ltd.	(100)	(1 855)	(1 827)	
Orsted AS	(137)	(20 420)	(18 432)	
Scatec ASA	(407)	(7 792)	(4 499)	
Shikiku Electric Power Co Inc.	(200)	(1 720)	(1 502)	
Terna - Rete Elettrica Nazionale	(327)	(3 424)	(3 302)	
		(86 996)	(76 252)	(0,41)
Immobilier (31 décembre 2021 : -0,34 %)				
AFI Properties Ltd.	(11)	(392)	(681)	
Alony Hetz Properties & Investments Ltd.	(23)	(438)	(371)	
Altisource Portfolio Solutions SA	(29)	(473)	(402)	
Amot Investments Ltd.	(74)	(737)	(572)	
Argosy Property Ltd.	(1 754)	(2 141)	(1 737)	
Ascendas REIT	(1 900)	(5 028)	(5 019)	
Atenor	(116)	(9 958)	(8 072)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Big Shopping Centers Ltd.	(97)	(19 824)	(15 360)	
CapitaLand China Trust	(317)	(372)	(338)	
CapitaLand Integrated Commercial Trust	(199)	(371)	(400)	
Care Property Invest NV	(121)	(4 499)	(3 892)	
CBo Territoria	(282)	(1 463)	(1 377)	
Charter Hall Group	(648)	(6 970)	(6 225)	
Charter Hall Long Wale REIT	(206)	(952)	(780)	
Cromwell Property Group	(687)	(560)	(460)	
Daiwa Securities Living Investments Corp.	(2)	(2 430)	(2 260)	
Deutsche Wohnen SE	(113)	(6 022)	(3 343)	
Dexus	(270)	(2 665)	(2 127)	
Empiric Student Property PLC	(2 509)	(3 657)	(3 380)	
ESR-LOGOS REIT	(10 562)	(4 319)	(3 965)	
Frasers Centrepoint Trust	(600)	(1 303)	(1 274)	
Goodman Group	(1 167)	(23 706)	(18 467)	
Hamborner REIT AG	(25)	(359)	(288)	
Hongkong Land Holdings Ltd.	(500)	(3 002)	(3 238)	
Hufvudstaden AB	(260)	(4 318)	(3 698)	
Hulic Co., Ltd.	(100)	(1 073)	(997)	
Ichigo Inc.	(400)	(1 474)	(1 189)	
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp.	(2)	(3 801)	(3 409)	
Ingenia Communities Group	(266)	(1 146)	(939)	
IRSA Inversiones y Representaciones SA	(236)	(1 185)	(1 096)	
IRSA Inversiones y Representaciones SA, droits, éch. le 5 mars 2026	(290)	-	(74)	
Kenedix Residential Next Investment Corp.	(1)	(2 155)	(2 066)	
Keppel DC REIT	(500)	(1 134)	(913)	
Lippo Malls Indonesia Retail Trust	(10 700)	(1 204)	(506)	
Mapletree North Asia Commercial Trust	(1 329)	(1 041)	(1 478)	
Mirvac Group	(656)	(1 398)	(1 149)	
Mivne Real Estate KD Ltd.	(214)	(1 033)	(801)	
Mobimo Holding AG	(1)	(345)	(313)	
NAM TAI Property Inc.	(86)	(705)	(468)	
OUE Commercial REIT	(1 200)	(415)	(428)	
Sekisui House Reit Inc.	(1)	(844)	(763)	
SOSiLA Logistics REIT Inc.	(1)	(1 731)	(1 375)	
Star Asia Investment Corp.	(2)	(1 300)	(1 166)	
Stockland	(415)	(1 445)	(1 329)	
Stride Property Group	(203)	(357)	(270)	
Takara Leben Real Estate Investment Corp.	(1)	(1 265)	(1 114)	
Tokyu Fudosan Holdings Corp.	(100)	(684)	(678)	
VIB Vermoegen AG	(100)	(3 889)	(3 237)	
Vonovia SE	(1)	(49)	(40)	
		<u>(135 632)</u>	<u>(113 524)</u>	(0,61)
Total des actions étrangères – position vendeur		<u>(3 315 034)</u>	<u>(2 635 118)</u>	(14,22)
Commissions de courtage intégrées (note 3)		<u>(6 127)</u>		
Total des placements		<u>16 846 943</u>	<u>17 545 276</u>	<u>94,69</u>
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			9 632	0,05
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			(15 245)	(0,08)
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			741 875	4,00
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			(694 985)	(3,75)
Autres actifs, moins les passifs			<u>942 820</u>	<u>5,09</u>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			<u>18 529 373</u>	<u>100,00</u>

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Contrepartie*	Code de devise	Montant vendu	Code de devise	Montant acheté	Date d'échéance	Plus-value (moins-value) latente \$
Banque Royale du Canada	CAD	(278 000)	USD	219 926	21 sept. 2022	5 626
Banque Royale du Canada	NOK	(920 000)	USD	96 421	21 sept. 2022	4 006
						9 632
Banque Royale du Canada	CAD	(42 000)	USD	51 078	21 sept. 2022	(16)
Banque Royale du Canada	HKD	(1 038 000)	USD	132 565	21 sept. 2022	(41)
Banque Royale du Canada	USD	(246 560)	AUD	346 000	21 sept. 2022	(10 863)
Banque Royale du Canada	USD	(67 489)	EUR	63 000	21 sept. 2022	(1 566)
Banque Royale du Canada	USD	(195 960)	JPY	26 178 000	21 sept. 2022	(2 694)
Banque Royale du Canada	USD	(59 416)	ZAR	981 000	21 sept. 2022	(65)
						(15 245)
						(5 613)

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

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

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; Credit Suisse First Boston Corporation, non notée				
Swaps d'actions – position acheteur				
Dollar australien – taux de swap des acceptations bancaires (BBSW) à 1 mois				
2 916	29 juill. 2022	Agl Energy Ltd, swap sur rendement total	21 339	(1 137)
455	29 juill. 2022	Ainsworth Game Technology Lt, swap sur rendement total	387	(49)
237	29 juill. 2022	Ampol Ltd, swap sur rendement total	7 196	(29)
1 999	29 juill. 2022	Apa Group, swap sur rendement total	20 480	281
3 225	29 juill. 2022	Ardent Leisure Group Ltd, swap sur rendement total	4 005	140
241	29 juill. 2022	Arena Reit, swap sur rendement total	921	(7)
1 633	29 juill. 2022	Aristocrat Leisure Ltd, swap sur rendement total	50 338	606
84	29 juill. 2022	Asx Ltd, swap sur rendement total	6 088	153
2 203	29 juill. 2022	Atlas Arteria, swap sur rendement total	15 750	853
82	29 juill. 2022	Aub Group Ltd, swap sur rendement total	1 286	(19)
109	29 juill. 2022	Aurizon Holdings Ltd, swap sur rendement total	367	(21)
14	29 juill. 2022	Aust And Nz Banking Group, swap sur rendement total	286	15
2 164	29 juill. 2022	Base Resources Ltd, swap sur rendement total	537	(18)
159	29 juill. 2022	Bega Cheese Ltd, swap sur rendement total	539	(23)
595	29 juill. 2022	Boss Energy Ltd, swap sur rendement total	934	(123)
70	29 juill. 2022	Brickworks Ltd, swap sur rendement total	1 151	(135)
118	29 juill. 2022	Bwp Trust, swap sur rendement total	417	(3)
1 063	29 juill. 2022	Capricorn Metals Ltd, swap sur rendement total	2 951	(586)
1	29 juill. 2022	Cardno Ltd, swap sur rendement total	1	-
3 954	29 juill. 2022	Chalice Mining Ltd, swap sur rendement total	13 258	(8 841)
804	29 juill. 2022	Class Ltd, swap sur rendement total	1 783	(43)
91	29 juill. 2022	Cochlear Ltd, swap sur rendement total	16 039	(505)
1 460	29 juill. 2022	Computershare Ltd, swap sur rendement total	31 911	1 720
38	29 juill. 2022	Credit Corp Group Ltd, swap sur rendement total	684	(24)
185	29 juill. 2022	Csl Ltd, swap sur rendement total	44 153	219
44	29 juill. 2022	Elders Ltd, swap sur rendement total	491	(6)
2 989	29 juill. 2022	Elixir Energy Ltd, swap sur rendement total	358	(25)
279	29 juill. 2022	Event Hospitality And Entert, swap sur rendement total	3 230	(362)
400	29 juill. 2022	Evolution Mining Ltd, swap sur rendement total	844	(466)
18 308	29 juill. 2022	Firefinch Ltd, swap sur rendement total	3 248	(3 394)
497	29 juill. 2022	Flight Centre Travel Group L, swap sur rendement total	7 653	(868)
81	29 juill. 2022	Gpt Group, swap sur rendement total	303	3
1 874	29 juill. 2022	Grange Resources Ltd, swap sur rendement total	2 103	(633)
134	29 juill. 2022	Hastings Technology Metals L, swap sur rendement total	471	(109)
177	29 juill. 2022	Home Consortium, swap sur rendement total	708	(110)
3 098	29 juill. 2022	Horizon Oil Ltd, swap sur rendement total	371	(28)
75	29 juill. 2022	Hub24 Ltd, swap sur rendement total	1 349	26
127	29 juill. 2022	Idp Education Ltd, swap sur rendement total	2 683	124
583	29 juill. 2022	Igo Ltd, swap sur rendement total	5 140	(1 196)
667	29 juill. 2022	Iluka Resources Ltd, swap sur rendement total	5 585	(723)
675	29 juill. 2022	Infomedia Ltd, swap sur rendement total	1 000	(6)
40	29 juill. 2022	Invocare Ltd, swap sur rendement total	371	(8)
1 080	29 juill. 2022	Ive Group Ltd, swap sur rendement total	1 648	(16)
340	29 juill. 2022	Jb Hi-Fi Ltd, swap sur rendement total	11 599	(1 463)
272	29 juill. 2022	Johns Lyng Group Ltd, swap sur rendement total	1 385	17
379	29 juill. 2022	Jumbo Interactive Ltd, swap sur rendement total	4 781	(347)
1 376	29 juill. 2022	Karoon Energy Ltd, swap sur rendement total	2 124	(368)
711	29 juill. 2022	Lendlease Group, swap sur rendement total	5 746	(942)
12 921	29 juill. 2022	Liontown Resources Ltd, swap sur rendement total	12 092	(4 050)
155	29 juill. 2022	Lottery Corp Ltd The, swap sur rendement total	621	621
38	29 juill. 2022	Lynas Corp Ltd, swap sur rendement total	294	(29)
500	29 juill. 2022	Maca Ltd, swap sur rendement total	293	(43)
401	29 juill. 2022	Macquarie Group Ltd, swap sur rendement total	59 975	(5 592)
373	29 juill. 2022	Megaport Ltd, swap sur rendement total	1 803	27
83	29 juill. 2022	Metcash Ltd, swap sur rendement total	312	(5)
143	29 juill. 2022	Monadelphous Group Ltd, swap sur rendement total	1 262	(149)
1 260	29 juill. 2022	Musgrave Minerals Ltd, swap sur rendement total	274	(75)
466	29 juill. 2022	Nanosonics Ltd, swap sur rendement total	1 389	46
1 428	29 juill. 2022	Nearmap Ltd, swap sur rendement total	1 305	(199)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
176	29 juill. 2022	New Century Resources Ltd, swap sur rendement total	261	(71)
3 478	29 juill. 2022	New Hope Corp Ltd, swap sur rendement total	10 674	(722)
103	29 juill. 2022	Nib Holdings Ltd, swap sur rendement total	674	23
11 122	29 juill. 2022	Nickel Mines Ltd, swap sur rendement total	9 619	(3 064)
157	29 juill. 2022	Nitro Software Ltd, swap sur rendement total	187	(1)
877	29 juill. 2022	Northern Star Resources Ltd, swap sur rendement total	5 321	(1 461)
303	29 juill. 2022	Novonix Ltd, swap sur rendement total	613	(369)
578	29 juill. 2022	Orica Ltd, swap sur rendement total	8 152	(115)
8 485	29 juill. 2022	Origin Energy Ltd, swap sur rendement total	43 127	(7 566)
1 368	29 juill. 2022	Oz Minerals Ltd, swap sur rendement total	21 551	(7 392)
686	29 juill. 2022	Peet Ltd, swap sur rendement total	572	(9)
826	29 juill. 2022	Perseus Mining Ltd, swap sur rendement total	1 161	(246)
1 520	29 juill. 2022	Pinnacle Investment Managem, swap sur rendement total	9 478	(1 348)
94	29 juill. 2022	Platinum Asset Management, swap sur rendement total	145	(5)
139	29 juill. 2022	Premier Investments Ltd, swap sur rendement total	2 457	(86)
27	29 juill. 2022	Pro Medicus Ltd, swap sur rendement total	1 012	21
103	29 juill. 2022	Pwr Holdings Ltd, swap sur rendement total	577	(137)
79	29 juill. 2022	Qantas Airways Ltd, swap sur rendement total	313	(9)
30	29 juill. 2022	Ramsay Health Care Ltd, swap sur rendement total	1 949	37
179	29 juill. 2022	Regis Healthcare Ltd, swap sur rendement total	294	(63)
559	29 juill. 2022	Ridley Corp Ltd, swap sur rendement total	888	5
4 568	29 juill. 2022	Sandfire Resources NI, swap sur rendement total	18 031	(4 349)
4 472	29 juill. 2022	Santos Ltd, swap sur rendement total	29 434	(2 551)
6 026	29 juill. 2022	Seven West Media Ltd, swap sur rendement total	2 192	(483)
174	29 juill. 2022	Sims Metal Management Ltd, swap sur rendement total	2 116	(502)
352	29 juill. 2022	Smartgroup Corp Ltd, swap sur rendement total	1 908	(416)
509	29 juill. 2022	South32 Ltd, swap sur rendement total	1 779	(238)
845	29 juill. 2022	Srg Global Ltd, swap sur rendement total	457	(7)
1 026	29 juill. 2022	Steadfast Group Ltd, swap sur rendement total	4 569	(8)
915	29 juill. 2022	Tabcorp Holdings Ltd, swap sur rendement total	864	68
3 405	29 juill. 2022	Ten Sixty Four Ltd, swap sur rendement total	2 084	(197)
153	29 juill. 2022	Test Local Currency, swap sur rendement total	1 842	53
625	29 juill. 2022	Uniti Group Ltd, swap sur rendement total	2 728	(18)
228	29 juill. 2022	Virtus Health Ltd, swap sur rendement total	1 684	43
5 242	29 juill. 2022	Warrego Energy Ltd, swap sur rendement total	511	(93)
110	29 juill. 2022	Webjet Ltd, swap sur rendement total	521	(40)
619	29 juill. 2022	West African Resources Ltd, swap sur rendement total	664	(37)
401	29 juill. 2022	Westgold Resources Ltd, swap sur rendement total	422	(42)
19	29 juill. 2022	Westpac Banking Corp, swap sur rendement total	329	1
8 613	29 juill. 2022	Whitehaven Coal Ltd, swap sur rendement total	36 978	(3 295)
				(62 613)
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
181	29 juill. 2022	888 Holdings Plc, swap sur rendement total	475	(107)
39	29 juill. 2022	Abcam Plc, swap sur rendement total	720	1
1 725	29 juill. 2022	Abrdn Plc, swap sur rendement total	4 320	(540)
1 478	29 juill. 2022	Airtel Africa Plc, swap sur rendement total	3 131	(442)
392	29 juill. 2022	Alfa Financial Software Hold, swap sur rendement total	921	(154)
609	29 juill. 2022	Anglo American Plc, swap sur rendement total	28 020	(8 322)
365	29 juill. 2022	Antofagasta Plc, swap sur rendement total	6 604	(1 576)
338	29 juill. 2022	Ashmore Group Plc, swap sur rendement total	1 174	(89)
956	29 juill. 2022	Auto Trader Group Plc, swap sur rendement total	8 312	(385)
1 621	29 juill. 2022	Babcock Intl Group Plc, swap sur rendement total	7 842	(725)
3 377	29 juill. 2022	Bae Systems Plc, swap sur rendement total	43 920	3 508
699	29 juill. 2022	Bakkavor Group Plc, swap sur rendement total	1 021	(57)
657	29 juill. 2022	Balfour Beatty Plc, swap sur rendement total	2 678	(4)
231	29 juill. 2022	Bank Of Georgia Group Plc, swap sur rendement total	4 735	(1 048)
32	29 juill. 2022	Barratt Developments Plc, swap sur rendement total	229	(12)
94	29 juill. 2022	Bellway Plc, swap sur rendement total	3 226	(213)
252	29 juill. 2022	Biffa Plc, swap sur rendement total	1 480	199
243	29 juill. 2022	Bodycote Plc, swap sur rendement total	2 004	(467)
24	29 juill. 2022	Britvic Plc, swap sur rendement total	308	8
2 254	29 juill. 2022	Brown (N) Group Plc, swap sur rendement total	837	(294)
1 318	29 juill. 2022	Bt Group Plc, swap sur rendement total	3 847	32
136	29 juill. 2022	Burberry Group Plc, swap sur rendement total	3 572	-
1 680	29 juill. 2022	Cairn Energy Plc, swap sur rendement total	5 737	509
4 447	29 juill. 2022	Card Factory Plc, swap sur rendement total	3 215	(1 281)
236	29 juill. 2022	Centamin Plc, swap sur rendement total	290	(8)
1 086	29 juill. 2022	Centrica Plc, swap sur rendement total	1 361	12
256	29 juill. 2022	Ceres Power Holdings Plc, swap sur rendement total	2 198	(432)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
9 051	29 juill. 2022	Cineworld Group Plc, swap sur rendement total	2 978	(679)
641	29 juill. 2022	Civitas Social Housing Plc, swap sur rendement total	789	(29)
121	29 juill. 2022	Cmc Markets Plc, swap sur rendement total	519	(67)
2 286	29 juill. 2022	Compass Group Plc, swap sur rendement total	60 501	(2 219)
52	29 juill. 2022	Croda International Plc, swap sur rendement total	5 272	(279)
85	29 juill. 2022	Cvs Group Plc, swap sur rendement total	2 205	(164)
255	29 juill. 2022	Daily Mail&General Tst-A Nv, swap sur rendement total	1 079	-
68	29 juill. 2022	Dcc Plc, swap sur rendement total	5 559	(365)
241	29 juill. 2022	Derwent London Plc, swap sur rendement total	9 861	(1 375)
14	29 juill. 2022	Diageo Plc, swap sur rendement total	774	(30)
14	29 juill. 2022	Diploma Plc, swap sur rendement total	489	(82)
170	29 juill. 2022	Discoverie Group Plc, swap sur rendement total	1 671	(303)
1 911	29 juill. 2022	Drax Group Plc, swap sur rendement total	19 250	(837)
325	29 juill. 2022	Eckoh Plc, swap sur rendement total	209	5
449	29 juill. 2022	Eco Animal Health Group Plc, swap sur rendement total	795	(50)
2 344	29 juill. 2022	Enquest Plc, swap sur rendement total	859	(237)
40	29 juill. 2022	Entain Plc, swap sur rendement total	780	(64)
20	29 juill. 2022	Experian Plc, swap sur rendement total	754	12
79	29 juill. 2022	Ferguson Plc, swap sur rendement total	11 371	(137)
15	29 juill. 2022	Fevertree Drinks Plc, swap sur rendement total	287	(53)
654	29 juill. 2022	Finsbury Food Group Plc, swap sur rendement total	697	(52)
556	29 juill. 2022	Firstgroup Plc, swap sur rendement total	1 111	(78)
15	29 juill. 2022	Games Workshop Group Plc, swap sur rendement total	1 570	(45)
11	29 juill. 2022	Gamma Communications Plc, swap sur rendement total	185	(19)
104	29 juill. 2022	Genus Plc, swap sur rendement total	4 086	(382)
571	29 juill. 2022	Glencore Plc, swap sur rendement total	3 981	(522)
67	29 juill. 2022	Greggs Plc, swap sur rendement total	1 898	(332)
2 149	29 juill. 2022	Gulf Keystone Petroleum Ltd, swap sur rendement total	8 757	(594)
62	29 juill. 2022	Halma Plc, swap sur rendement total	1 951	(145)
29 908	29 juill. 2022	Hammerson Plc, swap sur rendement total	8 888	(3 903)
6 501	29 juill. 2022	Harbour Energy Plc, swap sur rendement total	37 051	(2 081)
1 023	29 juill. 2022	Hargreaves Lansdown Plc, swap sur rendement total	12 625	(1 089)
29	29 juill. 2022	Hikma Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	735	45
533	29 juill. 2022	Hiscox Ltd, swap sur rendement total	7 869	127
173	29 juill. 2022	Howden Joinery Group Plc, swap sur rendement total	1 633	(617)
802	29 juill. 2022	Inchcape Plc, swap sur rendement total	8 738	(347)
1 419	29 juill. 2022	Indivior Plc, swap sur rendement total	6 873	(485)
2 539	29 juill. 2022	Informa Plc, swap sur rendement total	21 033	(292)
59	29 juill. 2022	Integratin Holdings Plc, swap sur rendement total	208	(59)
421	29 juill. 2022	Intercontinental Hotels Grou, swap sur rendement total	28 690	(3 416)
317	29 juill. 2022	International Personal Finan, swap sur rendement total	380	(33)
16	29 juill. 2022	Intertek Group Plc, swap sur rendement total	1 054	(15)
45	29 juill. 2022	Investec Plc, swap sur rendement total	314	(23)
133	29 juill. 2022	Johnson Matthey Plc, swap sur rendement total	4 126	(228)
97	29 juill. 2022	Joules Group Plc, swap sur rendement total	55	(18)
731	29 juill. 2022	Kainos Group Plc, swap sur rendement total	12 700	(1 752)
38	29 juill. 2022	Keller Group Plc, swap sur rendement total	445	(19)
48	29 juill. 2022	Keywords Studios Plc, swap sur rendement total	1 650	(107)
172	29 juill. 2022	Kin And Carta Plc, swap sur rendement total	473	(113)
117	29 juill. 2022	Kingfisher Plc, swap sur rendement total	448	-
211	29 juill. 2022	Lancashire Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 333	31
9	29 juill. 2022	Liontrust Asset Management, swap sur rendement total	136	(15)
136	29 juill. 2022	London Stock Exchange Group, swap sur rendement total	16 260	931
100	29 juill. 2022	Lsl Property Services Plc, swap sur rendement total	525	7
391	29 juill. 2022	Man Group Plc/Jersey, swap sur rendement total	1 530	6
26	29 juill. 2022	Marlowe Plc, swap sur rendement total	301	(71)
483	29 juill. 2022	Marston'S Plc, swap sur rendement total	390	(23)
2 722	29 juill. 2022	Micro Focus International, swap sur rendement total	11 931	(3 884)
4 203	29 juill. 2022	Mitchells & Butlers Plc, swap sur rendement total	12 128	(1 547)
787	29 juill. 2022	Mitie Group Plc, swap sur rendement total	708	7
109	29 juill. 2022	Moneysupermarket.Com, swap sur rendement total	297	(10)
100	29 juill. 2022	Morgan Advanced Materials Pl, swap sur rendement total	431	(71)
179	29 juill. 2022	Morgan Sindall Group Plc, swap sur rendement total	5 109	(728)
252	29 juill. 2022	Naked Wines Plc, swap sur rendement total	676	(762)
811	29 juill. 2022	National Grid Plc, swap sur rendement total	13 795	(1 095)
141	29 juill. 2022	Ncc Group Plc, swap sur rendement total	414	(59)
838	29 juill. 2022	Newriver Reit Plc, swap sur rendement total	1 159	(25)
207	29 juill. 2022	Petrofac Ltd, swap sur rendement total	364	(88)
1 534	29 juill. 2022	Playtech Plc, swap sur rendement total	13 013	(454)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
23	29 juill. 2022	Polar Capital Holdings Plc, swap sur rendement total	184	(36)
223	29 juill. 2022	Provident Financial Plc, swap sur rendement total	697	(186)
204	29 juill. 2022	Qinetiq Group Plc, swap sur rendement total	1 175	42
323	29 juill. 2022	Rank Group Plc, swap sur rendement total	433	(118)
58	29 juill. 2022	Reach Plc, swap sur rendement total	91	(20)
9	29 juill. 2022	Reckitt Benckiser Group Plc, swap sur rendement total	870	(79)
39	29 juill. 2022	Redrow Plc, swap sur rendement total	299	(17)
117	29 juill. 2022	Renishaw Plc, swap sur rendement total	6 540	(787)
223	29 juill. 2022	Rentokil Initial Plc, swap sur rendement total	1 658	36
158	29 juill. 2022	Rightmove Plc, swap sur rendement total	1 407	(87)
636	29 juill. 2022	Rolls-Royce Holdings Plc, swap sur rendement total	826	(33)
61	29 juill. 2022	Rotork Plc, swap sur rendement total	230	(32)
614	29 juill. 2022	Royal Mail Plc, swap sur rendement total	2 594	(319)
384	29 juill. 2022	Rs Group Plc, swap sur rendement total	5 297	(466)
42	29 juill. 2022	Sage Group Plc/The, swap sur rendement total	418	(106)
426	29 juill. 2022	Sanderson Design Group Plc, swap sur rendement total	888	(81)
37	29 juill. 2022	Savills Plc, swap sur rendement total	587	(41)
3 028	29 juill. 2022	Schroder Real Estate Investm, swap sur rendement total	2 467	(52)
117	29 juill. 2022	Schroders Plc, swap sur rendement total	4 898	(398)
264	29 juill. 2022	Senior Plc, swap sur rendement total	479	(44)
254	29 juill. 2022	Sig Plc, swap sur rendement total	118	(24)
185	29 juill. 2022	Smiths Group Plc, swap sur rendement total	4 056	(291)
161	29 juill. 2022	Somero Enterprises Inc- actions ord., swap sur rendement total	984	(1)
51	29 juill. 2022	Spectris Plc, swap sur rendement total	2 166	(214)
317	29 juill. 2022	Speedy Hire Plc, swap sur rendement total	215	(6)
32	29 juill. 2022	Spirax-Sarco Engineering Plc, swap sur rendement total	4 952	(95)
59	29 juill. 2022	Spire Healthcare Group Plc, swap sur rendement total	217	13
397	29 juill. 2022	Ssp Group Plc, swap sur rendement total	1 448	(182)
802	29 juill. 2022	Standard Chartered Plc, swap sur rendement total	7 772	207
181	29 juill. 2022	Sthree Plc, swap sur rendement total	1 011	(84)
385	29 juill. 2022	Supermarket Income Reit Plc, swap sur rendement total	721	(55)
5	29 juill. 2022	Tate & Lyle Plc, swap sur rendement total	60	-
131	29 juill. 2022	Taylor Wimpey Plc, swap sur rendement total	239	(21)
28	29 juill. 2022	Telecom Plus Plc, swap sur rendement total	858	120
166	29 juill. 2022	Trifast Plc, swap sur rendement total	249	(20)
359	29 juill. 2022	Tt Electronics Plc, swap sur rendement total	986	(112)
10 640	29 juill. 2022	Tullow Oil Plc, swap sur rendement total	7 811	(1 297)
464	29 juill. 2022	Tyman Plc, swap sur rendement total	1 734	(440)
34	29 juill. 2022	Victrex Plc, swap sur rendement total	948	(33)
43	29 juill. 2022	Vistry Group Plc, swap sur rendement total	563	(90)
63	29 juill. 2022	Volex Plc, swap sur rendement total	237	(33)
434	29 juill. 2022	Volution Group Plc, swap sur rendement total	2 288	(484)
374	29 juill. 2022	Warehouse Reit Plc, swap sur rendement total	864	(73)
371	29 juill. 2022	Watches Of Switzerland Group, swap sur rendement total	4 469	(827)
402	29 juill. 2022	Weir Group Plc/The, swap sur rendement total	8 584	(1 466)
46	29 juill. 2022	Wh Smith Plc, swap sur rendement total	1 013	(81)
250	29 juill. 2022	Whitbread Plc, swap sur rendement total	9 841	(603)
48	29 juill. 2022	Wincanton Plc, swap sur rendement total	261	(25)
233	29 juill. 2022	Xp Power Ltd, swap sur rendement total	10 469	(1 392)
				(53 717)
Euro – taux à court terme (€STR)				
325	29 juill. 2022	Aalberts Nv, swap sur rendement total	16 743	(3 326)
3	29 juill. 2022	Adesso Se, swap sur rendement total	592	(98)
46	29 juill. 2022	Adidas Ag, swap sur rendement total	10 469	(277)
35	29 juill. 2022	Adyen Nv, swap sur rendement total	65 514	(1 031)
541	29 juill. 2022	Aib Group Plc, swap sur rendement total	1 586	(236)
219	29 juill. 2022	Air Liquide Sa, swap sur rendement total	37 839	(3 093)
92	29 juill. 2022	Akwel, swap sur rendement total	1 988	(307)
171	29 juill. 2022	Alfen Nv, swap sur rendement total	20 330	(2 783)
140	29 juill. 2022	Allgeier Se, swap sur rendement total	6 363	(554)
261	29 juill. 2022	Allianz Se- actions ord., swap sur rendement total	64 102	(2 961)
130	29 juill. 2022	Alma Media Corp, swap sur rendement total	1 727	(26)
49	29 juill. 2022	Amadeus It Group Sa, swap sur rendement total	3 513	(307)
64	29 juill. 2022	Andritz Ag, swap sur rendement total	3 318	(385)
43	29 juill. 2022	Arcadis Nv, swap sur rendement total	1 861	(249)
2	29 juill. 2022	Argan, swap sur rendement total	241	(47)
52	29 juill. 2022	Argenx Se, swap sur rendement total	25 070	3 702
13	29 juill. 2022	Asml Holding Nv, swap sur rendement total	7 992	(1 057)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	29 juill. 2022	Aspo Oyj, swap sur rendement total	1 038	60
64	29 juill. 2022	Austria Technologie & System, swap sur rendement total	4 402	(396)
332	29 juill. 2022	Autogrill Spa, swap sur rendement total	2 837	(283)
2 124	29 juill. 2022	Axa Sa, swap sur rendement total	62 042	(5 050)
2 882	29 juill. 2022	Banco Bilbao Vizcaya Argenta, swap sur rendement total	16 831	(2 839)
3 565	29 juill. 2022	Banco Comercial Portugues-R, swap sur rendement total	793	(33)
23 238	29 juill. 2022	Banco De Sabadell Sa, swap sur rendement total	23 836	(2 258)
45	29 juill. 2022	Bank Of Ireland Group Plc, swap sur rendement total	366	(16)
2 847	29 juill. 2022	Bankinter Sa, swap sur rendement total	22 852	141
7	29 juill. 2022	Basic-Fit Nv, swap sur rendement total	341	(25)
32	29 juill. 2022	Bawag Group Ag, swap sur rendement total	1 733	(263)
86	29 juill. 2022	Bayer Ag- actions ord., swap sur rendement total	6 578	(237)
105	29 juill. 2022	Befesa Sa, swap sur rendement total	6 747	(2 015)
3	29 juill. 2022	Beiersdorf Ag, swap sur rendement total	394	10
105	29 juill. 2022	Bertrandt Ag, swap sur rendement total	5 062	(828)
79	29 juill. 2022	Bnp Paribas, swap sur rendement total	4 833	(473)
379	29 juill. 2022	Bollore, swap sur rendement total	2 259	(241)
11	29 juill. 2022	Bureau Veritas Sa, swap sur rendement total	363	(5)
2 046	29 juill. 2022	Caixabank Sa, swap sur rendement total	9 152	23
7	29 juill. 2022	Cancom Se, swap sur rendement total	312	(9)
20	29 juill. 2022	Capgemini Se, swap sur rendement total	4 409	(417)
45	29 juill. 2022	Carl Zeiss Meditec Ag - Br, swap sur rendement total	6 912	(553)
302	29 juill. 2022	Carrefour Sa, swap sur rendement total	6 877	(54)
93	29 juill. 2022	Ceconomy Ag, swap sur rendement total	334	(31)
13	29 juill. 2022	Cia De Distribucion Integral, swap sur rendement total	327	12
32	29 juill. 2022	Citycon Oyj, swap sur rendement total	280	(19)
149	29 juill. 2022	Coface Sa, swap sur rendement total	2 002	(177)
373	29 juill. 2022	Commerzbank Ag, swap sur rendement total	3 363	(497)
355	29 juill. 2022	Compagnie De Saint Gobain, swap sur rendement total	19 602	(4 186)
208	29 juill. 2022	Continental Ag, swap sur rendement total	18 654	(1 235)
3	29 juill. 2022	Covivio, swap sur rendement total	214	(53)
456	29 juill. 2022	Danone, swap sur rendement total	32 752	(433)
38	29 juill. 2022	Dassault Aviation Sa, swap sur rendement total	7 631	(436)
6	29 juill. 2022	Dermapharm Holding Se, swap sur rendement total	384	14
1 715	29 juill. 2022	Deutsche Bank Ag- actions, nominatives, swap sur rendement total	19 238	(4 248)
2	29 juill. 2022	Deutsche Boerse Ag, swap sur rendement total	430	160
987	29 juill. 2022	Deutsche Lufthansa- actions ord., swap sur rendement total	7 406	(1 660)
338	29 juill. 2022	Deutsche Post Ag- actions ord., swap sur rendement total	16 291	197
772	29 juill. 2022	Deutsche Telekom Ag- actions ord., swap sur rendement total	19 725	459
108	29 juill. 2022	D'Ieteren Sa/Nv, swap sur rendement total	20 332	(533)
311	29 juill. 2022	Duerr Ag, swap sur rendement total	9 210	(1 574)
24	29 juill. 2022	Eckert & Ziegler Strahlen Un, swap sur rendement total	1 179	(24)
61	29 juill. 2022	Edf, swap sur rendement total	642	(32)
574	29 juill. 2022	Edp Renovaveis Sa, swap sur rendement total	17 432	(235)
2 809	29 juill. 2022	Edp-Energias De Portugal Sa, swap sur rendement total	16 865	(792)
235	29 juill. 2022	Edreams Odigeo Sl, swap sur rendement total	1 642	(585)
100	29 juill. 2022	Elecnor Sa, swap sur rendement total	1 477	(116)
219	29 juill. 2022	Elior Group, swap sur rendement total	626	(194)
11	29 juill. 2022	Elmos Semiconductor Ag, swap sur rendement total	540	(156)
119	29 juill. 2022	Enagas Sa, swap sur rendement total	3 381	(38)
372	29 juill. 2022	Ence Energia Y Celulosa Sa, swap sur rendement total	1 636	(153)
33	29 juill. 2022	Erste Group Bank Ag, swap sur rendement total	1 077	(184)
28	29 juill. 2022	Esker Sa, swap sur rendement total	4 807	(702)
89	29 juill. 2022	Evn Ag, swap sur rendement total	2 424	(352)
291	29 juill. 2022	Evotec Se, swap sur rendement total	9 026	(812)
25	29 juill. 2022	Evs Broadcast Equipment S.A., swap sur rendement total	730	30
398	29 juill. 2022	Faurecia, swap sur rendement total	10 152	(1 373)
11	29 juill. 2022	Ferrovial Sa, swap sur rendement total	359	3
373	29 juill. 2022	Flatex Ag, swap sur rendement total	4 567	(2 351)
21	29 juill. 2022	Fraport Ag Frankfurt Airport, swap sur rendement total	1 175	(294)
8	29 juill. 2022	Fresenius Se & Co Kgaa, swap sur rendement total	312	(106)
416	29 juill. 2022	F-Secure Oyj, swap sur rendement total	2 805	(65)
36	29 juill. 2022	Fuchs Petrolub Se - actions priv., swap sur rendement total	1 291	(68)
541	29 juill. 2022	Fugro Nv-Cva, swap sur rendement total	8 784	(1 382)
22	29 juill. 2022	Gea Group Ag, swap sur rendement total	976	(125)
44	29 juill. 2022	Gerresheimer Ag, swap sur rendement total	3 679	(381)
11	29 juill. 2022	Gesco Ag, swap sur rendement total	355	(50)
140	29 juill. 2022	Getlink Se, swap sur rendement total	3 178	(205)
162	29 juill. 2022	Gft Technologies Se, swap sur rendement total	8 269	(403)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
36	29 juill. 2022	Glanbia Plc, swap sur rendement total	502	(24)
11	29 juill. 2022	Grand City Properties, swap sur rendement total	203	(34)
100	29 juill. 2022	Groupe Guillin, swap sur rendement total	2 724	(174)
14	29 juill. 2022	Hannover Rueck Se, swap sur rendement total	2 615	(11)
231	29 juill. 2022	Heidelbergcement Ag, swap sur rendement total	14 280	(2 324)
3 067	29 juill. 2022	Heidelberger Druckmaschinen, swap sur rendement total	5 894	(2 234)
170	29 juill. 2022	Hellofresh Se, swap sur rendement total	7 073	(707)
31	29 juill. 2022	Henkel Ag & Co KgaA Vorzug, swap sur rendement total	2 457	(138)
45	29 juill. 2022	Hermes International, swap sur rendement total	64 752	(1 842)
27	29 juill. 2022	Hochtief Ag, swap sur rendement total	1 761	(436)
6	29 juill. 2022	Hornbach Holding Ag & Co Kga, swap sur rendement total	634	(118)
14	29 juill. 2022	Hugo Boss Ag – actions ord., swap sur rendement total	951	11
113	29 juill. 2022	Iberdrola Sa, swap sur rendement total	1 508	(8)
139	29 juill. 2022	Imcd Nv, swap sur rendement total	24 547	(1 626)
113	29 juill. 2022	Indra Sistemas Sa, swap sur rendement total	1 391	10
448	29 juill. 2022	Ing Groep Nv, swap sur rendement total	5 698	(258)
61	29 juill. 2022	Inmobiliaria Colonial Socimi, swap sur rendement total	502	(87)
160	29 juill. 2022	Jeronimo Martins, swap sur rendement total	4 475	398
4	29 juill. 2022	Jost Werke Ag, swap sur rendement total	192	(25)
48	29 juill. 2022	Jungheinrich – actions priv., swap sur rendement total	1 346	(252)
12	29 juill. 2022	Kbc Ancora, swap sur rendement total	567	(94)
38	29 juill. 2022	Kbc Group Nv, swap sur rendement total	2 744	(159)
30	29 juill. 2022	Kerry Group Plc-A, swap sur rendement total	3 695	(178)
32	29 juill. 2022	Kesko Oyj- actions, B, swap sur rendement total	971	52
38	29 juill. 2022	Kinepolis, swap sur rendement total	2 348	(161)
19	29 juill. 2022	Kingspan Group Plc, swap sur rendement total	1 471	(426)
12	29 juill. 2022	Knorr-Bremse Ag, swap sur rendement total	881	(58)
9	29 juill. 2022	Konecranes Oyj, swap sur rendement total	270	(35)
277	29 juill. 2022	Koninklijke Ahold Delhaize N, swap sur rendement total	9 287	123
1 089	29 juill. 2022	Koninklijke Bam Groep Nv, swap sur rendement total	3 313	(612)
2	29 juill. 2022	Koninklijke Dsm Nv, swap sur rendement total	370	73
707	29 juill. 2022	Koninklijke Philips Nv, swap sur rendement total	19 598	(1 499)
25	29 juill. 2022	Ksb Se & Co KgaA-Vorzug, swap sur rendement total	11 463	(1 277)
72	29 juill. 2022	Lar Espana Real Estate Socim, swap sur rendement total	460	(20)
3	29 juill. 2022	Legrand Sa, swap sur rendement total	285	(15)
123	29 juill. 2022	Linea Directa Aseguradora Sa, swap sur rendement total	209	(8)
108	29 juill. 2022	L'Oréal, swap sur rendement total	47 961	571
2	29 juill. 2022	Lvmh Moet Hennessy Louis Vui, swap sur rendement total	1 569	96
615	29 juill. 2022	Maurel Et Prom, swap sur rendement total	3 695	(381)
98	29 juill. 2022	Melia Hotels International, swap sur rendement total	800	(182)
140	29 juill. 2022	Mercedes-Benz Group Ag, swap sur rendement total	10 426	(1 409)
132	29 juill. 2022	Merck KgaA, swap sur rendement total	28 660	(1 831)
1 104	29 juill. 2022	Metso Outotec Oyj, swap sur rendement total	10 645	(2 261)
330	29 juill. 2022	Michelin (Cgde), swap sur rendement total	11 560	(1 349)
425	29 juill. 2022	Mlp Se, swap sur rendement total	3 278	(515)
21	29 juill. 2022	Muenchener Rueckver Ag- actions ord., swap sur rendement total	6 349	123
137	29 juill. 2022	Nemetschek Se, swap sur rendement total	10 671	(1 368)
11	29 juill. 2022	Neopost Sa, swap sur rendement total	242	(46)
11	29 juill. 2022	Nexans Sa, swap sur rendement total	1 097	(205)
100	29 juill. 2022	Nh Hotel Group Sa, swap sur rendement total	469	(58)
95	29 juill. 2022	Nn Group Nv, swap sur rendement total	5 553	37
327	29 juill. 2022	Nordex Se, swap sur rendement total	3 588	(942)
859	29 juill. 2022	Obrascon Huarte Lain S.A., swap sur rendement total	680	(179)
14	29 juill. 2022	Omv Ag, swap sur rendement total	845	(148)
25	29 juill. 2022	Ontex Group Nv, swap sur rendement total	252	-
121	29 juill. 2022	Ordina Nv, swap sur rendement total	777	3
1 205	29 juill. 2022	Outokumpu Oyj, swap sur rendement total	6 412	(2 289)
106	29 juill. 2022	Permanent Tsb Group Holdings, swap sur rendement total	189	(19)
15	29 juill. 2022	Pernod Ricard Sa, swap sur rendement total	3 546	39
1	29 juill. 2022	Pfeiffer Vacuum Technology, swap sur rendement total	202	(14)
1 613	29 juill. 2022	Pharming Group Nv, swap sur rendement total	1 636	(22)
131	29 juill. 2022	Porsche Automobil Hldg- actions priv., swap sur rendement total	11 151	(2 064)
1 265	29 juill. 2022	Postnl Nv, swap sur rendement total	4 939	(433)
157	29 juill. 2022	Prosus Nv, swap sur rendement total	13 229	1 421
16	29 juill. 2022	Proximus, swap sur rendement total	303	4
19	29 juill. 2022	Qt Group Oyj, swap sur rendement total	1 804	(166)
726	29 juill. 2022	Raiffeisen Bank International, swap sur rendement total	10 124	(1 432)
7	29 juill. 2022	Rational Ag, swap sur rendement total	5 235	(470)
252	29 juill. 2022	Red Electrica Corporacion Sa, swap sur rendement total	6 373	(169)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
37	29 juill. 2022	Rémy Cointreau, swap sur rendement total	8 318	(174)
49	29 juill. 2022	Renault Sa, swap sur rendement total	1 572	(96)
35	29 juill. 2022	Rheinmetall Ag, swap sur rendement total	10 398	746
45	29 juill. 2022	Rovio Entertainment Oy, swap sur rendement total	400	(126)
131	29 juill. 2022	Royal Dutch Shell Plc- actions, A, swap sur rendement total	4 027	296
502	29 juill. 2022	Rubis, swap sur rendement total	15 083	(3 966)
8	29 juill. 2022	Safran Sa, swap sur rendement total	1 016	258
9	29 juill. 2022	Salzgitter Ag, swap sur rendement total	282	(125)
11	29 juill. 2022	Sampo Oyj- actions, A, swap sur rendement total	616	7
215	29 juill. 2022	Sanofi, swap sur rendement total	27 933	(253)
46	29 juill. 2022	Sanoma Oyj, swap sur rendement total	825	48
128	29 juill. 2022	Schneider Electric Se, swap sur rendement total	19 489	(2 170)
251	29 juill. 2022	Scor Se, swap sur rendement total	6 939	(1 106)
19	29 juill. 2022	Shop Apotheke Europe Nv, swap sur rendement total	2 173	(226)
344	29 juill. 2022	Siemens Gamesa Renewable Ene, swap sur rendement total	8 309	(18)
302	29 juill. 2022	Siemens Healthineers Ag, swap sur rendement total	19 749	(2 635)
34	29 juill. 2022	Signify Nv, swap sur rendement total	1 450	(206)
296	29 juill. 2022	Sma Solar Technology Ag, swap sur rendement total	15 464	(2 157)
100	29 juill. 2022	Smcp Sa, swap sur rendement total	674	(171)
16	29 juill. 2022	Smurfit Kappa Group Plc, swap sur rendement total	692	(36)
75	29 juill. 2022	Société Générale Sa, swap sur rendement total	2 113	(265)
386	29 juill. 2022	Sonae, swap sur rendement total	610	34
2	29 juill. 2022	Sopra Steria Group, swap sur rendement total	385	(60)
21	29 juill. 2022	Stmicroelectronics Nv, swap sur rendement total	850	(148)
2	29 juill. 2022	Sto Se & Co. Kga- actions priv., swap sur rendement total	376	(78)
111	29 juill. 2022	Stora Enso Oyj- actions, R, swap sur rendement total	2 240	(341)
43	29 juill. 2022	Suess Microtec Se, swap sur rendement total	783	(192)
67	29 juill. 2022	Teamviewer Ag, swap sur rendement total	858	(90)
7	29 juill. 2022	Tessenderlo Group, swap sur rendement total	285	(4)
5	29 juill. 2022	Tkh Group Nv-Dutch Cert, swap sur rendement total	243	(61)
538	29 juill. 2022	Tomtom, swap sur rendement total	5 122	(481)
106	29 juill. 2022	Totalenergies Se, swap sur rendement total	7 200	(605)
168	29 juill. 2022	Tubacex Sa, swap sur rendement total	529	(27)
176	29 juill. 2022	Ubisoft Entertainment, swap sur rendement total	9 945	(1 616)
302	29 juill. 2022	Ucb Sa, swap sur rendement total	32 842	(396)
212	29 juill. 2022	Umicore, swap sur rendement total	9 526	(2 296)
13	29 juill. 2022	Unibail-Rodamco-Westfield, swap sur rendement total	853	(73)
1 512	29 juill. 2022	Valeo Sa, swap sur rendement total	37 569	(4 520)
856	29 juill. 2022	Vallourec Sa, swap sur rendement total	13 143	(1 734)
431	29 juill. 2022	Valneva Se, swap sur rendement total	6 309	(501)
341	29 juill. 2022	Veolia Environnement, swap sur rendement total	10 710	(990)
215	29 juill. 2022	Vinci Sa, swap sur rendement total	24 634	(785)
3	29 juill. 2022	Virbac Sa, swap sur rendement total	1 503	51
2	29 juill. 2022	Volkswagen Ag- actions priv., swap sur rendement total	344	(41)
34	29 juill. 2022	Wacker Neuson Se, swap sur rendement total	756	(158)
2 460	29 juill. 2022	Wartsila Oyj Abp, swap sur rendement total	24 649	(1 473)
168	29 juill. 2022	Wienerberger Ag, swap sur rendement total	4 640	(945)
125	29 juill. 2022	Zumtobel Group Ag, swap sur rendement total	1 180	51
				(114 012)
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
18 000	29 juill. 2022	Agile Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	9 291	(536)
2 000	29 juill. 2022	Air China Ltd-H, swap sur rendement total	2 242	191
600	29 juill. 2022	Anta Sports Products Ltd, swap sur rendement total	9 508	714
22 506	29 juill. 2022	Baic Motor Corp Ltd-H, swap sur rendement total	9 656	330
500	29 juill. 2022	Byd Co Ltd-H, swap sur rendement total	25 818	2 492
500	29 juill. 2022	Byd Electronic Intl Co Ltd, swap sur rendement total	2 043	610
2 000	29 juill. 2022	Cabbeen Fashion Ltd, swap sur rendement total	589	(181)
24 000	29 juill. 2022	Capital Environment Holdings, swap sur rendement total	734	10
17	29 juill. 2022	China Aerospace Intl Hldg, swap sur rendement total	1	-
2 000	29 juill. 2022	China Bluechemical Ltd - H, swap sur rendement total	743	(161)
745	29 juill. 2022	China Datang Corp Renewabl-H, swap sur rendement total	327	(5)
19 000	29 juill. 2022	China Dongxiang Group Co, swap sur rendement total	1 390	40
4 000	29 juill. 2022	China Electronics Huada Tech, swap sur rendement total	559	29
2 000	29 juill. 2022	China Evergrande New Energy, swap sur rendement total	1 052	-
1 000	29 juill. 2022	China Feihe Ltd, swap sur rendement total	1 483	177
8 000	29 juill. 2022	China Hanking Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 618	(52)
3 000	29 juill. 2022	China Hongqiao Group Ltd, swap sur rendement total	4 374	(431)
2 000	29 juill. 2022	China Meidong Auto Holdings, swap sur rendement total	8 121	(1 153)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
500	29 juill. 2022	China Merchants Bank-H, swap sur rendement total	4 315	204
2 000	29 juill. 2022	China Merchants Port Holding, swap sur rendement total	4 623	(106)
1 500	29 juill. 2022	China Overseas Land & Invest, swap sur rendement total	6 303	679
1 800	29 juill. 2022	China Pacific Insurance Gr-H, swap sur rendement total	5 971	537
1 000	29 juill. 2022	China Pioneer Pharma Holding, swap sur rendement total	459	61
2 000	29 juill. 2022	China Resources Beer Holding, swap sur rendement total	19 333	3 186
8 000	29 juill. 2022	China Shineway Pharmaceutica, swap sur rendement total	8 824	1 040
400	29 juill. 2022	China Taiping Insurance Hold, swap sur rendement total	637	28
4 300	29 juill. 2022	China Vanke Co Ltd-H, swap sur rendement total	13 940	1 672
18 500	29 juill. 2022	China Yongda Automobiles Ser, swap sur rendement total	22 566	(2 105)
9 500	29 juill. 2022	China Zhengtong Auto Service, swap sur rendement total	937	62
2 000	29 juill. 2022	Chinasoft International Ltd, swap sur rendement total	2 640	281
10 400	29 juill. 2022	Cifi Holdings Group Co Ltd, swap sur rendement total	6 830	1 223
17 000	29 juill. 2022	Citic Dameng Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 431	(112)
12 000	29 juill. 2022	Cogobuy Group, swap sur rendement total	4 517	135
30 000	29 juill. 2022	Concord New Energy Group Ltd, swap sur rendement total	3 847	2
3 000	29 juill. 2022	Consun Pharmaceutical Group, swap sur rendement total	2 061	54
8 997	29 juill. 2022	Country Garden Holdings Co, swap sur rendement total	7 338	157
1 000	29 juill. 2022	Country Garden Services Hold, swap sur rendement total	5 795	681
2 500	29 juill. 2022	Crystal International Group, swap sur rendement total	1 154	(38)
1 000	29 juill. 2022	Csc Financial Co Ltd-H, swap sur rendement total	1 433	218
800	29 juill. 2022	Dfzq-H, swap sur rendement total	580	30
4 000	29 juill. 2022	Dongfeng Motor Grp Co Ltd-H, swap sur rendement total	3 919	(139)
14 000	29 juill. 2022	Dongyue Group, swap sur rendement total	23 383	431
2 000	29 juill. 2022	Eagle Nice (Intl) Hldgs Ltd, swap sur rendement total	1 351	(102)
300	29 juill. 2022	Enn Energy Holdings Ltd, swap sur rendement total	6 461	527
6	29 juill. 2022	Fse Services Group Ltd, swap sur rendement total	5	-
14 000	29 juill. 2022	Fufeng Group Ltd, swap sur rendement total	11 576	3 105
22 000	29 juill. 2022	Geely Automobile Holdings Lt, swap sur rendement total	65 279	10 949
2 000	29 juill. 2022	Genscript Biotech Corp, swap sur rendement total	9 354	1 550
10 000	29 juill. 2022	Goodbaby International Holdi, swap sur rendement total	1 660	(115)
4 500	29 juill. 2022	Grand Baoxin Auto Group Ltd, swap sur rendement total	429	(15)
7 500	29 juill. 2022	Great Wall Motor Company-H, swap sur rendement total	19 899	2 086
2 500	29 juill. 2022	Greentown China Holdings, swap sur rendement total	6 871	1 281
4 000	29 juill. 2022	Haichang Ocean Park Holdings, swap sur rendement total	5 234	612
1 100	29 juill. 2022	Haitong International Securi, swap sur rendement total	203	9
2 000	29 juill. 2022	Harbin Electric Co Ltd-H, swap sur rendement total	750	29
18 000	29 juill. 2022	Hi Sun Technology China Ltd, swap sur rendement total	2 900	147
516	29 juill. 2022	Hisense Home Appliances Gr-H, swap sur rendement total	770	77
1 000	29 juill. 2022	Honma Golf Ltd, swap sur rendement total	575	59
1 000	29 juill. 2022	Huabao International Holding, swap sur rendement total	993	299
6	29 juill. 2022	Inke Ltd, swap sur rendement total	1	-
1 500	29 juill. 2022	Innovent Biologics Inc, swap sur rendement total	8 606	2 410
1 000	29 juill. 2022	Jiangxi Copper Co Ltd-H, swap sur rendement total	1 848	23
2 500	29 juill. 2022	Kingboard Holdings Ltd, swap sur rendement total	13 209	(2 249)
2 500	29 juill. 2022	Kingboard Laminates Hldg Ltd, swap sur rendement total	4 471	(925)
30 000	29 juill. 2022	Kunlun Energy Co Ltd, swap sur rendement total	32 735	(610)
16 000	29 juill. 2022	Lenovo Group Ltd, swap sur rendement total	19 280	(1 082)
5 500	29 juill. 2022	Li Ning Co Ltd, swap sur rendement total	65 731	10 185
3 000	29 juill. 2022	Logan Property Holdings Co L, swap sur rendement total	1 075	-
2 800	29 juill. 2022	Man Wah Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 903	312
200	29 juill. 2022	Microport Scientific Corp, swap sur rendement total	748	124
11 000	29 juill. 2022	Modern Dental Group Ltd, swap sur rendement total	5 714	180
200	29 juill. 2022	New China Life Insurance C-H, swap sur rendement total	725	22
1 000	29 juill. 2022	Pax Global Technology Ltd, swap sur rendement total	1 004	(15)
7 000	29 juill. 2022	Perfect Shape Medical Ltd, swap sur rendement total	4 856	(373)
1 500	29 juill. 2022	Ping An Insurance Group Co-H, swap sur rendement total	13 155	643
7 000	29 juill. 2022	Powerlong Real Estate Holdin, swap sur rendement total	1 623	(719)
2 000	29 juill. 2022	Qingling Motors Co Ltd-H, swap sur rendement total	434	(50)
600	29 juill. 2022	Samsonite International Sa, swap sur rendement total	1 541	(229)
3 500	29 juill. 2022	Shanghai Fosun Pharmaceuti-H, swap sur rendement total	17 036	(1 864)
6 500	29 juill. 2022	Shimao Property Holdings Ltd, swap sur rendement total	4 723	(1)
5 200	29 juill. 2022	Sisram Medical Ltd, swap sur rendement total	11 489	4 455
18 000	29 juill. 2022	Skyworth Group Ltd, swap de rendement total	11 481	(387)
15 000	29 juill. 2022	Sunac China Holdings Ltd, swap de rendement total	11 294	(2)
4 500	29 juill. 2022	Swire Pacific Ltd - Cl A, swap de rendement total	34 583	(709)
1 000	29 juill. 2022	Texhong Textile Group Ltd, swap de rendement total	1 364	(32)
12 000	29 juill. 2022	Tianjin Development Hldgs Lt, swap de rendement total	3 403	202
6 000	29 juill. 2022	Tianjin Port Dvlp Hlds Ltd, swap de rendement total	700	62

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
4 000	29 juill. 2022	Tianneng Power Intl Ltd, swap de rendement total	5 846	843
2 000	29 juill. 2022	Tk Group Holdings Ltd, swap de rendement total	628	(125)
10 000	29 juill. 2022	Tongda Group Holdings Ltd, swap de rendement total	248	18
7 000	29 juill. 2022	Towngas China Co Ltd, swap de rendement total	4 983	471
9 240	29 juill. 2022	Trigiant Group Ltd, swap de rendement total	714	23
18 000	29 juill. 2022	Truly International Holdings, swap de rendement total	7 102	442
3 000	29 juill. 2022	Union Medical Healthcare Ltd, swap de rendement total	3 906	(139)
4 000	29 juill. 2022	Vstecs Holdings Ltd, swap de rendement total	4 307	52
10 000	29 juill. 2022	Wasion Holdings Ltd, swap de rendement total	4 225	(67)
15 000	29 juill. 2022	Weimob Inc, swap de rendement total	13 217	1 594
4 000	29 juill. 2022	Weiqiao Textile Co Ltd-H, swap de rendement total	1 223	(73)
50 000	29 juill. 2022	West China Cement Ltd, swap de rendement total	8 852	(932)
2 000	29 juill. 2022	Wh Group Ltd, swap de rendement total	2 038	87
10 000	29 juill. 2022	Xinyi Glass Holdings Ltd, swap de rendement total	32 187	(598)
13 000	29 juill. 2022	Xiwang Special Steel Co Ltd, swap de rendement total	481	(64)
4 000	29 juill. 2022	Yadea Group Holdings Ltd, swap de rendement total	10 284	1 843
900	29 juill. 2022	Zhongan Online P&C Insuran-H, swap de rendement total	3 780	(115)
500	29 juill. 2022	Zhongsheng Group Holdings, swap de rendement total	4 619	39
2 500	29 juill. 2022	Zhou Hei Ya International Ho, swap de rendement total	2 219	518
14 000	29 juill. 2022	Zijin Mining Group Co Ltd-H, swap de rendement total	22 117	(2 423)
10 000	29 juill. 2022	Zte Corp-H, swap de rendement total	30 050	1 634
				<hr/>
				43 152
Yen japonais – taux moyen du financement à un jour offert à Tokyo (TONAR)				
100	29 juill. 2022	Airport Facilities Co Ltd, swap de rendement total	508	1
600	29 juill. 2022	Allied Telesis Holdings Kk, swap de rendement total	553	(45)
400	29 juill. 2022	Ana Holdings Inc, swap de rendement total	9 493	(157)
100	29 juill. 2022	Artnature Inc, swap de rendement total	684	(26)
1 300	29 juill. 2022	Asahi Kasei Corp, swap de rendement total	12 788	(353)
400	29 juill. 2022	Asahi Net Inc, swap de rendement total	2 203	(57)
700	29 juill. 2022	Astellas Pharma Inc, swap de rendement total	14 057	248
100	29 juill. 2022	Bandai Namco Holdings Inc, swap de rendement total	9 095	(43)
200	29 juill. 2022	Bando Chemical Industries, swap de rendement total	1 749	40
600	29 juill. 2022	Base Inc, swap de rendement total	1 846	(210)
700	29 juill. 2022	Chiba Bank Ltd/The, swap de rendement total	4 925	503
900	29 juill. 2022	Chiyoda Corp, swap de rendement total	3 657	(158)
300	29 juill. 2022	Chubu Electric Power Co Inc, swap de rendement total	3 891	210
200	29 juill. 2022	Chuetsu Pulp & Paper Co Ltd, swap de rendement total	1 720	(3)
100	29 juill. 2022	Ci Takiron Corp, swap de rendement total	512	1
100	29 juill. 2022	Cleanup Corp, swap de rendement total	544	15
400	29 juill. 2022	Concordia Financial Group Lt, swap de rendement total	1 785	60
100	29 juill. 2022	Cosmo Energy Holdings Co Ltd, swap de rendement total	3 570	146
200	29 juill. 2022	Dai Nippon Toryo Co Ltd, swap de rendement total	1 346	(77)
100	29 juill. 2022	Dai-Ichi Life Holdings Inc, swap de rendement total	2 383	(14)
1 600	29 juill. 2022	Daiichi Sankyo Co Ltd, swap de rendement total	52 215	675
100	29 juill. 2022	Dainichi Co Ltd, swap de rendement total	611	(7)
400	29 juill. 2022	Daiwa Securities Group Inc, swap de rendement total	2 302	(50)
200	29 juill. 2022	Eisai Co Ltd, swap de rendement total	10 872	740
200	29 juill. 2022	Electric Power Development C, swap de rendement total	4 261	388
100	29 juill. 2022	Endo Lighting Corp, swap de rendement total	732	(16)
100	29 juill. 2022	Eri Holdings Co Ltd, swap de rendement total	1 202	(65)
100	29 juill. 2022	Fujikura Kasei Co Ltd, swap de rendement total	439	(15)
100	29 juill. 2022	Furuno Electric Co Ltd, swap de rendement total	959	-
100	29 juill. 2022	Globeride Inc, swap de rendement total	2 021	(209)
100	29 juill. 2022	Gsi Creos Corp, swap de rendement total	1 333	119
200	29 juill. 2022	Gun Ei Chemical Industry Co, swap sur rendement total	4 867	(248)
400	29 juill. 2022	Healios Kk, swap sur rendement total	1 352	(98)
500	29 juill. 2022	Hino Motors Ltd, swap sur rendement total	3 309	(55)
200	29 juill. 2022	Hochiki Corp, swap sur rendement total	2 446	129
100	29 juill. 2022	H-One Co Ltd, swap sur rendement total	566	(3)
100	29 juill. 2022	Hoya Corp, swap sur rendement total	11 000	(1 530)
200	29 juill. 2022	Ihi Corp, swap sur rendement total	6 893	(103)
300	29 juill. 2022	Iino Kaiun Kaisha Ltd, swap sur rendement total	1 948	64
100	29 juill. 2022	Ijtt Co Ltd, swap sur rendement total	498	(3)
700	29 juill. 2022	Inpex Corp, swap sur rendement total	9 770	(1 401)
100	29 juill. 2022	Inui Global Logistics Co Ltd, swap sur rendement total	1 661	(50)
300	29 juill. 2022	Isetan Mitsukoshi Holdings L, swap sur rendement total	3 133	72
400	29 juill. 2022	Itochu Corp, swap sur rendement total	13 927	(106)
500	29 juill. 2022	Itochu Enex Co Ltd, swap sur rendement total	5 004	(3)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	29 juill. 2022	Japan Electronic Materials, swap sur rendement total	1 535	(299)
100	29 juill. 2022	Japan Petroleum Exploration, swap sur rendement total	3 043	48
1 600	29 juill. 2022	Japan Tobacco Inc, swap sur rendement total	35 640	(722)
100	29 juill. 2022	Jimoto Holdings Inc, swap sur rendement total	536	(9)
100	29 juill. 2022	Jsr Corp, swap sur rendement total	3 342	(478)
200	29 juill. 2022	Jvckenwood Corp, swap sur rendement total	336	(25)
100	29 juill. 2022	Kamei Corp, swap sur rendement total	998	(6)
100	29 juill. 2022	Kansai Paint Co Ltd, swap sur rendement total	1 643	45
100	29 juill. 2022	Kitagawa Corp, swap sur rendement total	1 312	(64)
100	29 juill. 2022	Koa Corp, swap sur rendement total	1 535	(99)
100	29 juill. 2022	Komatsu Matere Co Ltd, swap sur rendement total	1 068	(172)
100	29 juill. 2022	Kyoei Steel Ltd, swap sur rendement total	1 312	45
100	29 juill. 2022	Kyowa Electronic Instruments, swap sur rendement total	296	(32)
100	29 juill. 2022	Lasertec Corp, swap sur rendement total	15 334	(883)
500	29 juill. 2022	Maetzawa Industries Inc, swap sur rendement total	2 901	36
100	29 juill. 2022	Mars Group Holdings Corp, swap sur rendement total	1 570	(25)
200	29 juill. 2022	Marubun Corp, swap sur rendement total	1 377	(58)
900	29 juill. 2022	Mazda Motor Corp, swap sur rendement total	9 486	179
100	29 juill. 2022	Medical System Network Co, swap sur rendement total	411	(2)
100	29 juill. 2022	Meiji Electric Industries Co, swap sur rendement total	1 043	(2)
300	29 juill. 2022	Meiji Shipping Co Ltd, swap sur rendement total	2 868	(424)
400	29 juill. 2022	Mikuni Corp, swap sur rendement total	1 432	40
100	29 juill. 2022	Minebea Mitsumi Inc, swap sur rendement total	2 193	(94)
100	29 juill. 2022	Mirai Industry Co Ltd, swap sur rendement total	1 430	(46)
300	29 juill. 2022	Mitsubishi Gas Chemical Co, swap sur rendement total	5 569	(399)
100	29 juill. 2022	Mitsui Chemicals Inc, swap sur rendement total	2 744	(253)
1 100	29 juill. 2022	Mitsui Osk Lines Ltd, swap sur rendement total	32 430	(3 426)
100	29 juill. 2022	Modec Inc, swap sur rendement total	1 111	1
100	29 juill. 2022	Mory Industries Inc, swap sur rendement total	2 299	(15)
100	29 juill. 2022	Mymax Holdings Ltd, swap sur rendement total	599	14
200	29 juill. 2022	Ms&Ad Insurance Group Holdin, swap sur rendement total	7 896	169
100	29 juill. 2022	Nagano Bank Ltd/The, swap sur rendement total	1 314	116
100	29 juill. 2022	Naigai Trans Line Ltd, swap sur rendement total	1 810	(109)
1 100	29 juill. 2022	Nakayama Steel Works Ltd, swap sur rendement total	4 460	10
300	29 juill. 2022	New Japan Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	729	8
100	29 juill. 2022	Nihon M&A Center Inc, swap sur rendement total	1 370	(48)
600	29 juill. 2022	Nikon Corp, swap sur rendement total	8 939	(209)
100	29 juill. 2022	Nippon Beet Sugar Mfg Co Ltd, swap sur rendement total	1 624	45
200	29 juill. 2022	Nippon Paper Industries Co L, swap sur rendement total	1 827	2
1 200	29 juill. 2022	Nippon Steel Corp, swap sur rendement total	21 637	(3 728)
100	29 juill. 2022	Nishi-Nippon Financial Holdi, swap sur rendement total	712	(4)
100	29 juill. 2022	Nishio Rent All Co Ltd, swap sur rendement total	2 561	(13)
100	29 juill. 2022	Nissan Chemical Corp, swap sur rendement total	5 934	(970)
400	29 juill. 2022	Nissan Tokyo Sales Holdings, swap sur rendement total	999	97
200	29 juill. 2022	Nisso Corp, swap sur rendement total	1 094	(62)
100	29 juill. 2022	Njs Co Ltd, swap sur rendement total	1 859	(31)
100	29 juill. 2022	Nof Corp, swap sur rendement total	4 776	95
400	29 juill. 2022	Obayashi Corp, swap sur rendement total	3 741	207
300	29 juill. 2022	Odakyu Electric Railway Co, swap sur rendement total	5 199	284
100	29 juill. 2022	Oeon Holdings Inc, swap sur rendement total	286	5
100	29 juill. 2022	Okamoto Machine Tool Works, swap sur rendement total	3 594	(622)
100	29 juill. 2022	Oriental Land Co Ltd, swap sur rendement total	17 965	(263)
1	29 juill. 2022	Orix Jreit Inc, swap sur rendement total	1 749	(7)
100	29 juill. 2022	Osaka Gas Co Ltd, swap sur rendement total	2 465	161
200	29 juill. 2022	Osaka Titanium Technologies, swap sur rendement total	4 968	1 271
100	29 juill. 2022	Otsuka Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	4 575	330
100	29 juill. 2022	Pasco Corp, swap sur rendement total	1 307	63
100	29 juill. 2022	Punch Industry Co Ltd, swap sur rendement total	437	(10)
200	29 juill. 2022	Quick Co Ltd, swap sur rendement total	2 588	(78)
1 300	29 juill. 2022	Rakuten Inc, swap sur rendement total	7 554	(717)
100	29 juill. 2022	Rasa Industries Ltd, swap sur rendement total	1 801	(52)
400	29 juill. 2022	Renesas Electronics Corp, swap sur rendement total	4 683	(1 022)
1 000	29 juill. 2022	Resona Holdings Inc, swap sur rendement total	4 824	64
500	29 juill. 2022	Ryobi Ltd, swap sur rendement total	4 918	(295)
100	29 juill. 2022	Sankyo Tateyama Inc, swap sur rendement total	522	(19)
100	29 juill. 2022	Sega Sammy Holdings Inc, swap sur rendement total	2 068	(204)
100	29 juill. 2022	Seika Corp, swap sur rendement total	1 560	19
100	29 juill. 2022	Seiko Pmc Corp, swap sur rendement total	515	(26)
100	29 juill. 2022	Shimizu Corp, swap sur rendement total	712	23

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	29 juill. 2022	Shinnihon Corp, swap sur rendement total	671	(27)
200	29 juill. 2022	Shiseido Co Ltd, swap sur rendement total	10 342	288
500	29 juill. 2022	Shizuoka Bank Ltd/The, swap sur rendement total	3 869	194
200	29 juill. 2022	Sk-Electronics Ltd, swap sur rendement total	1 745	(89)
100	29 juill. 2022	Software Service Inc, swap sur rendement total	6 124	707
200	29 juill. 2022	Sompo Holdings Inc, swap sur rendement total	11 362	167
500	29 juill. 2022	Sony Group Corp, swap sur rendement total	52 674	(4 759)
100	29 juill. 2022	Starzen Co Ltd, swap sur rendement total	1 890	4
200	29 juill. 2022	Stemrim Inc, swap sur rendement total	1 333	(49)
800	29 juill. 2022	Sumco Corp, swap sur rendement total	13 361	(2 568)
1 000	29 juill. 2022	Sumitomo Corp, swap sur rendement total	17 632	67
200	29 juill. 2022	Sun-Wa Technos Corp, swap sur rendement total	2 442	(256)
200	29 juill. 2022	Suzuki Motor Corp, swap sur rendement total	8 097	824
100	29 juill. 2022	System Information Co Ltd, swap sur rendement total	896	(14)
100	29 juill. 2022	System Support Inc, swap sur rendement total	1 106	(19)
800	29 juill. 2022	T&D Holdings Inc, swap sur rendement total	12 336	1 108
100	29 juill. 2022	T&K Toka Co Ltd, swap sur rendement total	767	(18)
100	29 juill. 2022	Taiheiyō Cement Corp, swap sur rendement total	1 923	77
100	29 juill. 2022	Taiyo Nippon Sanso Corp, swap sur rendement total	2 054	(191)
100	29 juill. 2022	Tdk Corp, swap sur rendement total	3 978	(244)
400	29 juill. 2022	Tecnos Japan Inc, swap sur rendement total	1 827	(125)
100	29 juill. 2022	Toell Co Ltd, swap sur rendement total	875	(6)
800	29 juill. 2022	Tohoku Electric Power Co Inc, swap sur rendement total	5 522	81
100	29 juill. 2022	Tokai Carbon Co Ltd, swap sur rendement total	982	(70)
100	29 juill. 2022	Tokio Marine Holdings Inc, swap sur rendement total	7 504	346
100	29 juill. 2022	Tokyo Century Corp, swap sur rendement total	4 263	215
100	29 juill. 2022	Tokyo Electric Power Company, swap sur rendement total	538	27
100	29 juill. 2022	Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd, swap sur rendement total	6 305	(714)
100	29 juill. 2022	Tokyo Sangyo Co Ltd, swap sur rendement total	673	5
200	29 juill. 2022	Tomony Holdings Inc, swap sur rendement total	592	14
100	29 juill. 2022	Topre Corp, swap sur rendement total	945	(37)
3 600	29 juill. 2022	Toray Industries Inc, swap sur rendement total	26 019	2 608
900	29 juill. 2022	Tosoh Corp, swap sur rendement total	14 399	(1 470)
100	29 juill. 2022	Toyo Seikan Group Holdings L, swap sur rendement total	1 347	35
400	29 juill. 2022	Tsukuba Bank Ltd, swap sur rendement total	733	35
100	29 juill. 2022	Tsuruha Holdings Inc, swap sur rendement total	6 998	167
300	29 juill. 2022	Will Group Inc, swap sur rendement total	3 276	(80)
100	29 juill. 2022	Win-Partners Co Ltd, swap sur rendement total	952	(29)
1 000	29 juill. 2022	Yamabiko Corp, swap sur rendement total	10 872	(365)
200	29 juill. 2022	Yamada Denki Co Ltd, swap sur rendement total	927	26
100	29 juill. 2022	Yamaha Corp, swap sur rendement total	5 317	267
100	29 juill. 2022	Yamaha Motor Co Ltd, swap sur rendement total	2 360	(93)
100	29 juill. 2022	Yaskawa Electric Corp, swap sur rendement total	4 149	(67)
100	29 juill. 2022	Yokogawa Electric Corp, swap sur rendement total	2 128	(66)
400	29 juill. 2022	Yokohama Rubber Co Ltd, swap sur rendement total	6 977	464
100	29 juill. 2022	Yushin Precision Equipment, swap sur rendement total	663	5
700	29 juill. 2022	Zeon Corp, swap sur rendement total	8 734	(367)
				(18 331)
Dollar néo-zélandais – taux du marché des acceptations bancaires (BKBM) à 1 mois				
1 171	29 juill. 2022	A2 Milk Co Ltd, swap de rendement total	4 630	(189)
745	29 juill. 2022	Contact Energy Ltd, swap de rendement total	4 350	(90)
117	29 juill. 2022	Ebos Group Ltd, swap de rendement total	3 661	(138)
2 006	29 juill. 2022	Infratil Ltd, swap de rendement total	12 356	(121)
				(538)
Dollar de Singapour – taux interbancaire offert à Singapour (SIBOR) à 1 mois				
300	29 juill. 2022	Aims Apac Reit, swap de rendement total	375	(6)
1 100	29 juill. 2022	Boustead Singapore Ltd, swap de rendement total	974	(6)
1 400	29 juill. 2022	Bumitama Agri Ltd, swap de rendement total	863	(75)
1 171	29 juill. 2022	China Sunshine Chemical Hldgs, swap de rendement total	478	(11)
400	29 juill. 2022	DBS Group Holdings Ltd, swap de rendement total	11 004	(370)
400	29 juill. 2022	First Resources Ltd, swap de rendement total	604	(113)
200	29 juill. 2022	Hong Leong Finance Ltd, swap de rendement total	449	(5)
1 100	29 juill. 2022	Hrnetgroup Ltd, swap de rendement total	790	50
800	29 juill. 2022	Lian Beng Group Ltd, swap de rendement total	371	(15)
2 400	29 juill. 2022	Lippo Malls Indonesia Retail, swap de rendement total	113	(7)
200	29 juill. 2022	Parkwaylife Real Estate, swap de rendement total	903	4

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
9 897	29 juill. 2022	Riverstone Holdings Ltd, swap de rendement total	6 788	39
300	29 juill. 2022	Sheng Siong Group Ltd, swap de rendement total	423	(5)
28 517	29 juill. 2022	Thomson Medical Group Ltd, swap de rendement total	2 088	(55)
				(575)
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
118	29 juill. 2022	Absa Group Ltd, swap de rendement total	1 436	(60)
1 617	29 juill. 2022	Aeci Ltd, swap de rendement total	12 152	(1 057)
1 609	29 juill. 2022	Afrimat Ltd, swap de rendement total	7 158	(1 129)
2 929	29 juill. 2022	Allied Electronics Cor- actions, A, swap de rendement total	1 822	(298)
279	29 juill. 2022	Alviva Holdings Ltd, swap de rendement total	498	62
165	29 juill. 2022	Anglo American Platinum Ltd, swap de rendement total	18 514	(3 827)
1 397	29 juill. 2022	Arrowhead Properties Ltd-B, swap de rendement total	334	(17)
2 452	29 juill. 2022	Avi Ltd, swap de rendement total	12 689	(101)
350	29 juill. 2022	Barloworld Ltd, swap de rendement total	2 473	(249)
39	29 juill. 2022	Bidvest Group Ltd, swap de rendement total	644	(26)
799	29 juill. 2022	Blue Label Telecoms Ltd, swap de rendement total	391	34
15	29 juill. 2022	Capitec Bank Holdings Ltd, swap de rendement total	2 341	(336)
363	29 juill. 2022	Cashbuild Ltd, swap de rendement total	7 029	(988)
26	29 juill. 2022	Clicks Group Ltd, swap de rendement total	563	(34)
485	29 juill. 2022	Dis-Chem Pharmacies Pty Ltd, swap de rendement total	1 213	(70)
339	29 juill. 2022	Discovery Ltd, swap de rendement total	3 419	(434)
494	29 juill. 2022	Exxaro Resources Ltd, swap de rendement total	7 709	(933)
605	29 juill. 2022	Firstrand Ltd, swap de rendement total	2 971	(412)
100	29 juill. 2022	Hosken Cons Investments Ltd, swap de rendement total	1 215	(104)
245	29 juill. 2022	Hudaco Industries Ltd, swap de rendement total	2 874	(136)
868	29 juill. 2022	Investec Property Fund Ltd, swap de rendement total	714	(131)
715	29 juill. 2022	Jse Ltd, swap de rendement total	5 660	(591)
1 197	29 juill. 2022	Lewis Group Ltd, swap de rendement total	4 618	(301)
1 186	29 juill. 2022	Life Healthcare Group Holdin, swap de rendement total	1 673	(54)
166	29 juill. 2022	Metair Investments Ltd, swap de rendement total	320	(42)
760	29 juill. 2022	Motus Holdings Ltd, swap de rendement total	6 403	(476)
1 763	29 juill. 2022	Mpact Ltd, swap sur rendement total	4 303	(294)
20	29 juill. 2022	Mr Price Group Ltd, swap sur rendement total	288	(22)
277	29 juill. 2022	Mtn Group Ltd, swap sur rendement total	2 880	(609)
3 753	29 juill. 2022	Nampak Ltd, swap sur rendement total	650	(228)
669	29 juill. 2022	Netcare Ltd, swap sur rendement total	752	(57)
2 374	29 juill. 2022	Northam Platinum Ltd, swap sur rendement total	32 019	(3 255)
444	29 juill. 2022	Omnia Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 541	(383)
241	29 juill. 2022	Raubex Group Ltd, swap sur rendement total	651	(100)
108	29 juill. 2022	Reunert Ltd, swap sur rendement total	340	(13)
233	29 juill. 2022	Sanlam Ltd, swap sur rendement total	970	(101)
20	29 juill. 2022	Shoprite Holdings Ltd, swap sur rendement total	312	(11)
80	29 juill. 2022	Standard Bank Group Ltd, swap sur rendement total	977	(78)
2 476	29 juill. 2022	Steinhoff International H Nv, swap sur rendement total	495	(32)
464	29 juill. 2022	Tiger Brands Ltd, swap sur rendement total	5 306	107
153	29 juill. 2022	Truworths International Ltd, swap sur rendement total	610	(56)
11 683	29 juill. 2022	Tsogo Sun Gaming Ltd, swap sur rendement total	9 576	(2 328)
2 477	29 juill. 2022	Tsogo Sun Hotels Ltd, swap sur rendement total	673	(48)
296	29 juill. 2022	Vodacom Group Ltd, swap sur rendement total	3 056	(377)
				(19 595)
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
186	29 juill. 2022	Addtech Ab- actions, B, swap de rendement total	3 123	(738)
39	29 juill. 2022	Alfa Laval Ab, swap de rendement total	1 211	(66)
12	29 juill. 2022	Assa Abloy Ab-B, swap de rendement total	328	(23)
1 005	29 juill. 2022	Avanza Bank Holding Ab, swap de rendement total	21 716	(6 722)
21	29 juill. 2022	Axfood Ab, swap de rendement total	778	45
121	29 juill. 2022	Beijer Alma Ab, swap de rendement total	2 565	(455)
19	29 juill. 2022	Beijer Ref Ab, swap de rendement total	335	10
36	29 juill. 2022	Billerudkorsnas Ab, swap de rendement total	541	(6)
7	29 juill. 2022	Billerudkorsnas Ab, swap de rendement total	-	-
96	29 juill. 2022	Biotage Ab, swap de rendement total	2 187	(214)
30	29 juill. 2022	Bygghem Group Ab, swap de rendement total	201	(13)
50	29 juill. 2022	Calliditas Therapeutics-B, swap de rendement total	581	2
467	29 juill. 2022	Catella Ab, swap de rendement total	1 987	(387)
19	29 juill. 2022	Concentric Ab, swap de rendement total	422	(30)
75	29 juill. 2022	Elanders Ab- actions, B, swap de rendement total	1 125	(229)
23	29 juill. 2022	Electrolux Ab- série B, swap de rendement total	399	(5)
160	29 juill. 2022	Elekta Ab- actions, B, swap de rendement total	1 423	(51)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
524	29 juill. 2022	Embracer Group Ab, swap de rendement total	5 144	(330)
298	29 juill. 2022	Epiroc Ab-A, swap de rendement total	5 925	(1 170)
260	29 juill. 2022	Ericsson Lm- actions, B, swap de rendement total	2 496	(59)
25	29 juill. 2022	Essity Aktiebolag-B, swap de rendement total	841	33
84	29 juill. 2022	Getinge Ab- actions, B, swap de rendement total	2 500	(122)
1 120	29 juill. 2022	Hennes & Mauritz Ab- actions, B, swap de rendement total	17 223	(1 558)
763	29 juill. 2022	Hexagon Ab- actions, B, swap de rendement total	10 205	(493)
820	29 juill. 2022	Hexatronic Group Ab, swap de rendement total	7 866	(1 284)
32	29 juill. 2022	Holmen Ab- actions, B, swap de rendement total	1 671	(158)
51	29 juill. 2022	Humana Ab, swap de rendement total	286	(37)
38	29 juill. 2022	Husqvarna Ab- actions, B, swap de rendement total	360	(22)
129	29 juill. 2022	Indutrade Ab, swap de rendement total	3 029	(532)
74	29 juill. 2022	Intrum Ab, swap de rendement total	1 818	(240)
50	29 juill. 2022	Inwido Ab, swap de rendement total	710	(127)
39	29 juill. 2022	Lagercrantz Group Ab- actions, B, swap de rendement total	407	(62)
103	29 juill. 2022	Leovegas Ab, swap de rendement total	784	5
525	29 juill. 2022	Lifco Ab- actions, B, swap de rendement total	10 855	(2 425)
49	29 juill. 2022	Medicover Ab – actions, B, swap de rendement total	822	(252)
34	29 juill. 2022	New Wave Group Ab - actions, B, swap de rendement total	583	(98)
172	29 juill. 2022	Nibe Industrier Ab- actions, B, swap de rendement total	1 663	(140)
36	29 juill. 2022	Nordic Waterproofing Hold Ab, swap de rendement total	635	(131)
151	29 juill. 2022	Oncopeptides Ab, swap de rendement total	440	63
210	29 juill. 2022	Proact It Group Ab, swap de rendement total	1 803	(116)
5 226	29 juill. 2022	Samhallsbyggnadsbolaget I No, swap sur rendement total	11 207	(2 637)
831	29 juill. 2022	Sandvik Ab, swap sur rendement total	17 349	(3 484)
644	29 juill. 2022	Scandic Hotels Group Ab, swap sur rendement total	3 201	(137)
6	29 juill. 2022	Sectra Ab- actions, B, swap sur rendement total	104	-
157	29 juill. 2022	Skf Ab- actions, B, swap sur rendement total	2 974	(355)
88	29 juill. 2022	Swedish Orphan Biovitrum Ab, swap sur rendement total	2 450	89
169	29 juill. 2022	Thule Group Ab/The, swap sur rendement total	5 346	(751)
538	29 juill. 2022	Tobii Ab, swap sur rendement total	1 196	(409)
79	29 juill. 2022	Viaplay Group Ab-B, swap sur rendement total	2 087	(422)
15	29 juill. 2022	Vitec Software Group Ab- actions, B, swap sur rendement total	837	(27)
29	29 juill. 2022	Volvo Ab- actions, B, swap sur rendement total	578	(38)
				<u>(26 308)</u>
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
50	29 juill. 2022	Bachem Holding Ag- actions ord., B, swap de rendement total	4 470	(524)
8	29 juill. 2022	Bossard Holding Ag- actions ord., A, swap de rendement total	1 992	(242)
2	29 juill. 2022	Bystronic Ag, swap de rendement total	1 870	(89)
47	29 juill. 2022	Credit Suisse Group Ag- actions ord., A, swap de rendement total	343	(25)
8	29 juill. 2022	Feintool Intl Holding- actions ord., swap de rendement total	5	5
6	29 juill. 2022	Feintool Intl Holding- actions ord., swap de rendement total	152	(27)
7	29 juill. 2022	Flughafen Zurich Ag- actions ord., swap de rendement total	1 361	(134)
29	29 juill. 2022	Galenica Ag, swap de rendement total	2 864	223
475	29 juill. 2022	Holcim Ltd, swap de rendement total	26 145	(3 623)
4	29 juill. 2022	Investis Holding Sa, swap de rendement total	552	(19)
19	29 juill. 2022	Julius Baer Group Ltd, swap de rendement total	1 127	(15)
51	29 juill. 2022	Lonza Group Ag- actions ord., swap de rendement total	34 978	(2 977)
1	29 juill. 2022	Phoenix Mecano Ag-Br, swap de rendement total	485	(7)
1	29 juill. 2022	Rieter Holding Ag- actions ord., swap de rendement total	148	(15)
17	29 juill. 2022	Roche Holding Ag-Genusschein, swap de rendement total	7 297	(42)
8	29 juill. 2022	Sensirion Holding Ag, swap de rendement total	1 043	32
1	29 juill. 2022	Sonova Holding Ag- actions ord., swap de rendement total	410	(3)
7	29 juill. 2022	Straumann Holding Ag- actions ord., swap de rendement total	1 081	106
72	29 juill. 2022	Swiss Life Holding Ag- actions ord., swap de rendement total	45 112	(3 405)
55	29 juill. 2022	Swiss Re Ag, swap de rendement total	5 483	(292)
1	29 juill. 2022	Swissquote Group Holding- actions ord., swap de rendement total	130	(29)
6	29 juill. 2022	Tecan Group Ag- actions ord., swap de rendement total	2 241	(268)
26	29 juill. 2022	Tx Group Ag, swap de rendement total	4 029	(376)
8	29 juill. 2022	U-Blox Holding Ag, swap de rendement total	1 042	66
216	29 juill. 2022	Ubs Group Ag- actions ord., swap de rendement total	4 479	(706)
				<u>(12 386)</u>
Dollar américain – taux interbancaire offert à Londres (ICE LIBOR) à 1 mois				
1 000	29 juill. 2022	Ability Enterprise Co Ltd TRS	967	(92)
199	29 juill. 2022	Ablbio Lnc TRS	4 980	(22)
1 000	29 juill. 2022	Acter Group Corp Ltd TRS	8 132	(899)
53	29 juill. 2022	Adani Green Energy Ltd TRS	1 670	47
20	29 juill. 2022	Adani Transmission Ltd TRS	808	124

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	29 juill. 2022	Advanced Info Service Pcl TRS	711	(103)
1 600	29 juill. 2022	Aes Brasil Energia Sa TRS	4 204	(557)
43	29 juill. 2022	Afreecatv Co Ltd TRS	3 420	(1 382)
95	29 juill. 2022	Agi Greenpac Ltd TRS	315	(46)
43	29 juill. 2022	Ajanta Pharma Ltd TRS	867	50
625	29 juill. 2022	Alembic Ltd TRS	636	(83)
53 638	29 juill. 2022	Alfa S.A.B.-A TRS	49 130	(4 089)
1 000	29 juill. 2022	Ali Corp TRS	995	(306)
127	29 juill. 2022	Allcargo Logistics Ltd TRS	545	(131)
750	29 juill. 2022	Alpargatas Sa - Pref TRS	3 538	(845)
3 100	29 juill. 2022	Alpek Sa De Cv TRS	5 526	214
100	29 juill. 2022	Alsea Sab De Cv TRS	244	(32)
3 000	29 juill. 2022	Ambassador Hotel/The TRS	4 222	(55)
93	29 juill. 2022	Amorepacific Corp - TRS	12 005	(3 153)
42	29 juill. 2022	Amrutanjan Health Care Ltd TRS	541	(35)
939	29 juill. 2022	Amtran Technology Co Ltd, swap sur rendement total	515	(30)
1 820	29 juill. 2022	Anhui Guangxin Agrochemica-A, swap sur rendement total	9 864	857
1 700	29 juill. 2022	Ann Joo Resources Bhd, swap sur rendement total	552	(120)
50	29 juill. 2022	Antarchile Sa, swap sur rendement total	498	(27)
209	29 juill. 2022	Apar Industries Ltd, swap sur rendement total	3 160	634
200	29 juill. 2022	Arezzo Industria E Comercio, swap sur rendement total	3 428	(941)
7 000	29 juill. 2022	Ata Ims Bhd, swap sur rendement total	604	(56)
1 000	29 juill. 2022	Aten Internation Co Ltd, swap sur rendement total	3 322	(188)
1 100	29 juill. 2022	Auren Energia Sa - On, swap sur rendement total	3 693	(485)
7	29 juill. 2022	Avenue Supermarts Ltd, swap sur rendement total	389	(73)
5 700	29 juill. 2022	Azul Sa, swap sur rendement total	17 393	(13 833)
2 000	29 juill. 2022	B3 Sa-Brasil Bolsa Balcao, swap sur rendement total	5 433	(204)
14 918	29 juill. 2022	Bajaj Hindusthan Sugar Ltd, swap sur rendement total	3 154	(334)
92	29 juill. 2022	Balrampur Chini Mills Ltd, swap sur rendement total	540	(79)
3 100	29 juill. 2022	Banco Btg Pactual Sa- parts, swap sur rendement total	17 046	(4 052)
500	29 juill. 2022	Banco Del Bajio Sa, swap sur rendement total	1 293	(300)
1 500	29 juill. 2022	Banco Do Brasil Sa -, swap sur rendement total	12 341	(1 844)
100	29 juill. 2022	Banco Estado Rio Gran- actions priv., B, swap sur rendement total	221	(38)
295	29 juill. 2022	Banco Products (India) Ltd, swap sur rendement total	852	47
1 000	29 juill. 2022	Bangkok Aviation Fuel Servic, swap sur rendement total	1 051	(23)
700	29 juill. 2022	Bangkok Chain Hospital Pcl, swap sur rendement total	478	(58)
100	29 juill. 2022	Bank Of Chengdu Co Ltd-A, swap sur rendement total	319	23
600	29 juill. 2022	Bank Of Jiangsu Co Ltd-A, swap sur rendement total	822	77
3 190	29 juill. 2022	Bank Of Suzhou Co Ltd-A, swap sur rendement total	3 746	49
900	29 juill. 2022	Bb Seguridade Participacoes, swap sur rendement total	5 759	(840)
2 900	29 juill. 2022	Beijing Capital Co Ltd-A, swap sur rendement total	1 619	(23)
1 000	29 juill. 2022	Bes Engineering Corp, swap sur rendement total	376	(35)
3	29 juill. 2022	Bgf Retail Co Ltd, swap sur rendement total	563	(11)
445	29 juill. 2022	Bhi Co Ltd, swap sur rendement total	3 124	462
200	29 juill. 2022	Bk Brasil Operacao E Assesso, swap sur rendement total	274	(131)
4	29 juill. 2022	Blue Dart Express Ltd, swap sur rendement total	510	11
101	29 juill. 2022	Bank Financial Group Inc, swap sur rendement total	673	(44)
200	29 juill. 2022	Braskem Sa- actions priv. A, swap sur rendement total	1 836	(79)
500	29 juill. 2022	Bright Dairy & Food Co Ltd-A, swap sur rendement total	1 216	13
6 000	29 juill. 2022	Brighton-Best International, swap sur rendement total	9 147	(197)
500	29 juill. 2022	Bumrungrad Hospital Pcl, swap sur rendement total	3 270	(20)
100	29 juill. 2022	By-Health Co Ltd-A, swap sur rendement total	417	32
20 971	29 juill. 2022	Cal-Comp Electronics Thailan, swap sur rendement total	1 793	(183)
38	29 juill. 2022	Caplin Point Laboratories, swap sur rendement total	441	(29)
1 000	29 juill. 2022	Cathay Financial Holding Co, swap sur rendement total	2 208	(270)
900	29 juill. 2022	Ccr Sa, swap sur rendement total	2 788	(479)
200	29 juill. 2022	Cell Biotech Co Ltd, swap sur rendement total	2 641	(457)
1 271	29 juill. 2022	Celsia Sa Esp, swap sur rendement total	1 500	(406)
185	29 juill. 2022	Cencosud Sa, swap sur rendement total	304	(66)
5	29 juill. 2022	Cera Sanitaryware Ltd, swap sur rendement total	339	(11)
280	29 juill. 2022	Cesc Ltd, swap sur rendement total	325	(38)
6 500	29 juill. 2022	Chengdu Hongqi Chain Co Lt-A, swap sur rendement total	6 320	307
7 100	29 juill. 2022	Chengdu Kanghong Pharmaceu-A, swap sur rendement total	20 422	34
1 000	29 juill. 2022	China Ecotek Corporation, swap sur rendement total	1 798	(111)
900	29 juill. 2022	China Electric Manufacturing, swap sur rendement total	779	47
100	29 juill. 2022	China Resources Sanjiu Med-A, swap sur rendement total	866	62
26 800	29 juill. 2022	China State Construction -A, swap sur rendement total	27 450	(1 123)
2 000	29 juill. 2022	Chipbond Technology Corp, swap sur rendement total	5 144	(1 592)
6 900	29 juill. 2022	Chularat Hospital Pcl, swap sur rendement total	933	(35)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	29 juill. 2022	Cia De Saneamento Do Pa- parts, swap sur rendement total	450	(79)
4 623	29 juill. 2022	Cia Energetica Minas Ger- actions priv., swap sur rendement total	11 828	(2 864)
400	29 juill. 2022	Cia Paranaense De Energi-Pfb, swap sur rendement total	673	(130)
295 713	29 juill. 2022	Cia Sud Americana De Vapores, swap sur rendement total	34 200	(17 630)
300	29 juill. 2022	Cimb Group Holdings Bhd, swap sur rendement total	435	(20)
96	29 juill. 2022	Cj Hello Co Ltd, swap sur rendement total	519	6
79	29 juill. 2022	Com2Us Corp, swap sur rendement total	5 624	(1 619)
4 000	29 juill. 2022	Coretronic Corp, swap sur rendement total	8 709	(1 255)
38	29 juill. 2022	Crown Confectionery Co Ltd, swap sur rendement total	319	(64)
50	29 juill. 2022	Csc Steel Holdings Bhd, swap sur rendement total	19	(3)
57	29 juill. 2022	Ctc Bio Inc, swap sur rendement total	447	(151)
248	29 juill. 2022	D.B. Corp Ltd, swap sur rendement total	302	(31)
431	29 juill. 2022	Daehan Steel Co Ltd -, swap sur rendement total	6 719	(2 411)
384	29 juill. 2022	Dae-II Corp, swap sur rendement total	1 603	(420)
245	29 juill. 2022	Daewon Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	3 783	(613)
52	29 juill. 2022	Daewoo Shipbuilding & Marine, swap sur rendement total	1 239	43
8	29 juill. 2022	Daewoong Pharmaceutical Co -, swap sur rendement total	1 402	(35)
9 000	29 juill. 2022	Darwin Precisions Corp, swap sur rendement total	3 779	(483)
200	29 juill. 2022	Dashenlin Pharmaceutical G-A, swap sur rendement total	1 205	(66)
4	29 juill. 2022	Dentium Co Ltd, swap sur rendement total	340	18
33	29 juill. 2022	Dgb Financial Group Inc -, swap sur rendement total	249	(22)
5 800	29 juill. 2022	Diamond Building Products Pc, swap sur rendement total	1 558	(83)
1 558	29 juill. 2022	Dish Tv India Ltd, swap sur rendement total	329	(12)
81	29 juill. 2022	Dongbu Steel Co Ltd, swap sur rendement total	1 070	(381)
873	29 juill. 2022	Dongkuk Steel Mill Co Ltd -, swap sur rendement total	11 139	(5 072)
136	29 juill. 2022	Dongwon Development Co -, swap sur rendement total	560	(132)
1	29 juill. 2022	Dongwon Industries Co Ltd, swap sur rendement total	222	(25)
55	29 juill. 2022	Doosan Bobcat Inc, swap sur rendement total	1 578	(309)
354	29 juill. 2022	Dreamus Co, swap sur rendement total	1 127	(380)
198	29 juill. 2022	Duksan Hi-Metal Co Ltd, swap sur rendement total	1 286	(646)
4 000	29 juill. 2022	E Ink Holdings Inc, swap sur rendement total	32 702	(3 421)
10 000	29 juill. 2022	E.Sun Financial Holding Co, swap sur rendement total	12 578	(1 036)
70	29 juill. 2022	Easy Bio Inc, swap sur rendement total	260	(102)
753	29 juill. 2022	Eclerx Services Ltd, swap sur rendement total	23 607	(1 862)
1 900	29 juill. 2022	Ecorodovias Infra E Log Sa, swap sur rendement total	2 669	(1 015)
200	29 juill. 2022	Edp - Energias Do Brasil Sa -, swap sur rendement total	1 011	(155)
1 000	29 juill. 2022	E-Life Mall Corporation, swap sur rendement total	3 708	(146)
1 000	29 juill. 2022	Elitegroup Computer Systems, swap sur rendement total	919	17
582	29 juill. 2022	Embassy Office Parks Reit, swap sur rendement total	3 556	(266)
200	29 juill. 2022	Energy Absolute Pcl, swap sur rendement total	596	(82)
100	29 juill. 2022	Eneva Sa, swap sur rendement total	364	(14)
1 500	29 juill. 2022	Enn Ecological Holdings Co-A, swap sur rendement total	5 369	583
1 000	29 juill. 2022	Ennoconn Corp, swap sur rendement total	9 281	8
800	29 juill. 2022	Equatorial Energia Sa - actions ord., swap sur rendement total	4 504	(619)
341	29 juill. 2022	Eris Lifesciences Ltd, swap sur rendement total	3 714	(75)
700	29 juill. 2022	Eucatex Sa Industria- actions priv., swap sur rendement total	1 373	(590)
15 000	29 juill. 2022	Eva Airways Corp, swap sur rendement total	20 591	(2 170)
150	29 juill. 2022	Eveready Industries India, swap sur rendement total	811	22
2 600	29 juill. 2022	Evergreen Fibreboard Bhd, swap sur rendement total	380	(94)
4 000	29 juill. 2022	Evergreen International Stor, swap sur rendement total	4 962	(1 625)
6 000	29 juill. 2022	Far Eastone Telecomm Co Ltd, swap sur rendement total	21 755	477
2 000	29 juill. 2022	Farglory Ftz Investment Hold, swap sur rendement total	4 276	(439)
42	29 juill. 2022	Fiem Industries Ltd, swap sur rendement total	908	201
2 000	29 juill. 2022	First Financial Holding Co, swap sur rendement total	2 273	(161)
188	29 juill. 2022	Firstec Co Ltd, swap sur rendement total	653	(200)
1 200	29 juill. 2022	Fleury Sa -, swap sur rendement total	4 821	611
84	29 juill. 2022	Foosung Co Ltd, swap sur rendement total	1 481	(544)
4 000	29 juill. 2022	Forth Smart Service Pcl, swap sur rendement total	2 733	(344)
315	29 juill. 2022	Fortis Healthcare Ltd, swap sur rendement total	1 234	(13)
144	29 juill. 2022	Forus Sa, swap sur rendement total	206	(55)
2 000	29 juill. 2022	Fubon Financial Holding Co, swap sur rendement total	5 187	(516)
2 000	29 juill. 2022	Gamania Digital Entertainmen, swap sur rendement total	5 526	(524)
146	29 juill. 2022	Gateway Distriparks Ltd, swap sur rendement total	160	(24)
1 000	29 juill. 2022	Gem Services Inc/Tw, swap sur rendement total	3 444	(299)
183	29 juill. 2022	General Ins Corp Of India, swap sur rendement total	344	(26)
16 100	29 juill. 2022	Genera Sab De Cv, swap sur rendement total	16 637	639
200	29 juill. 2022	Genting Plantations Bhd, swap sur rendement total	377	(70)
4 026	29 juill. 2022	Glyconex Inc, swap sur rendement total	4 828	134
148	29 juill. 2022	Glyconex Inc, swap sur rendement total	4 686	4 686

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
542	29 juill. 2022	Gmr Infrastructure Ltd, swap sur rendement total	302	(68)
6	29 juill. 2022	Golfzon Co Ltd, swap sur rendement total	801	(257)
262	29 juill. 2022	Goodyear India Ltd, swap sur rendement total	4 424	218
1 100	29 juill. 2022	Grandblue Environment Co -A, swap sur rendement total	4 341	(353)
60	29 juill. 2022	Great Wall Enterprises, swap sur rendement total	124	(8)
2 000	29 juill. 2022	Greatek Electronics Inc, swap sur rendement total	5 413	(994)
129	29 juill. 2022	Grindwell Norton Ltd, swap sur rendement total	3 545	(135)
400	29 juill. 2022	Grupo Bimbo Sab- série A, swap sur rendement total	1 677	(17)
5	29 juill. 2022	Grupo Elektra Sab De Cv, swap sur rendement total	372	(1)
46	29 juill. 2022	Grupo Nutresa Sa, swap sur rendement total	566	(17)
29	29 juill. 2022	Gs Engineering & Construct, swap sur rendement total	909	(40)
1 522	29 juill. 2022	Gujarat Inds Power Co Ltd, swap sur rendement total	1 902	(246)
1 177	29 juill. 2022	Gujarat State Fert & Chemica, swap sur rendement total	2 536	(729)
23	29 juill. 2022	Hana Financial Group -, swap sur rendement total	899	(33)
8	29 juill. 2022	Handsome Co Ltd, swap sur rendement total	244	(77)
400	29 juill. 2022	Hangzhou Tigermed Consulti-A, swap sur rendement total	8 814	2 158
5	29 juill. 2022	Hanmi Science Co Ltd, swap sur rendement total	199	(51)
100	29 juill. 2022	Hansae Yes24 Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	578	(111)
6	29 juill. 2022	Hansol Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	1 215	(256)
108	29 juill. 2022	Hanwha Aerospace Co Ltd -, swap sur rendement total	5 223	(749)
318	29 juill. 2022	Hanwha General Insurance Co -, swap sur rendement total	1 329	(101)
8 027	29 juill. 2022	Hanwha Life Insurance Co Ltd, swap sur rendement total	17 735	(4 228)
72	29 juill. 2022	Hanwha Systems Co Ltd, swap sur rendement total	997	(193)
500	29 juill. 2022	Henan Lingrui Pharmaceutic-A, swap sur rendement total	1 206	13
43	29 juill. 2022	Hg Infra Engineering Ltd, swap sur rendement total	365	(43)
3 700	29 juill. 2022	Hibiscus Petroleum Bhd, swap sur rendement total	1 093	(433)
68	29 juill. 2022	Hil Ltd, swap sur rendement total	3 942	(336)
20	29 juill. 2022	Hindustan Aeronautics Ltd, swap sur rendement total	578	(33)
169	29 juill. 2022	Hitejinro Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 921	(485)
692	29 juill. 2022	Home Center Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	804	(304)
100	29 juill. 2022	Hong Leong Bank Berhad, swap sur rendement total	599	(23)
3 000	29 juill. 2022	Hsing Ta Cement Co Ltd, swap sur rendement total	2 583	(72)
7 000	29 juill. 2022	Hua Eng Wire & Cable Co Ltd, swap sur rendement total	5 131	(820)
52	29 juill. 2022	Hwasung Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	873	(446)
400	29 juill. 2022	Hypera Sa, swap sur rendement total	3 750	(54)
651	29 juill. 2022	Hyundai Engineering & Const, swap sur rendement total	26 730	(2 678)
110	29 juill. 2022	Hyundai Marine & Fire Ins Co, swap sur rendement total	3 381	(216)
127	29 juill. 2022	Hyundai Mipo Dockyard, swap sur rendement total	11 488	409
2	29 juill. 2022	Hyundai Mobis Co Ltd, swap sur rendement total	395	(8)
11	29 juill. 2022	Hyundai Robotics Co Ltd-, swap sur rendement total	649	(34)
92	29 juill. 2022	Hyundai Steel Co, swap sur rendement total	2 932	(1 016)
400	29 juill. 2022	Ihh Healthcare Bhd, swap sur rendement total	755	(35)
1 248	29 juill. 2022	Ihq Inc, swap sur rendement total	889	(427)
170	29 juill. 2022	Il Dong Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	3 376	(2 299)
104	29 juill. 2022	Il Dong Pharmaceutical Co Lt, swap sur rendement total	3 186	(1 339)
397	29 juill. 2022	Ijin Electric Co Ltd, swap sur rendement total	2 756	(12)
5 700	29 juill. 2022	Inari Amertron Bhd, swap sur rendement total	4 440	(281)
123	29 juill. 2022	Inbody Co Ltd, swap sur rendement total	2 919	(649)
416	29 juill. 2022	Indian Energy Exchange Ltd, swap sur rendement total	1 078	(269)
372	29 juill. 2022	Indian Metals & Ferro Alloy, swap sur rendement total	1 581	(285)
76	29 juill. 2022	Indoco Remedies Ltd, swap sur rendement total	455	9
117	29 juill. 2022	Industrias Romi Sa, swap sur rendement total	352	(100)
4 000	29 juill. 2022	Infortrend Technology Inc, swap sur rendement total	2 550	(226)
62	29 juill. 2022	Inox Leisure Ltd, swap sur rendement total	515	(5)
500	29 juill. 2022	Inspur Software Co Ltd-A, swap sur rendement total	1 366	292
254	29 juill. 2022	Integrated Diagnostics Holdi, swap sur rendement total	284	(30)
47	29 juill. 2022	Interflex Co Ltd, swap sur rendement total	323	(20)
100	29 juill. 2022	Intouch Holdings Pcl, swap sur rendement total	250	(20)
300	29 juill. 2022	Ioi Corp Bhd, swap sur rendement total	337	(43)
419	29 juill. 2022	Isu Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	6 282	(341)
85	29 juill. 2022	It'S Skin Co Ltc -, swap sur rendement total	1 401	(517)
81	29 juill. 2022	J.B. Chemicals & Pharma Ltd, swap sur rendement total	2 080	(111)
236	29 juill. 2022	J.Kumar Infraprojects Ltd, swap sur rendement total	1 100	141
1 981	29 juill. 2022	Jagran Prakashan Ltd, swap sur rendement total	1 611	(352)
9 800	29 juill. 2022	Jasmine Intl Public Co Ltd, swap sur rendement total	1 232	(60)
500	29 juill. 2022	Jiajiayue Group Co Ltd-A, swap sur rendement total	1 371	67
1 500	29 juill. 2022	Jiangsu Jiangnan Water Co-A, swap sur rendement total	2 264	442
1 700	29 juill. 2022	Jiangsu King'S Luck Brewer-A, swap sur rendement total	16 692	1 482
100	29 juill. 2022	Jiangsu Yangnong Chemical -A, swap sur rendement total	2 566	(79)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
400	29 juill. 2022	Jiangsu Zhongnan Construct-A, swap sur rendement total	235	(18)
3	29 juill. 2022	Jin Air Co Ltd, swap sur rendement total	41	(16)
102	29 juill. 2022	Jk Paper Ltd, swap sur rendement total	492	(78)
222	29 juill. 2022	Jm Financial Ltd, swap sur rendement total	221	(21)
800	29 juill. 2022	Joincare Pharmaceutical Gr-A, swap sur rendement total	1 902	60
185	29 juill. 2022	Jw Shinyak Corp, swap sur rendement total	700	(159)
22	29 juill. 2022	Jyp Entertainment Corp, swap sur rendement total	1 054	(108)
37	29 juill. 2022	Kangwon Land Inc, swap sur rendement total	933	(150)
375	29 juill. 2022	Karur Vysya Bank Ltd, swap sur rendement total	275	(5)
2 000	29 juill. 2022	Kee Tai Properties Co Ltd, swap sur rendement total	1 097	(73)
1 100	29 juill. 2022	Kelington Group Bhd, swap sur rendement total	383	-
99	29 juill. 2022	Kginicis Co Ltd, swap sur rendement total	1 248	(383)
41	29 juill. 2022	Kia Motors Corp, swap sur rendement total	3 147	(97)
62	29 juill. 2022	Kirloskar Brothers Ltd, swap sur rendement total	311	35
129	29 juill. 2022	Kiswire Ltd -, swap sur rendement total	2 684	(803)
5 600	29 juill. 2022	Knm Group Bhd, swap sur rendement total	205	(51)
5	29 juill. 2022	Kolon Industries Inc -, swap sur rendement total	259	(99)
499	29 juill. 2022	Korea Aerospace Industries, swap sur rendement total	26 658	(703)
32	29 juill. 2022	Korea Circuit Co Ltd, swap sur rendement total	613	(245)
306	29 juill. 2022	Korea Gas Corporation, swap sur rendement total	12 017	(2 142)
186	29 juill. 2022	Korea Shipbuilding & Offshor-, swap sur rendement total	17 343	(380)
25	29 juill. 2022	Korea Zinc Co Ltd -, swap sur rendement total	12 102	(3 417)
116	29 juill. 2022	Korean Air Lines Co Ltd, swap sur rendement total	2 903	(614)
46	29 juill. 2022	Korean Reinsurance Co, swap sur rendement total	384	(79)
260	29 juill. 2022	Kpr Mill Ltd, swap sur rendement total	2 189	(530)
89	29 juill. 2022	Kss Line Ltd, swap sur rendement total	881	(191)
15	29 juill. 2022	Kt&G Corp, swap sur rendement total	1 224	(78)
326	29 juill. 2022	Ktb Investment & Securities, swap sur rendement total	1 369	(345)
1 200	29 juill. 2022	Kuala Lumpur Kepong Bhd, swap sur rendement total	7 703	(1 335)
87	29 juill. 2022	Kumho Industrial Co Ltd -, swap sur rendement total	680	(167)
85	29 juill. 2022	Kumho Petrochemical Co Ltd, swap sur rendement total	11 732	(2 427)
55	29 juill. 2022	Kumho Tire Co Inc, swap sur rendement total	190	(52)
55	29 juill. 2022	Kyungdong Pharm Co Ltd, swap sur rendement total	454	(137)
8	29 juill. 2022	L&T Technology Services Ltd, swap sur rendement total	396	(70)
400	29 juill. 2022	Laobaixing Pharmacy Chain-A, swap sur rendement total	3 340	186
68	29 juill. 2022	Lf Corp, swap sur rendement total	1 047	(337)
13	29 juill. 2022	Lg Electronics Inc, swap sur rendement total	1 140	(11)
22	29 juill. 2022	Lg Household & Health Care, swap sur rendement total	14 855	(718)
469	29 juill. 2022	Lg International Corp, swap sur rendement total	15 159	(3 464)
47	29 juill. 2022	Lg Uplus Corp, swap sur rendement total	595	(84)
1 100	29 juill. 2022	Lian Hwa Foods Corp, swap sur rendement total	4 222	86
1 000	29 juill. 2022	Lida Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 236	(58)
102	29 juill. 2022	Lig Nex1 Co Ltd, swap sur rendement total	7 272	(1 140)
6 400	29 juill. 2022	Lion Industries Corp Bhd, swap sur rendement total	805	(132)
128	29 juill. 2022	Longtu Korea Inc, swap sur rendement total	592	(170)
2	29 juill. 2022	Lotte Chemical Corp -, swap sur rendement total	357	(26)
7 084	29 juill. 2022	Lotte Chemical Titan Holding, swap sur rendement total	4 083	(197)
48	29 juill. 2022	Lotte Fine Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	3 122	(1 021)
1	29 juill. 2022	Lotte Food Co Ltd, swap sur rendement total	309	(22)
26	29 juill. 2022	Ls Corp -, swap sur rendement total	1 642	(146)
568	29 juill. 2022	Lumax Auto Technologies Ltd, swap sur rendement total	1 673	55
100	29 juill. 2022	Lumax Industries Ltd, swap sur rendement total	2 079	86
1 000	29 juill. 2022	Lung Yen Life Service Corp, swap sur rendement total	1 850	(252)
321	29 juill. 2022	Lutronic Corp, swap sur rendement total	5 466	(2 602)
600	29 juill. 2022	M Dias Branco Sa -, swap sur rendement total	3 860	(367)
1 900	29 juill. 2022	Macquarie Mexico Real Estate, swap sur rendement total	3 063	(207)
34	29 juill. 2022	Maeil Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	309	(50)
800	29 juill. 2022	Magnum Bhd, swap sur rendement total	391	(24)
3 400	29 juill. 2022	Malaysian Bulk Carriers Bhd, swap sur rendement total	363	(88)
200	29 juill. 2022	Malaysian Pacific Industries, swap sur rendement total	1 639	(297)
500	29 juill. 2022	Marcopolo Sa- actions priv., swap sur rendement total	304	(65)
1 300	29 juill. 2022	Marfrig Global Foods Sa, swap sur rendement total	3 880	(1 542)
32	29 juill. 2022	Mas Financial Services Ltd, swap sur rendement total	258	(31)
10 918	29 juill. 2022	Masisa Sa, swap sur rendement total	249	(124)
21	29 juill. 2022	Max Financial Services Ltd, swap sur rendement total	268	(9)
6	29 juill. 2022	Mcnex Co Ltd, swap sur rendement total	186	(57)
15 900	29 juill. 2022	Media Prima Bhd, swap sur rendement total	1 814	(456)
48	29 juill. 2022	Megastudyedu Co Ltd, swap sur rendement total	3 718	(909)
8	29 juill. 2022	Meritz Financial Group Inc, swap sur rendement total	205	(68)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
66	29 juill. 2022	Meritz Fire & Marine Insuran-, swap sur rendement total	2 173	(486)
421	29 juill. 2022	Mirae Asset Life Insurance, swap sur rendement total	1 298	(353)
13 000	29 juill. 2022	Mitac Holdings Corp, swap sur rendement total	15 477	(714)
313	29 juill. 2022	Mk Electron Co Ltd, swap sur rendement total	3 310	(1 459)
107	29 juill. 2022	Moda-Innochips Co Ltd, swap sur rendement total	433	44
33 800	29 juill. 2022	More Return Pcl, swap sur rendement total	2 384	(38)
307	29 juill. 2022	Namhae Chemical Corp, swap sur rendement total	3 030	(1 000)
1	29 juill. 2022	Namyang Dairy Products Co, swap sur rendement total	363	(45)
160	29 juill. 2022	Narayana Hrudayalaya Ltd, swap sur rendement total	1 652	(91)
46	29 juill. 2022	Naver Corp -, swap sur rendement total	10 962	(2 698)
600	29 juill. 2022	Netbay Pcl, swap sur rendement total	535	(65)
4	29 juill. 2022	Netmarble Corp, swap sur rendement total	274	(55)
200	29 juill. 2022	Nhn Corp, swap sur rendement total	5 551	(1 074)
744	29 juill. 2022	Nhpc Ltd, swap sur rendement total	374	(43)
314	29 juill. 2022	Nlc India Ltd, swap sur rendement total	326	(68)
1	29 juill. 2022	Nongshim Co Ltd, swap sur rendement total	266	(22)
874	29 juill. 2022	Nrb Bearings Ltd, swap sur rendement total	1 926	135
1 000	29 juill. 2022	O-Bank Co Ltd, swap sur rendement total	377	(16)
1 000	29 juill. 2022	Obi Pharma Inc, swap sur rendement total	4 229	(582)
1 000	29 juill. 2022	Oneness Biotech Co Ltd, swap sur rendement total	7 612	(903)
100	29 juill. 2022	Opple Lighting Co Ltd-A, swap sur rendement total	336	8
38	29 juill. 2022	Optipharm Co Ltd, swap sur rendement total	309	(108)
4	29 juill. 2022	Orion Corp, swap sur rendement total	413	7
479	29 juill. 2022	Partron Co Ltd, swap sur rendement total	4 019	(1 553)
8	29 juill. 2022	Pearl Abyss Corp, swap sur rendement total	406	(123)
2 700	29 juill. 2022	Petro Rio Sa, swap sur rendement total	14 634	(5 827)
1 100	29 juill. 2022	Petronas Chemicals Group Bhd, swap sur rendement total	2 897	(427)
36	29 juill. 2022	Pharmicell Co Ltd, swap sur rendement total	411	(6)
3 100	29 juill. 2022	Polyplex Pcl, swap sur rendement total	2 560	(316)
13	29 juill. 2022	Poongsan Holdings Corp, swap sur rendement total	331	(81)
2 500	29 juill. 2022	Porto Seguro Sa, swap sur rendement total	11 196	(2 918)
733	29 juill. 2022	Prakash Industries Ltd, swap sur rendement total	606	(115)
106	29 juill. 2022	Prataap Snacks Ltd, swap sur rendement total	1 094	(89)
7 800	29 juill. 2022	Precious Shipping Pcl, swap sur rendement total	5 244	(581)
1 700	29 juill. 2022	Principal Capital Pcl, swap sur rendement total	382	(25)
9	29 juill. 2022	Procter & Gamble Hygiene, swap sur rendement total	1 964	(105)
400	29 juill. 2022	Profarma Distribuidora, swap sur rendement total	329	(86)
12	29 juill. 2022	Pvr Ltd, swap sur rendement total	365	(3)
300	29 juill. 2022	Qingdao Haier Co Ltd-A, swap sur rendement total	1 586	121
400	29 juill. 2022	Qualitas Controladora Sab Cv, swap sur rendement total	2 374	(212)
2 800	29 juill. 2022	Quality Houses Leasehold Pro, swap sur rendement total	1 003	(62)
2 500	29 juill. 2022	Rajthanee Hospital Pcl, swap sur rendement total	3 311	(32)
1 028	29 juill. 2022	Redington India Ltd, swap sur rendement total	2 107	(117)
15 736	29 juill. 2022	Rosseti Pjsc, swap sur rendement total	219	(321)
8 400	29 juill. 2022	Ruentex Development Co Ltd, swap sur rendement total	26 741	(2 070)
500	29 juill. 2022	Rumo Na, swap sur rendement total	1 968	(186)
327	29 juill. 2022	S&T Dynamics Co Ltd, swap sur rendement total	2 315	(585)
213	29 juill. 2022	S&T Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	3 289	(409)
6	29 juill. 2022	S-1 Corporation, swap sur rendement total	382	(68)
1 900	29 juill. 2022	Sahamitr Pressure Container, swap sur rendement total	1 048	(34)
24	29 juill. 2022	Sam Kang M&T Co Ltd, swap sur rendement total	551	(9)
135	29 juill. 2022	Sammok S-Form Co Ltd, swap sur rendement total	2 534	(1 169)
12	29 juill. 2022	Samsung Biologics Co Ltd, swap sur rendement total	9 413	(483)
65	29 juill. 2022	Samsung Electro-Mechanics Co, swap sur rendement total	8 423	(2 055)
460	29 juill. 2022	Samsung Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	9 843	(1 905)
5	29 juill. 2022	Samsung Fire & Marine Ins, swap sur rendement total	998	(26)
3 118	29 juill. 2022	Samsung Heavy Industries, swap sur rendement total	18 793	(293)
34	29 juill. 2022	Samsung Life Insurance Co Lt, swap sur rendement total	2 113	(302)
108	29 juill. 2022	Samsung Sdi Co Ltd -, swap sur rendement total	57 052	(7 200)
850	29 juill. 2022	Sao Martinho Sa, swap sur rendement total	7 626	(3 607)
200	29 juill. 2022	Sarawak Oil Palms Berhad, swap sur rendement total	238	(84)
22	29 juill. 2022	Satrec Initiative Co Ltd, swap sur rendement total	689	(412)
2 800	29 juill. 2022	Sc Asset Corp Pcl, swap sur rendement total	331	(31)
145	29 juill. 2022	Schaeffler India Ltd, swap sur rendement total	5 422	(128)
1 000	29 juill. 2022	Sciencetech Corp, swap sur rendement total	3 188	(798)
185	29 juill. 2022	Seah Besteel Corp -, swap sur rendement total	2 820	(568)
2 000	29 juill. 2022	Senao International Co Ltd, swap sur rendement total	2 871	(84)
1 000	29 juill. 2022	Senhwa Biosciences Inc, swap sur rendement total	3 019	(484)
297	29 juill. 2022	Seowonintech Co Ltd, swap sur rendement total	1 660	(322)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
1 090	29 juill. 2022	Sesoda Corp, swap sur rendement total	2 142	(532)
300	29 juill. 2022	Shandong Hi-Speed Road & B-A, swap sur rendement total	558	48
1 300	29 juill. 2022	Shandong Lukang Pharma-A, swap sur rendement total	1 637	(1)
100	29 juill. 2022	Shanghai Kehua Bio-Enginee-A, swap sur rendement total	153	(154)
100	29 juill. 2022	Shanghai Lingang Holdings-A, swap sur rendement total	261	(13)
7 000	29 juill. 2022	Shin Kong Financial Holding, swap sur rendement total	2 781	(106)
76	29 juill. 2022	Shinsegae Food Co Ltd, swap sur rendement total	4 249	(909)
139	29 juill. 2022	Shinwon Corp, swap sur rendement total	225	(52)
100	29 juill. 2022	Sichuan Kelun Pharmaceutic-A, swap sur rendement total	360	15
404	29 juill. 2022	Signetcs Corp, swap sur rendement total	632	(285)
41	29 juill. 2022	Simmtech Co Ltd, swap sur rendement total	1 504	(589)
23	29 juill. 2022	Sindoh Co Ltd, swap sur rendement total	713	(103)
1 000	29 juill. 2022	Sinon Corp, swap sur rendement total	1 331	(145)
2 000	29 juill. 2022	Sirtec International Co Ltd, swap sur rendement total	2 051	(115)
59	29 juill. 2022	Sk Networks Co Ltd, swap sur rendement total	246	(5)
135	29 juill. 2022	Sk Telecom, swap sur rendement total	6 971	(1 071)
13	29 juill. 2022	Skc Co Ltd, swap sur rendement total	1 717	(411)
30	29 juill. 2022	Skf India Ltd, swap sur rendement total	1 789	(10)
900	29 juill. 2022	Slc Agricola Sa, swap sur rendement total	9 789	(3 635)
65	29 juill. 2022	Sm Culture & Contents Co Ltd, swap sur rendement total	200	(112)
25	29 juill. 2022	Sm Entertainment Co -, swap sur rendement total	1 566	(247)
5 400	29 juill. 2022	Snc Former Pcl, swap sur rendement total	3 433	(431)
1 000	29 juill. 2022	Soft-World Intl Corp, swap sur rendement total	3 340	(267)
18	29 juill. 2022	Solus Advanced Materials Co, swap sur rendement total	806	(451)
6 500	29 juill. 2022	Spcg Pcl, swap sur rendement total	3 753	(433)
12	29 juill. 2022	Sundaytoz Corp, swap sur rendement total	259	(110)
1 000	29 juill. 2022	Sunflower Pharmaceutical-A, swap sur rendement total	3 011	(122)
641	29 juill. 2022	Supreme Petrochem Ltd, swap sur rendement total	9 276	1 494
10 000	29 juill. 2022	Svi Pcl, swap sur rendement total	2 576	(328)
3 000	29 juill. 2022	Synmosa Biopharma Corp, swap sur rendement total	4 300	537
4 400	29 juill. 2022	Ta Ann Holdings Berhad, swap sur rendement total	5 124	(1 334)
2 000	29 juill. 2022	Ta Ya Electric Wire & Cable, swap sur rendement total	2 247	(102)
211	29 juill. 2022	Taeyoung Engineering & Const, swap sur rendement total	1 425	(469)
1 000	29 juill. 2022	Taisol Electronics Co Ltd, swap sur rendement total	1 648	(327)
22 000	29 juill. 2022	Taiwan Business Bank, swap sur rendement total	11 021	(1 018)
12 000	29 juill. 2022	Taiwan Cooperative Financial, swap sur rendement total	13 974	(1 054)
1 000	29 juill. 2022	Taiwan Fertilizer Co Ltd, swap sur rendement total	2 771	(333)
2 000	29 juill. 2022	Taiwan High Speed Rail Corp, swap sur rendement total	2 433	(32)
6 000	29 juill. 2022	Taiwan Mobile Co Ltd, swap sur rendement total	28 105	(722)
1 000	29 juill. 2022	Taiwan Sakura Corp, swap sur rendement total	2 763	(38)
333	29 juill. 2022	Tanla Platforms Ltd, swap sur rendement total	5 462	(1 900)
608	29 juill. 2022	Tata Teleservices Maharashtra, swap sur rendement total	1 202	(65)
2 000	29 juill. 2022	Tatung Co Ltd, swap sur rendement total	2 941	(200)
7	29 juill. 2022	Teamlease Services Ltd, swap sur rendement total	370	(15)
10 000	29 juill. 2022	Teco Electric & Machinery, swap sur rendement total	13 532	(58)
1 000	29 juill. 2022	Test-Rite International Co, swap sur rendement total	995	3
7 000	29 juill. 2022	The Shanghai Commercial & Sa, swap sur rendement total	16 121	363
229	29 juill. 2022	Theragen Etex Co Ltd, swap sur rendement total	905	(325)
100	29 juill. 2022	Thermax Ltd, swap sur rendement total	3 424	105
33 300	29 juill. 2022	Thoresen Thai Agencies Pcl, swap sur rendement total	10 708	(1 977)
4 000	29 juill. 2022	Tipco Foods Pcl, swap sur rendement total	1 315	(50)
3 900	29 juill. 2022	Tks Technologies Pcl, swap sur rendement total	1 411	(281)
300	29 juill. 2022	Tofflon Science & Technolo-A, swap sur rendement total	1 959	56
1 000	29 juill. 2022	Ton Yi Industrial Corp, swap sur rendement total	677	(44)
600	29 juill. 2022	Tonghua Dongbao Pharmaceut-A, swap sur rendement total	1 194	16
1 313	29 juill. 2022	Tongyang Inc, swap sur rendement total	1 480	(418)
56	29 juill. 2022	Tongyang Life Insurance -, swap sur rendement total	318	(25)
124	29 juill. 2022	Transport Corp Of India Ltd, swap sur rendement total	1 367	(155)
4 248	29 juill. 2022	Triveni Engineering & Indus, swap sur rendement total	16 399	(4 284)
300	29 juill. 2022	Truking Technology Ltd-A, swap sur rendement total	1 028	58
3 000	29 juill. 2022	Tsrc Corp, swap sur rendement total	3 858	(133)
609	29 juill. 2022	Tym Corp, swap sur rendement total	1 569	(368)
5	29 juill. 2022	Unid Co Ltd, swap sur rendement total	479	(180)
1 000	29 juill. 2022	Union Bank Of Taiwan, swap sur rendement total	664	3
5 000	29 juill. 2022	Uni-President Enterprises Co, swap sur rendement total	14 529	(323)
12 207	29 juill. 2022	Unisem (M) Berhad, swap sur rendement total	8 215	(1 683)
1 000	29 juill. 2022	Universal Cement, swap sur rendement total	954	(14)
1 000	29 juill. 2022	Userjoy Technology Co Ltd, swap sur rendement total	3 296	(289)
1	29 juill. 2022	Valhi Inc, swap sur rendement total	58	(1)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
2 000	29 juill. 2022	Via Technologies Inc, swap sur rendement total	4 142	(580)
8 700	29 juill. 2022	Vibhavadi Medical Center Pcl, swap sur rendement total	776	(69)
4 200	29 juill. 2022	Vibra Energia Sa, swap sur rendement total	17 298	(4 092)
39	29 juill. 2022	Visaka Industries Ltd, swap sur rendement total	307	(28)
281	29 juill. 2022	Visang Education Inc, swap sur rendement total	1 688	(543)
600	29 juill. 2022	Vitrox Corp Bhd, swap sur rendement total	1 270	(101)
176	29 juill. 2022	Vrl Logistics Ltd, swap sur rendement total	1 797	(95)
10	29 juill. 2022	Vst Tillers Tractors Ltd, swap sur rendement total	414	(14)
1 400	29 juill. 2022	Wasu Media Holding Co Ltd-A, swap sur rendement total	2 148	27
2 200	29 juill. 2022	Wct Holdings Bhd, swap sur rendement total	293	(35)
100	29 juill. 2022	Weg Sa, swap sur rendement total	653	(10)
1 000	29 juill. 2022	Weikeng Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	1 201	(180)
2 000	29 juill. 2022	Winstek Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	4 086	(539)
200	29 juill. 2022	Wiz Solucoes E Corretagem, swap sur rendement total	414	6
937	29 juill. 2022	Wonderla Holidays Ltd, swap sur rendement total	3 594	(113)
327	29 juill. 2022	Wonik Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 235	(440)
10	29 juill. 2022	Wonik Materials Co Ltd, swap sur rendement total	321	(86)
131	29 juill. 2022	Woongjin Co Ltd, swap sur rendement total	185	(115)
3 000	29 juill. 2022	Wt Microelectronics Co Ltd, swap sur rendement total	9 383	(666)
1 600	29 juill. 2022	Wuxi Apptec Co Ltd-A, swap sur rendement total	32 033	2 556
1 000	29 juill. 2022	Xxentria Technology Material, swap sur rendement total	2 767	(200)
7 000	29 juill. 2022	Yc Inox Co Ltd, swap sur rendement total	8 121	(1 441)
3 000	29 juill. 2022	Yieh Phui Enterprise Co Ltd, swap sur rendement total	2 160	(576)
100	29 juill. 2022	Yifeng Pharmacy Chain Co L-A, swap sur rendement total	1 017	244
7 100	29 juill. 2022	Yonghui Superstores Co Ltd-A, swap sur rendement total	5 851	(114)
100	29 juill. 2022	Young Poong Precision Corp, swap sur rendement total	846	(168)
600	29 juill. 2022	Zhejiang Jingxin Pharmaceu-A, swap sur rendement total	1 051	24
2 000	29 juill. 2022	Zhen Ding Technology Holding, swap sur rendement total	9 368	(1 324)
				(209 300)
				(474 223)
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position acheteur		

Swaps d'actions – position vendeur

Dollar australien – taux de swap des acceptations bancaires (BBSW) à 1 mois

(151)	29 juill. 2022	Adairs Ltd, swap sur rendement total	(256)	33
(111)	29 juill. 2022	Adelaide Brighton Ltd, swap sur rendement total	(238)	17
(10 389)	29 juill. 2022	Ama Group Ltd, swap sur rendement total	(1 567)	362
(7 468)	29 juill. 2022	Amp Ltd, swap sur rendement total	(6 326)	928
(71)	29 juill. 2022	Ap Eagers Ltd, swap sur rendement total	(612)	18
(440)	29 juill. 2022	Appen Ltd, swap sur rendement total	(2 190)	328
(31)	29 juill. 2022	Arb Corp Ltd, swap sur rendement total	(777)	(24)
(81)	29 juill. 2022	Baby Bunting Group Ltd, swap sur rendement total	(293)	14
(1 511)	29 juill. 2022	Bank Of Queensland Ltd, swap sur rendement total	(8 940)	759
(404)	29 juill. 2022	Bapcor Ltd, swap sur rendement total	(2 179)	-
(83)	29 juill. 2022	Bendigo And Adelaide Bank, swap sur rendement total	(668)	17
(1 585)	29 juill. 2022	Betmakers Technology Group L, swap sur rendement total	(478)	204
(705)	29 juill. 2022	Brambles Ltd, swap sur rendement total	(6 698)	106
(531)	29 juill. 2022	Bravura Solutions Ltd, swap sur rendement total	(666)	76
(14)	29 juill. 2022	Breville Group Ltd, swap sur rendement total	(223)	4
(516)	29 juill. 2022	Carsales.Com Ltd, swap sur rendement total	(8 417)	684
(219)	29 juill. 2022	Cedar Woods Properties Ltd, swap sur rendement total	(715)	47
(2 289)	29 juill. 2022	Challenger Ltd, swap sur rendement total	(13 888)	788
(520)	29 juill. 2022	Charter Hall Long Wale Reit, swap sur rendement total	(2 005)	165
(333)	29 juill. 2022	Charter Hall Retail Reit, swap sur rendement total	(1 151)	41
(1 035)	29 juill. 2022	Cimic Group Ltd, swap sur rendement total	(20 198)	2
(99)	29 juill. 2022	City Chic Collective Ltd, swap sur rendement total	(161)	44
(134)	29 juill. 2022	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd, swap sur rendement total	(1 765)	123
(1 216)	29 juill. 2022	Clover Corp Ltd, swap sur rendement total	(1 073)	409
(1 440)	29 juill. 2022	Coles Group Ltd, swap sur rendement total	(22 749)	(366)
(35)	29 juill. 2022	Collins Foods Ltd, swap sur rendement total	(308)	6
(362)	29 juill. 2022	Commonwealth Bank Of Austral, swap sur rendement total	(29 022)	348
(874)	29 juill. 2022	Cooper Energy Ltd, swap sur rendement total	(190)	19
(950)	29 juill. 2022	Cromwell Property Group, swap sur rendement total	(650)	7
(57)	29 juill. 2022	Crown Resorts Ltd, swap sur rendement total	(662)	(12)
(875)	29 juill. 2022	Dexus, swap sur rendement total	(7 103)	631
(103)	29 juill. 2022	Domino'S Pizza Enterprises L, swap sur rendement total	(6 213)	65
(549)	29 juill. 2022	Eml Payments Ltd, swap sur rendement total	(599)	108
(295)	29 juill. 2022	Fortescue Metals Group Ltd, swap sur rendement total	(4 587)	677

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(142)	29 juill. 2022	G.U.D. Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 006)	353
(1 182)	29 juill. 2022	Goodman Group, swap sur rendement total	(18 862)	2 084
(188)	29 juill. 2022	Gwa Group Ltd, swap sur rendement total	(328)	14
(143)	29 juill. 2022	Imdex Ltd, swap sur rendement total	(234)	75
(7 196)	29 juill. 2022	Imugene Ltd, swap sur rendement total	(1 149)	94
(157)	29 juill. 2022	Iph Ltd, swap sur rendement total	(1 136)	(85)
(394)	29 juill. 2022	James Hardie Industries-Cdi, swap sur rendement total	(11 208)	692
(55)	29 juill. 2022	Kelsian Group Ltd, swap sur rendement total	(278)	64
(24)	29 juill. 2022	Lovisa Holdings Ltd, swap sur rendement total	(294)	23
(100)	29 juill. 2022	Mcmillan Shakespeare Ltd, swap sur rendement total	(864)	51
(377)	29 juill. 2022	Mineral Resources Ltd, swap sur rendement total	(16 142)	4 620
(3 495)	29 juill. 2022	Mirvac Group, swap sur rendement total	(6 281)	706
(170)	29 juill. 2022	National Australia Bank Ltd, swap sur rendement total	(4 288)	(208)
(6)	29 juill. 2022	Netwealth Group Ltd, swap de rendement total	(65)	-
(74)	29 juill. 2022	Nufarm Ltd, swap de rendement total	(334)	7
(93)	29 juill. 2022	Omni Bridgeway Ltd, swap de rendement total	(293)	(33)
(1 004)	29 juill. 2022	Paladin Energy Ltd, swap de rendement total	(517)	181
(2 004)	29 juill. 2022	Perenti Global Ltd, swap de rendement total	(1 164)	19
(2 370)	29 juill. 2022	Pointsbet Holdings Ltd, swap de rendement total	(5 634)	598
(388)	29 juill. 2022	Polynovo Ltd, swap de rendement total	(466)	(40)
(672)	29 juill. 2022	Ramelius Resources Ltd, swap de rendement total	(519)	169
(68)	29 juill. 2022	Rea Group Ltd, swap de rendement total	(6 745)	(234)
(446)	29 juill. 2022	Reece Ltd, swap de rendement total	(5 452)	470
(2 894)	29 juill. 2022	Reliance Worldwide Corp Ltd, swap de rendement total	(10 371)	(331)
(1 500)	29 juill. 2022	Seek Ltd, swap de rendement total	(27 942)	4 325
(116)	29 juill. 2022	Select Harvests Ltd, swap de rendement total	(484)	97
(173)	29 juill. 2022	Senex Energy Ltd, swap de rendement total	(706)	-
(319)	29 juill. 2022	Service Stream Ltd, swap de rendement total	(248)	18
(1 265)	29 juill. 2022	Shopping Centres Australasia, swap de rendement total	(3 176)	(149)
(1 033)	29 juill. 2022	Sigma Healthcare Ltd, swap de rendement total	(531)	(57)
(615)	29 juill. 2022	Starpharma Holdings Ltd, swap de rendement total	(404)	(11)
(883)	29 juill. 2022	Stockland, swap de rendement total	(2 942)	60
(37)	29 juill. 2022	Suncorp Group Ltd, swap de rendement total	(360)	6
(1 202)	29 juill. 2022	Super Retail Group Ltd, swap de rendement total	(9 052)	785
(630)	29 juill. 2022	Superloop Ltd, swap de rendement total	(402)	43
(903)	29 juill. 2022	Syrah Resources Ltd, swap de rendement total	(989)	365
(1 447)	29 juill. 2022	Telstra Corp Ltd, swap de rendement total	(4 942)	(37)
(46)	29 juill. 2022	Treasury Wine Estates Ltd, swap de rendement total	(463)	17
(828)	29 juill. 2022	Tyro Payments Ltd, swap de rendement total	(441)	313
(2 149)	29 juill. 2022	Woodside Energy Group Ltd, swap de rendement total	(60 695)	(1 767)
(1 286)	29 juill. 2022	Woolworths Group Ltd, swap de rendement total	(40 610)	(1 258)
(3 188)	29 juill. 2022	Worleyparsons Ltd, swap de rendement total	(40 269)	1 481
(196)	29 juill. 2022	Xero Ltd, swap de rendement total	(13 380)	1 728
(5 050)	29 juill. 2022	Zip Co Ltd, swap de rendement total	(1 971)	2 117
				<u>23 993</u>
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
(541)	29 juill. 2022	4D Pharma Plc, swap de rendement total	(141)	137
(112)	29 juill. 2022	Admiral Group Plc, swap de rendement total	(3 937)	(60)
(1 450)	29 juill. 2022	Advanced Medical Solutions, swap de rendement total	(6 701)	139
(493)	29 juill. 2022	Ascential Plc, swap de rendement total	(2 005)	399
(109)	29 juill. 2022	Asos Plc, swap de rendement total	(1 432)	345
(4 052)	29 juill. 2022	Assura Plc, swap de rendement total	(4 201)	347
(658)	29 juill. 2022	Aston Martin Lagonda Global, swap de rendement total	(4 556)	2 849
(559)	29 juill. 2022	Aveva Group Plc, swap de rendement total	(19 712)	303
(6)	29 juill. 2022	Aviva Plc, swap de rendement total	(38)	1
(19)	29 juill. 2022	Avon Rubber Plc, swap de rendement total	(293)	51
(724)	29 juill. 2022	Barclays Plc, swap de rendement total	(1 737)	182
(884)	29 juill. 2022	Batm Advanced Communications, swap de rendement total	(479)	97
(52)	29 juill. 2022	Beazley Plc, swap de rendement total	(406)	(10)
(45)	29 juill. 2022	Berkeley Group Holdings/The, swap de rendement total	(2 625)	64
(411)	29 juill. 2022	Bhp Group Ltd-Di, swap de rendement total	(14 790)	(134)
(6 813)	29 juill. 2022	Boohoo Group Plc, swap de rendement total	(5 862)	3 208
(892)	29 juill. 2022	Breedon Group Plc, swap de rendement total	(795)	184
(24)	29 juill. 2022	Bunzl Plc, swap de rendement total	(1 038)	(58)
(548)	29 juill. 2022	Cairn Homes Plc, swap de rendement total	(732)	51
(93)	29 juill. 2022	Caretech Holdings Plc, swap de rendement total	(1 080)	(86)
(100)	29 juill. 2022	Chesnara Plc, swap de rendement total	(439)	21
(46)	29 juill. 2022	Clarkson Plc, swap de rendement total	(2 169)	70

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(140)	29 juill. 2022	Close Brothers Group Plc, swap de rendement total	(2 248)	141
(652)	29 juill. 2022	Convatec Group Plc, swap de rendement total	(2 292)	(117)
(1 874)	29 juill. 2022	Costain Group Plc, swap de rendement total	(1 004)	142
(1 839)	29 juill. 2022	Countryside Properties Plc, swap de rendement total	(7 145)	876
(362)	29 juill. 2022	De La Rue Plc, swap de rendement total	(441)	91
(7)	29 juill. 2022	Dechra Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	(379)	(28)
(216)	29 juill. 2022	Dignity Plc, swap sur rendement total	(1 367)	256
(402)	29 juill. 2022	Diversified Energy Co Plc, swap sur rendement total	(702)	54
(665)	29 juill. 2022	Dominos Pizza Group Plc, swap sur rendement total	(2 909)	572
(143)	29 juill. 2022	Ds Smith Plc, swap sur rendement total	(621)	47
(299)	29 juill. 2022	Dunelm Group Plc, swap sur rendement total	(3 843)	(12)
(3 880)	29 juill. 2022	Easyjet Plc, swap sur rendement total	(22 283)	5 809
(225)	29 juill. 2022	Energean Plc, swap sur rendement total	(3 874)	525
(79)	29 juill. 2022	Essentra Plc, swap sur rendement total	(308)	36
(10)	29 juill. 2022	First Derivatives Plc, swap sur rendement total	(308)	33
(402)	29 juill. 2022	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(51 918)	9 484
(827)	29 juill. 2022	Foxtons Group Plc, swap sur rendement total	(426)	63
(98)	29 juill. 2022	Frasers Group Plc, swap sur rendement total	(1 022)	36
(398)	29 juill. 2022	Future Plc, swap sur rendement total	(10 743)	713
(38)	29 juill. 2022	Gb Group Plc, swap sur rendement total	(239)	61
(49)	29 juill. 2022	Genuit Group Plc, swap sur rendement total	(294)	56
(79)	29 juill. 2022	Grainger Plc, swap sur rendement total	(351)	27
(67)	29 juill. 2022	Great Portland Estates Plc, swap sur rendement total	(610)	59
(1 667)	29 juill. 2022	Greatland Gold Plc, swap sur rendement total	(243)	41
(1 139)	29 juill. 2022	Gym Group Plc/The, swap sur rendement total	(3 394)	552
(25)	29 juill. 2022	Hill & Smith Holdings Plc, swap sur rendement total	(461)	84
(21)	29 juill. 2022	Homeserve Plc, swap sur rendement total	(386)	(3)
(1 699)	29 juill. 2022	Hyve Group Plc, swap sur rendement total	(1 964)	374
(108)	29 juill. 2022	Ig Design Group Plc, swap sur rendement total	(144)	(64)
(233)	29 juill. 2022	Imperial Brands Plc, swap sur rendement total	(6 702)	(161)
(6 366)	29 juill. 2022	Itm Power Plc, swap sur rendement total	(17 233)	12 175
(11 845)	29 juill. 2022	Itv Plc, swap sur rendement total	(12 110)	885
(65)	29 juill. 2022	James Fisher & Sons Plc, swap sur rendement total	(296)	70
(7 094)	29 juill. 2022	Jd Sports Fashion Plc, swap sur rendement total	(12 825)	815
(1 884)	29 juill. 2022	John Wood Group Plc, swap sur rendement total	(4 604)	2 374
(1 646)	29 juill. 2022	Jubilee Metals Group Plc, swap sur rendement total	(366)	17
(8 619)	29 juill. 2022	Legal & General Group Plc, swap sur rendement total	(32 338)	2 528
(1 161)	29 juill. 2022	Lloyds Banking Group Plc, swap sur rendement total	(770)	42
(89)	29 juill. 2022	Londonmetric Property Plc, swap sur rendement total	(322)	10
(2 643)	29 juill. 2022	M&G Plc, swap sur rendement total	(8 057)	734
(1 310)	29 juill. 2022	Marks & Spencer Group Plc, swap sur rendement total	(2 781)	87
(679)	29 juill. 2022	Marshalls Plc, swap sur rendement total	(4 868)	788
(76)	29 juill. 2022	Mondi Plc, swap sur rendement total	(1 732)	67
(769)	29 juill. 2022	National Express Group Plc, swap sur rendement total	(2 342)	848
(397)	29 juill. 2022	Next Plc, swap sur rendement total	(36 445)	3 307
(443)	29 juill. 2022	Ninety One Plc, swap sur rendement total	(1 372)	186
(985)	29 juill. 2022	Ocado Group Plc, swap sur rendement total	(12 055)	1 932
(11 030)	29 juill. 2022	Old Mutual Ltd, swap sur rendement total	(9 590)	1 510
(759)	29 juill. 2022	On The Beach Group Plc, swap sur rendement total	(1 693)	699
(87)	29 juill. 2022	Onesavings Bank Plc, swap sur rendement total	(654)	61
(66)	29 juill. 2022	Oxford Biomedica Plc, swap sur rendement total	(469)	57
(189)	29 juill. 2022	Pagegroup Plc, swap sur rendement total	(1 183)	161
(173)	29 juill. 2022	Pennon Group Plc, swap sur rendement total	(2 581)	208
(58)	29 juill. 2022	Persimmon Plc, swap sur rendement total	(1 793)	259
(167)	29 juill. 2022	Pets At Home Group Plc, swap sur rendement total	(823)	(3)
(6 065)	29 juill. 2022	Phoenix Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(56 096)	4 499
(291)	29 juill. 2022	Plus500 Ltd, swap sur rendement total	(7 629)	(508)
(326)	29 juill. 2022	Premier Miton Group Plc, swap sur rendement total	(613)	22
(8 974)	29 juill. 2022	Quilter Plc, swap sur rendement total	(14 410)	2 496
(3 557)	29 juill. 2022	Restaurant Group Plc, swap sur rendement total	(2 482)	486
(29)	29 juill. 2022	Rhi Magnesita Nv, swap sur rendement total	(905)	191
(1 481)	29 juill. 2022	Rws Holdings Plc, swap sur rendement total	(8 038)	1 123
(333)	29 juill. 2022	S4 Capital Plc, swap sur rendement total	(1 196)	222
(1)	29 juill. 2022	Saga Plc, swap sur rendement total	(3)	1
(825)	29 juill. 2022	Sainsbury (J) Plc, swap sur rendement total	(2 765)	160
(413)	29 juill. 2022	Segro Plc, swap de rendement total	(6 320)	169
(23)	29 juill. 2022	Severn Trent Plc, swap de rendement total	(1 002)	18
(19)	29 juill. 2022	Softcat Plc, swap de rendement total	(392)	24
(172)	29 juill. 2022	Sse Plc, swap de rendement total	(4 354)	48

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(2 511)	29 juill. 2022	St James'S Place Plc, swap de rendement total	(43 369)	7 327
(8 038)	29 juill. 2022	Stobart Group Ltd, swap de rendement total	(1 184)	(86)
(264)	29 juill. 2022	Strix Group Plc, swap de rendement total	(691)	116
(500)	29 juill. 2022	Sylvania Platinum Ltd, swap de rendement total	(689)	14
(289)	29 juill. 2022	Synthomer Plc, swap de rendement total	(1 115)	309
(5 702)	29 juill. 2022	Tesco Plc, swap de rendement total	(22 823)	315
(144)	29 juill. 2022	Tp Icap Plc, swap de rendement total	(253)	39
(88)	29 juill. 2022	Trainline Plc, swap de rendement total	(397)	24
(61)	29 juill. 2022	Travis Perkins Plc, swap de rendement total	(925)	167
(373)	29 juill. 2022	United Utilities Group Plc, swap de rendement total	(6 130)	(41)
(208)	29 juill. 2022	Vesuvius Plc, swap de rendement total	(991)	132
(3 001)	29 juill. 2022	Virgin Money Uk Plc, swap de rendement total	(6 147)	800
(459)	29 juill. 2022	Watkin Jones Plc, swap de rendement total	(1 582)	(10)
(854)	29 juill. 2022	Wizz Air Holdings Plc, swap de rendement total	(23 466)	13 763
(67)	29 juill. 2022	Woodside Energy Group, swap de rendement total	(1 826)	(1 826)
(175)	29 juill. 2022	Xps Pensions Group Plc, swap de rendement total	(356)	18
(534)	29 juill. 2022	Zotefoams Plc, swap de rendement total	(2 259)	286
				87 962
Euro – taux à court terme (ESTR)				
(12)	29 juill. 2022	1&1 Ag, swap sur rendement total	(289)	24
(21)	29 juill. 2022	Aareal Bank Ag, swap sur rendement total	(809)	115
(501)	29 juill. 2022	Abn Amro Bank Nv-Cva, swap sur rendement total	(7 239)	122
(3)	29 juill. 2022	Acciona Sa, swap sur rendement total	(710)	15
(518)	29 juill. 2022	Accor Sa, swap sur rendement total	(18 044)	2 892
(36)	29 juill. 2022	Ackermans & Van Haaren, swap sur rendement total	(6 918)	552
(23)	29 juill. 2022	Ado Properties Sa, swap sur rendement total	(117)	25
(148)	29 juill. 2022	Adp, swap sur rendement total	(24 120)	3 598
(6 810)	29 juill. 2022	Aegon Nv, swap sur rendement total	(38 737)	6 876
(4)	29 juill. 2022	Aena Sme Sa, swap sur rendement total	(654)	112
(231)	29 juill. 2022	Ageas, swap sur rendement total	(13 078)	1 461
(2 481)	29 juill. 2022	Air France-Klm, swap sur rendement total	(3 739)	445
(17)	29 juill. 2022	Airbus Se, swap sur rendement total	(2 119)	335
(203)	29 juill. 2022	Akzo Nobel N.V., swap sur rendement total	(17 143)	4 820
(81)	29 juill. 2022	Albioma Sa, swap sur rendement total	(5 449)	(5)
(319)	29 juill. 2022	Almirall Sa, swap sur rendement total	(4 551)	(96)
(26)	29 juill. 2022	Altearea, swap sur rendement total	(4 579)	315
(8)	29 juill. 2022	Alten Sa, swap sur rendement total	(1 120)	117
(22)	29 juill. 2022	Amg Advanced Metallurgical, swap sur rendement total	(730)	269
(5 725)	29 juill. 2022	Amper Sa, swap sur rendement total	(1 563)	350
(80)	29 juill. 2022	Applus Services Sa, swap sur rendement total	(712)	40
(521)	29 juill. 2022	Arcelormittal, swap sur rendement total	(15 113)	1 180
(78)	29 juill. 2022	Arkema, swap sur rendement total	(8 933)	2 220
(53)	29 juill. 2022	Aroundtown Sa, swap sur rendement total	(233)	46
(153)	29 juill. 2022	Asr Nederland Nv, swap sur rendement total	(7 958)	745
(421)	29 juill. 2022	Atos Se, swap sur rendement total	(7 259)	5 867
(198)	29 juill. 2022	Atresmedia Corp De Medios De, swap sur rendement total	(880)	160
(718)	29 juill. 2022	Audax Renovables Sa, swap sur rendement total	(1 100)	113
(2)	29 juill. 2022	Aurubis Ag, swap sur rendement total	(175)	59
(150)	29 juill. 2022	Basf Se, swap sur rendement total	(8 400)	1 746
(14)	29 juill. 2022	Bayerische Motoren Werke Ag, swap sur rendement total	(1 387)	128
(402)	29 juill. 2022	Be Semiconductor Industries, swap sur rendement total	(24 867)	5 737
(108)	29 juill. 2022	Bechtle Ag, swap sur rendement total	(5 682)	236
(80)	29 juill. 2022	Biomérieux, swap sur rendement total	(10 055)	420
(1 137)	29 juill. 2022	Bouygues Sa, swap sur rendement total	(45 019)	3 894
(601)	29 juill. 2022	Bpost Sa, swap sur rendement total	(4 567)	150
(20)	29 juill. 2022	Ca Immobilien Anlagen Ag, swap sur rendement total	(816)	17
(38)	29 juill. 2022	Caverion Oyj, swap sur rendement total	(226)	15
(1 285)	29 juill. 2022	Cellnex Telecom Sa, swap sur rendement total	(64 170)	7 063
(2 484)	29 juill. 2022	Cgg Sa, swap sur rendement total	(2 779)	782
(44)	29 juill. 2022	Cofinimmo, swap sur rendement total	(6 147)	893
(234)	29 juill. 2022	Colruyt Sa, swap sur rendement total	(8 189)	910
(164)	29 juill. 2022	Compugroup Medical Se, swap sur rendement total	(8 988)	2 575
(7)	29 juill. 2022	Construcc Y Aux De Ferrocarr, swap sur rendement total	(265)	14
(23)	29 juill. 2022	Corbion Nv, swap sur rendement total	(895)	121
(484)	29 juill. 2022	Covestro Ag, swap sur rendement total	(21 526)	6 199
(351)	29 juill. 2022	Crédit Agricole Sa, swap sur rendement total	(4 133)	741
(23)	29 juill. 2022	Cropenergies Ag, swap sur rendement total	(394)	(77)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(4)	29 juill. 2022	Cts Eventim Ag & Co Kгаа, swap sur rendement total	(270)	47
(8)	29 juill. 2022	Dassault Systemes Sa, swap sur rendement total	(379)	4
(100)	29 juill. 2022	Datagroup Se, swap sur rendement total	(9 251)	335
(31)	29 juill. 2022	Delivery Hero Se, swap sur rendement total	(1 495)	110
(90)	29 juill. 2022	Deutsche Euroshop Ag, swap sur rendement total	(2 694)	(16)
(57)	29 juill. 2022	Deutsche Pfandbriefbank Ag, swap sur rendement total	(660)	128
(331)	29 juill. 2022	Deutsche Wohnen Se, swap sur rendement total	(9 794)	1 566
(100)	29 juill. 2022	Draegerwerk Ag - Pref, swap sur rendement total	(6 696)	(100)
(970)	29 juill. 2022	E.On Se, swap sur rendement total	(10 475)	1 602
(49)	29 juill. 2022	Ebro Foods Sa, swap sur rendement total	(1 064)	26
(509)	29 juill. 2022	Edenred, swap sur rendement total	(30 869)	568
(209)	29 juill. 2022	Eiffage, swap sur rendement total	(24 206)	1 711
(4)	29 juill. 2022	Elia Group Sa/Nv, swap sur rendement total	(729)	36
(239)	29 juill. 2022	Elis Sa, swap sur rendement total	(4 093)	640
(15)	29 juill. 2022	Encavis Ag, swap sur rendement total	(353)	54
(1 560)	29 juill. 2022	Endesa Sa, swap sur rendement total	(39 840)	3 454
(100)	29 juill. 2022	Enento Group Oyj, swap sur rendement total	(2 798)	352
(4)	29 juill. 2022	Energiekontor Ag, swap sur rendement total	(415)	61
(225)	29 juill. 2022	Engie, swap sur rendement total	(3 327)	325
(38)	29 juill. 2022	Essilorluxottica, swap sur rendement total	(7 323)	171
(83)	29 juill. 2022	Euronav Nv, swap sur rendement total	(1 286)	39
(3)	29 juill. 2022	Euronext Nv, swap sur rendement total	(315)	(8)
(60)	29 juill. 2022	Eutelsat Communications, swap sur rendement total	(869)	21
(82)	29 juill. 2022	Evonik Industries Ag, swap sur rendement total	(2 251)	519
(121)	29 juill. 2022	Faes Farma Sa, swap sur rendement total	(633)	21
(13)	29 juill. 2022	Fagron, swap sur rendement total	(271)	15
(124)	29 juill. 2022	Fielmann Ag, swap sur rendement total	(7 943)	432
(47)	29 juill. 2022	Flow Traders, swap sur rendement total	(1 732)	120
(100)	29 juill. 2022	Flughafen Wien Ag, swap sur rendement total	(4 417)	(827)
(17)	29 juill. 2022	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(2 212)	275
(521)	29 juill. 2022	Fortum Oyj, swap sur rendement total	(10 058)	1 888
(350)	29 juill. 2022	Freenet Ag, swap sur rendement total	(11 172)	261
(16)	29 juill. 2022	Galapagos Nv, swap sur rendement total	(1 144)	(23)
(208)	29 juill. 2022	Galp Energia Sgps Sa, swap sur rendement total	(3 137)	217
(217)	29 juill. 2022	Gaztransport Et Techniga Sa, swap sur rendement total	(34 971)	701
(60)	29 juill. 2022	Global Dominion Access Sa, swap sur rendement total	(336)	(4)
(337)	29 juill. 2022	Hamborner Reit Ag, swap sur rendement total	(3 881)	55
(13)	29 juill. 2022	Hamburger Hafen Und Logistik, swap sur rendement total	(237)	32
(54)	29 juill. 2022	Heineken Holding Nv, swap sur rendement total	(5 058)	307
(157)	29 juill. 2022	Heineken Nv, swap sur rendement total	(18 420)	1 414
(198)	29 juill. 2022	Hella Gmbh & Co Kгаа, swap sur rendement total	(17 183)	723
(100)	29 juill. 2022	Home24 Se, swap sur rendement total	(484)	191
(10)	29 juill. 2022	Huhtamaki Oyj, swap sur rendement total	(510)	(25)
(21)	29 juill. 2022	Hypoport Ag, swap sur rendement total	(5 355)	1 681
(145)	29 juill. 2022	Icade, swap sur rendement total	(9 101)	1 377
(1)	29 juill. 2022	Id Logistics Group, swap sur rendement total	(357)	(20)
(40)	29 juill. 2022	Imerys Sa, swap sur rendement total	(1 568)	67
(6)	29 juill. 2022	Interparfums Sa, swap sur rendement total	(365)	62
(188)	29 juill. 2022	Intertrust Nv, swap sur rendement total	(4 853)	38
(9)	29 juill. 2022	Ipsen, swap sur rendement total	(1 093)	(18)
(117)	29 juill. 2022	Ipsos, swap sur rendement total	(7 148)	(16)
(483)	29 juill. 2022	Irish Residential Properties, swap sur rendement total	(825)	64
(123)	29 juill. 2022	Jenoptik Ag, swap sur rendement total	(3 530)	715
(1 371)	29 juill. 2022	Just Eat Takeaway.Com Nv, swap sur rendement total	(27 856)	10 566
(73)	29 juill. 2022	K+S Ag- actions ord., swap sur rendement total	(2 283)	180
(122)	29 juill. 2022	Kaufman & Broad Sa, swap sur rendement total	(4 278)	373
(29)	29 juill. 2022	Kering, swap sur rendement total	(19 167)	345
(17)	29 juill. 2022	Kion Group Ag, swap sur rendement total	(908)	36
(94)	29 juill. 2022	Klepierre, swap sur rendement total	(2 327)	308
(18)	29 juill. 2022	Kojamo Oyj, swap sur rendement total	(400)	30
(1)	29 juill. 2022	Korian, swap sur rendement total	(20)	1
(21)	29 juill. 2022	Kws Saat Se & Co Kгаа, swap sur rendement total	(1 600)	139
(250)	29 juill. 2022	La Française Des Jeux Saem, swap sur rendement total	(11 133)	239
(40)	29 juill. 2022	Lagardere Sca, swap sur rendement total	(885)	463
(50)	29 juill. 2022	Lassila & Tikanoja Oyj, swap sur rendement total	(724)	(7)
(84)	29 juill. 2022	Leg Immobilien Ag, swap sur rendement total	(8 963)	1 498
(93)	29 juill. 2022	Lna Sante, swap sur rendement total	(4 227)	481
(101)	29 juill. 2022	Maisons Du Monde Sa, swap sur rendement total	(1 294)	184
(373)	29 juill. 2022	Mcphey Energy Sa, swap sur rendement total	(6 444)	1 214

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(8)	29 juill. 2022	Melexis Nv, swap sur rendement total	(738)	70
(324)	29 juill. 2022	Mercialys, swap sur rendement total	(3 369)	589
(704)	29 juill. 2022	Metrovacesa Sa, swap sur rendement total	(6 427)	274
(21)	29 juill. 2022	Miquel Y Costas, swap sur rendement total	(368)	(3)
(8)	29 juill. 2022	Mtu Aero Engines Ag, swap sur rendement total	(1 874)	104
(527)	29 juill. 2022	Neinor Homes Sa, swap sur rendement total	(8 500)	(572)
(62)	29 juill. 2022	Neste Oyj, swap sur rendement total	(3 532)	118
(63)	29 juill. 2022	Nos Sgps, swap sur rendement total	(326)	10
(55)	29 juill. 2022	Oesterreichische Post Ag, swap sur rendement total	(2 017)	83
(188)	29 juill. 2022	Ohb Se, swap sur rendement total	(8 798)	22
(1 441)	29 juill. 2022	Orange, swap sur rendement total	(21 804)	693
(487)	29 juill. 2022	Oriola Corp -B, swap sur rendement total	(1 245)	132
(8)	29 juill. 2022	Orpea, swap sur rendement total	(251)	9
(111)	29 juill. 2022	Pharma Mar Sa, swap sur rendement total	(10 074)	742
(144)	29 juill. 2022	Plastic Omnium, swap sur rendement total	(3 210)	169
(36)	29 juill. 2022	Pne Ag, swap sur rendement total	(645)	(5)
(748)	29 juill. 2022	Prosegur Cash Sa, swap sur rendement total	(627)	100
(309)	29 juill. 2022	Prosiebensat.1 Media Se, swap sur rendement total	(3 671)	520
(114)	29 juill. 2022	Publicis Groupe, swap sur rendement total	(7 173)	(20)
(28)	29 juill. 2022	Qiagen N.V., swap sur rendement total	(1 688)	(51)
(289)	29 juill. 2022	Randstad Nv, swap sur rendement total	(18 006)	2 250
(146)	29 juill. 2022	Rexel Sa, swap sur rendement total	(2 889)	972
(1)	29 juill. 2022	Robertet Sa, swap sur rendement total	(1 150)	72
(72)	29 juill. 2022	Rtl Group, swap sur rendement total	(3 868)	300
(7)	29 juill. 2022	Rwe Ag, swap sur rendement total	(331)	25
(53)	29 juill. 2022	S.O.I.T.E.C., swap sur rendement total	(9 685)	2 113
(3)	29 juill. 2022	Sartorius Stedim Biotech, swap sur rendement total	(1 211)	(79)
(1 409)	29 juill. 2022	Sbm Offshore Nv, swap sur rendement total	(24 578)	3 417
(19)	29 juill. 2022	Scout24 Ag, swap sur rendement total	(1 255)	72
(59)	29 juill. 2022	Seb Sa, swap sur rendement total	(7 284)	469
(7)	29 juill. 2022	Secunet Security Networks Ag, swap sur rendement total	(2 667)	435
(378)	29 juill. 2022	Ses, swap sur rendement total	(4 252)	272
(2)	29 juill. 2022	Siemens Ag- actions ord., swap sur rendement total	(262)	27
(10)	29 juill. 2022	Siltronic Ag, swap sur rendement total	(956)	223
(180)	29 juill. 2022	Sligro Food Group Nv, swap sur rendement total	(4 389)	426
(25)	29 juill. 2022	Societe Bic Sa, swap sur rendement total	(1 760)	32
(47)	29 juill. 2022	Sodexo Sa, swap sur rendement total	(4 250)	127
(156)	29 juill. 2022	Solaria Energia Y Medio Ambi, swap sur rendement total	(4 260)	299
(3 671)	29 juill. 2022	Solocal Group, swap sur rendement total	(4 753)	255
(228)	29 juill. 2022	Solutions 30 Se, swap sur rendement total	(1 103)	574
(30)	29 juill. 2022	Solvay Sa, swap sur rendement total	(3 128)	373
(2)	29 juill. 2022	Somfy Sa, swap sur rendement total	(334)	33
(50)	29 juill. 2022	Stratec Se, swap sur rendement total	(5 880)	1 110
(18)	29 juill. 2022	Stroer Se & Co Kгаа, swap sur rendement total	(1 041)	202
(456)	29 juill. 2022	Suominen Oyj, swap sur rendement total	(1 839)	229
(14)	29 juill. 2022	Symrise Ag, swap sur rendement total	(1 961)	(52)
(635)	29 juill. 2022	Tag Immobilien Ag, swap sur rendement total	(9 326)	4 944
(302)	29 juill. 2022	Talgo Sa, swap sur rendement total	(1 305)	251
(64)	29 juill. 2022	Tecnicas Reunidas Sa, swap sur rendement total	(608)	231
(560)	29 juill. 2022	Telefonica Sa, swap sur rendement total	(3 672)	(24)
(34)	29 juill. 2022	Teleperformance, swap sur rendement total	(13 448)	443
(101)	29 juill. 2022	Télévision Française (T.F.1), swap sur rendement total	(920)	120
(40)	29 juill. 2022	Thales Sa, swap sur rendement total	(6 314)	(171)
(1 346)	29 juill. 2022	Thyssenkrupp Ag, swap sur rendement total	(9 820)	6 366
(6)	29 juill. 2022	Trigano Sa, swap sur rendement total	(756)	177
(252)	29 juill. 2022	Uniper Se, swap sur rendement total	(4 816)	3 294
(44)	29 juill. 2022	United Internet Ag- actions ord., swap sur rendement total	(1 616)	172
(23)	29 juill. 2022	Verallia, swap sur rendement total	(707)	82
(24)	29 juill. 2022	Verbio Vereinigte Bioenergi, swap sur rendement total	(1 554)	27
(5)	29 juill. 2022	Vib Vermoegen Ag, swap sur rendement total	(162)	31
(8)	29 juill. 2022	Vicat, swap sur rendement total	(284)	12
(783)	29 juill. 2022	Vivendi, swap sur rendement total	(10 238)	1 423
(35)	29 juill. 2022	Volitalia Sa- actions ord., swap sur rendement total	(902)	103
(1 037)	29 juill. 2022	Vonovia Se, swap sur rendement total	(41 115)	7 809
(25)	29 juill. 2022	Vopak, swap sur rendement total	(812)	35
(10)	29 juill. 2022	Wacker Chemie Ag, swap sur rendement total	(1 856)	416
(194)	29 juill. 2022	Warehouses De Pauw Sca, swap sur rendement total	(7 849)	882
(110)	29 juill. 2022	Westwing Group Ag, swap sur rendement total	(1 053)	281
(20)	29 juill. 2022	Wolters Kluwer, swap sur rendement total	(2 496)	(177)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(45)	29 juill. 2022	Worldline Sa, swap sur rendement total	(2 147)	34
(5)	29 juill. 2022	Zalando Se, swap sur rendement total	(168)	32
(135)	29 juill. 2022	Zeal Network Se, swap sur rendement total	(6 827)	287
				145 994
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
(15 000)	29 juill. 2022	Agricultural Bank Of China-H, swap de rendement total	(7 299)	61
(4 000)	29 juill. 2022	Ak Medical Holdings Ltd, swap de rendement total	(3 883)	(818)
(10 500)	29 juill. 2022	A-Living Smart City Services, swap de rendement total	(22 491)	(877)
(4 000)	29 juill. 2022	Anhui Conch Cement Co Ltd-H, swap de rendement total	(22 357)	1 968
(2 400)	29 juill. 2022	Ascentage Pharma Group Inter, swap de rendement total	(8 404)	(1 533)
(1 900)	29 juill. 2022	Asm Pacific Technology, swap de rendement total	(20 817)	1 259
(15 002)	29 juill. 2022	Avichina Industry & Tech-H, swap de rendement total	(11 073)	75
(5 000)	29 juill. 2022	Bbmg Corp-H, swap de rendement total	(1 022)	(78)
(1 000)	29 juill. 2022	Beijing Chunlizhengda Medi-H, swap de rendement total	(2 234)	(818)
(12 000)	29 juill. 2022	Beijing Enterprises Water Gr, swap de rendement total	(4 675)	454
(2 000)	29 juill. 2022	Beijing Tong Ren Tang Chines, swap de rendement total	(4 162)	(769)
(300)	29 juill. 2022	Boc Aviation Ltd, swap de rendement total	(3 252)	(56)
(14 000)	29 juill. 2022	Brilliance China Automotive, swap de rendement total	(16 801)	(8 945)
(100)	29 juill. 2022	Budweiser Brewing Co Apac Lt, swap de rendement total	(386)	(17)
(200)	29 juill. 2022	Cansino Biologics Inc-H, swap de rendement total	(2 642)	(40)
(2)	29 juill. 2022	Canvest Environmental Protec, swap de rendement total	(1)	-
(1 000)	29 juill. 2022	Cathay Pacific Airways, swap de rendement total	(1 412)	(70)
(2 517)	29 juill. 2022	Central China Real Estate, swap de rendement total	(313)	(65)
(12 000)	29 juill. 2022	Cgn New Energy Holdings Co L, swap de rendement total	(7 299)	359
(1 000)	29 juill. 2022	Champion Reit, swap de rendement total	(574)	25
(3 500)	29 juill. 2022	China Aircraft Leasing Group, swap de rendement total	(3 044)	(109)
(4 000)	29 juill. 2022	China Aoyuan Group Ltd, swap de rendement total	(776)	-
(1 000)	29 juill. 2022	China Citic Bank Corp Ltd-H, swap de rendement total	(627)	(2)
(12 000)	29 juill. 2022	China Coal Energy Co-H, swap de rendement total	(13 712)	534
(2 500)	29 juill. 2022	China Conch Venture Holdings, swap de rendement total	(7 315)	1 056
(11 000)	29 juill. 2022	China Construction Bank-H, swap de rendement total	(10 188)	373
(2 000)	29 juill. 2022	China Eastern Airlines Co-H, swap sur rendement total	(990)	(93)
(13 000)	29 juill. 2022	China Everbright Intl Ltd, swap sur rendement total	(9 895)	193
(500)	29 juill. 2022	China Galaxy Securities Co-H, swap sur rendement total	(372)	(16)
(8 802)	29 juill. 2022	China Gas Holdings Ltd, swap sur rendement total	(17 537)	(601)
(400)	29 juill. 2022	China International Capita-H, swap sur rendement total	(1 119)	(137)
(400)	29 juill. 2022	China International Marine-H, swap sur rendement total	(836)	1
(20 000)	29 juill. 2022	China Jinmao Holdings Group, swap sur rendement total	(6 937)	33
(4 000)	29 juill. 2022	China Longyuan Power Group-H, swap sur rendement total	(10 065)	981
(3 000)	29 juill. 2022	China Medical System Holding, swap sur rendement total	(6 036)	(334)
(29 998)	29 juill. 2022	China Molybdenum Co Ltd-H, swap sur rendement total	(21 951)	(2 868)
(4 000)	29 juill. 2022	China National Building Ma-H, swap sur rendement total	(5 510)	877
(2 000)	29 juill. 2022	China Overseas Grand Oceans, swap sur rendement total	(1 470)	(148)
(9 895)	29 juill. 2022	China Petroleum & Chemical-H, swap sur rendement total	(5 742)	275
(5 000)	29 juill. 2022	China Power International, swap sur rendement total	(4 093)	(805)
(2 000)	29 juill. 2022	China Railway Group Ltd-H, swap sur rendement total	(1 595)	191
(500)	29 juill. 2022	China Renaissance Holdings L, swap sur rendement total	(809)	(5)
(16 000)	29 juill. 2022	China Resources Cement, swap sur rendement total	(14 598)	1 736
(1 700)	29 juill. 2022	China Resources Gas Group Lt, swap sur rendement total	(10 527)	(847)
(500)	29 juill. 2022	China Resources Pharmaceutical, swap sur rendement total	(450)	(36)
(1 500)	29 juill. 2022	China Shenhua Energy Co-H, swap sur rendement total	(6 174)	247
(6 000)	29 juill. 2022	China Southern Airlines Co-H, swap sur rendement total	(4 478)	(346)
(27 000)	29 juill. 2022	China Suntien Green Energy-H, swap sur rendement total	(18 495)	1 699
(1 200)	29 juill. 2022	China Zhongwang Holdings Ltd, swap sur rendement total	(331)	-
(1 000)	29 juill. 2022	Chow Tai Fook Jewellery Grou, swap sur rendement total	(2 426)	(194)
(2 000)	29 juill. 2022	C-Mer Eye Care Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 614)	(130)
(4 000)	29 juill. 2022	Comba Telecom Systems Holdin, swap sur rendement total	(881)	(20)
(85 000)	29 juill. 2022	Cosco Shipping Development-H, swap sur rendement total	(21 938)	562
(4 000)	29 juill. 2022	Cosco Shipping Energy Tran-H, swap sur rendement total	(3 288)	-
(4 500)	29 juill. 2022	Cosco Shipping Holdings Co-H, swap sur rendement total	(8 751)	1 271
(2 000)	29 juill. 2022	Cosco Shipping International, swap sur rendement total	(717)	25
(2 000)	29 juill. 2022	Cpmc Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 118)	(53)
(4 500)	29 juill. 2022	Dali Foods Group Co Ltd, swap sur rendement total	(3 141)	(211)
(2 000)	29 juill. 2022	Dexin China Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(923)	(78)
(4 000)	29 juill. 2022	Dynagreen Environmental Pr-H, swap sur rendement total	(2 223)	(65)
(32 562)	29 juill. 2022	Esprit Holdings Ltd, swap sur rendement total	(7 547)	(321)
(976)	29 juill. 2022	Esr Cayman Ltd, swap sur rendement total	(3 401)	258
(4 000)	29 juill. 2022	Ever Sunshine Lifestyle Serv, swap sur rendement total	(6 576)	(592)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(1 000)	29 juill. 2022	Far East Consortium Internat, swap sur rendement total	(411)	(21)
(1 000)	29 juill. 2022	Flat Glass Group Co Ltd-H, swap sur rendement total	(4 537)	425
(3 500)	29 juill. 2022	Fosun International Ltd, swap sur rendement total	(4 344)	248
(22 000)	29 juill. 2022	Future Land Development Hold, swap sur rendement total	(14 032)	(1 976)
(200)	29 juill. 2022	Gf Securities Co Ltd-H, swap sur rendement total	(358)	(17)
(3 000)	29 juill. 2022	Greatview Aseptic Packaging, swap sur rendement total	(774)	232
(12 000)	29 juill. 2022	Guangdong Investment Ltd, swap sur rendement total	(17 212)	2 204
(3 000)	29 juill. 2022	Guotai Junan International, swap sur rendement total	(459)	(30)
(12 460)	29 juill. 2022	Haidilao International Holdi, swap sur rendement total	(37 484)	(5 526)
(4 880)	29 juill. 2022	Haitong Securities Co Ltd-H, swap sur rendement total	(4 621)	(160)
(5 500)	29 juill. 2022	Hengan Intl Group Co Ltd, swap sur rendement total	(33 318)	1 902
(1 000)	29 juill. 2022	Hk Electric Investments -Ss, swap sur rendement total	(1 184)	51
(14 500)	29 juill. 2022	Hkbn Ltd, swap sur rendement total	(21 238)	2 552
(8 000)	29 juill. 2022	Hkt Trust And Hkt Ltd-Ss, swap sur rendement total	(13 861)	344
(4 012)	29 juill. 2022	Hong Kong & China Gas, swap sur rendement total	(5 573)	266
(4 000)	29 juill. 2022	Hong Kong Television Network, swap sur rendement total	(4 057)	152
(553)	29 juill. 2022	Hopson Development Holdings, swap sur rendement total	(1 101)	(73)
(2 000)	29 juill. 2022	Hua Hong Semiconductor Ltd, swap sur rendement total	(9 337)	445
(6 020)	29 juill. 2022	Huaneng Power Intl Inc-H, swap sur rendement total	(3 869)	50
(700)	29 juill. 2022	Imax China Holding Inc, swap sur rendement total	(913)	82
(5 000)	29 juill. 2022	Ind & Comm Bk Of China-H, swap sur rendement total	(3 830)	41
(4 146)	29 juill. 2022	Jiangsu Express Co Ltd-H, swap sur rendement total	(5 384)	144
(12 000)	29 juill. 2022	Jiayuan International Group, swap sur rendement total	(858)	(151)
(3 000)	29 juill. 2022	Jinchuan Group International, swap sur rendement total	(508)	(94)
(4 000)	29 juill. 2022	Joy City Property Ltd, swap sur rendement total	(197)	-
(2 000)	29 juill. 2022	Js Global Lifestyle Co Ltd, swap sur rendement total	(3 495)	(712)
(3 500)	29 juill. 2022	Kerry Properties Ltd, swap sur rendement total	(12 543)	(841)
(18 050)	29 juill. 2022	Kwg Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	(7 418)	(88)
(2 000)	29 juill. 2022	Lee & Man Paper Manufacturin, swap sur rendement total	(1 108)	148
(1 800)	29 juill. 2022	Livzon Pharmaceutical Grou-H, swap sur rendement total	(8 034)	(576)
(750)	29 juill. 2022	L'Occitane International Sa, swap sur rendement total	(3 021)	21
(2 000)	29 juill. 2022	Luoyang Glass Company Ltd-H, swap sur rendement total	(4 840)	(835)
(7 500)	29 juill. 2022	Luye Pharma Group Ltd, swap sur rendement total	(3 181)	(150)
(10 000)	29 juill. 2022	Lvgem China Real Estate Inve, swap sur rendement total	(1 989)	(575)
(1 200)	29 juill. 2022	Maoyan Entertainment, swap sur rendement total	(1 578)	(349)
(2 001)	29 juill. 2022	Midea Real Estate Holding Lt, swap sur rendement total	(4 697)	(612)
(1 500)	29 juill. 2022	Mtr Corp, swap sur rendement total	(10 361)	82
(5 000)	29 juill. 2022	Nexteer Automotive Group Ltd, swap sur rendement total	(4 644)	(468)
(5 000)	29 juill. 2022	Nine Dragons Paper Holdings, swap sur rendement total	(5 523)	255
(8 000)	29 juill. 2022	Nissin Foods Co Ltd, swap sur rendement total	(6 904)	(183)
(18 000)	29 juill. 2022	Panda Green Energy Group Ltd, swap sur rendement total	(722)	33
(6 000)	29 juill. 2022	Pccw Ltd, swap sur rendement total	(4 093)	128
(4 000)	29 juill. 2022	Petrochina Co Ltd-H, swap sur rendement total	(2 523)	233
(1 350)	29 juill. 2022	Pharmaron Beijing Co Ltd-H, swap sur rendement total	(17 499)	(3 135)
(15 000)	29 juill. 2022	Poly Property Group Co Ltd, swap sur rendement total	(4 993)	(357)
(1 000)	29 juill. 2022	Powerlong Commercial Managem, swap sur rendement total	(924)	101
(3 000)	29 juill. 2022	Q Technology Group Co Ltd, swap sur rendement total	(2 663)	6
(4 000)	29 juill. 2022	Redco Properties Group Ltd, swap sur rendement total	(1 322)	(26)
(4 000)	29 juill. 2022	Redsun Properties Group Ltd, swap sur rendement total	(1 690)	(105)
(2 000)	29 juill. 2022	Regal International Airport, swap sur rendement total	(7 595)	(2 244)
(1 000)	29 juill. 2022	Ronshine China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(321)	23
(9 200)	29 juill. 2022	Sands China Ltd, swap sur rendement total	(28 312)	(5 521)
(1 000)	29 juill. 2022	S-Enjoy Service Group Co Ltd, swap sur rendement total	(1 526)	(162)
(5 600)	29 juill. 2022	Shandong Weigao Gp Medical-H, swap sur rendement total	(8 456)	(455)
(300)	29 juill. 2022	Shanghai Haohai Biological-H, swap sur rendement total	(2 047)	(399)
(300)	29 juill. 2022	Shanghai Henlius Biotech I-H, swap sur rendement total	(871)	15
(4 000)	29 juill. 2022	Shanghai Industrial Urban De, swap sur rendement total	(441)	-
(5 100)	29 juill. 2022	Shanghai Pharmaceuticals-H, swap sur rendement total	(10 899)	(183)
(7 500)	29 juill. 2022	Shenzhen Intl Holdings, swap sur rendement total	(9 518)	(197)
(2 000)	29 juill. 2022	Shougang Fushan Resources Gr, swap sur rendement total	(1 072)	46
(61 500)	29 juill. 2022	Shui On Land Ltd, swap sur rendement total	(10 717)	507
(4 000)	29 juill. 2022	Sihuan Pharmaceutical Hldgs, swap sur rendement total	(842)	(98)
(4 000)	29 juill. 2022	Sino Land Co, swap sur rendement total	(7 614)	(302)
(1 500)	29 juill. 2022	Sino-Ocean Group Holding Ltd, swap sur rendement total	(336)	7
(2 000)	29 juill. 2022	Sinopec Kantons Holdings, swap sur rendement total	(884)	(4)
(2 000)	29 juill. 2022	Sinopec Oilfield Service -H, swap sur rendement total	(201)	2
(9 151)	29 juill. 2022	Sinopharm Group Co-H, swap sur rendement total	(29 740)	(504)
(10 000)	29 juill. 2022	Smartone Telecommunications, swap sur rendement total	(6 806)	32
(1 000)	29 juill. 2022	Sunlight Real Estate Invest, swap sur rendement total	(600)	26

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(1 400)	29 juill. 2022	Swire Properties Ltd, swap sur rendement total	(4 483)	(66)
(2 000)	29 juill. 2022	Tai Cheung Holdings, swap sur rendement total	(1 473)	10
(33)	29 juill. 2022	Tencent Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 923)	44
(5 000)	29 juill. 2022	Times Neighborhood Holdings, swap sur rendement total	(1 452)	(14)
(2 000)	29 juill. 2022	Tong Ren Tang Technologies-H, swap sur rendement total	(2 219)	(286)
(400)	29 juill. 2022	Transport Intl Hldg Ltd, swap sur rendement total	(776)	27
(2 000)	29 juill. 2022	Travelsky Technology Ltd-H, swap sur rendement total	(5 029)	(833)
(3 000)	29 juill. 2022	Value Partners Group Ltd, swap sur rendement total	(1 460)	89
(3 500)	29 juill. 2022	Venus Medtech Hangzhou Inc-H, swap sur rendement total	(10 069)	(2 278)
(4 000)	29 juill. 2022	Vitasoy Intl Holdings Ltd, swap sur rendement total	(9 022)	224
(22 000)	29 juill. 2022	Viva Biotech Holdings, swap sur rendement total	(9 837)	(830)
(3 000)	29 juill. 2022	Vobile Group Ltd, swap sur rendement total	(2 288)	(271)
(200)	29 juill. 2022	Vtech Holdings Ltd, swap sur rendement total	(2 029)	(94)
(7 000)	29 juill. 2022	Want Want China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(7 848)	1 140
(32 000)	29 juill. 2022	We Solutions Ltd, swap de rendement total	(1 789)	(158)
(1 000)	29 juill. 2022	Weichai Power Co Ltd-H, swap de rendement total	(2 048)	(37)
(1 000)	29 juill. 2022	Wharf Holdings Ltd, swap de rendement total	(4 702)	(391)
(900)	29 juill. 2022	Wuxi Apptec Co Ltd-H, swap de rendement total	(15 461)	(1 131)
(15 600)	29 juill. 2022	Wynn Macau Ltd, swap de rendement total	(13 669)	(1 923)
(2 500)	29 juill. 2022	Xiabuxiabu Catering Manageme, swap de rendement total	(1 763)	(279)
(3 600)	29 juill. 2022	Xinjiang Goldwind Sci&Tec-H, swap de rendement total	(8 836)	(1 224)
(2 000)	29 juill. 2022	Xinyi Solar Holdings Ltd, swap de rendement total	(4 018)	509
(6 000)	29 juill. 2022	Yanzhou Coal Mining Co-H, swap de rendement total	(24 264)	1 197
(6 200)	29 juill. 2022	Yichang Hec Changjiang Pha-H, swap de rendement total	(7 389)	(2 017)
(4 000)	29 juill. 2022	Yuexiu Property Co Ltd, swap de rendement total	(6 831)	(1 221)
(8 092)	29 juill. 2022	Yuexiu Real Estate Investmen, swap de rendement total	(4 071)	67
(20 000)	29 juill. 2022	Yuzhou Properties Co, swap de rendement total	(1 529)	14
(1 999)	29 juill. 2022	Zhaojin Mining Industry - H, swap de rendement total	(2 254)	(3)
(6 006)	29 juill. 2022	Zhejiang Expressway Co-H, swap de rendement total	(7 148)	(305)
(2 000)	29 juill. 2022	Zhuguang Holdings Group Co, swap de rendement total	(368)	30
(5 000)	29 juill. 2022	Zhuzhou Crrc Times Electri-H, swap de rendement total	(32 179)	(4 560)
(35 924)	29 juill. 2022	Zoomlion Heavy Industry - H, swap de rendement total	(26 634)	1 929
				<u>(36 551)</u>
Yen japonais – taux moyen du financement à un jour offert à Tokyo (TONAR)				
(500)	29 juill. 2022	Aeon Co Ltd, swap de rendement total	(11 176)	(13)
(100)	29 juill. 2022	Alleanza Holdings Co Ltd, swap de rendement total	(976)	(28)
(300)	29 juill. 2022	Aska Pharmaceutical Holdings, swap de rendement total	(2 863)	(61)
(700)	29 juill. 2022	Atom Corp, swap de rendement total	(5 198)	(45)
(100)	29 juill. 2022	Change Inc, swap de rendement total	(2 037)	(331)
(600)	29 juill. 2022	Chugai Pharmaceutical Co Ltd, swap de rendement total	(19 769)	382
(100)	29 juill. 2022	Colopl Inc, swap de rendement total	(622)	(17)
(100)	29 juill. 2022	Conexio Corp, swap de rendement total	(1 261)	32
(100)	29 juill. 2022	Cosel Co Ltd, swap de rendement total	(777)	14
(600)	29 juill. 2022	Cyberagent Inc, swap de rendement total	(7 697)	218
(200)	29 juill. 2022	Daiken Medical Co Ltd, swap de rendement total	(925)	64
(100)	29 juill. 2022	Daiwa Industries Ltd, swap de rendement total	(1 044)	(66)
(200)	29 juill. 2022	Denso Corp, swap de rendement total	(13 688)	1 270
(100)	29 juill. 2022	Dentsu Inc, swap de rendement total	(3 869)	195
(100)	29 juill. 2022	Duskin Co Ltd, swap de rendement total	(2 746)	(168)
(200)	29 juill. 2022	Fukuoka Financial Group Inc, swap de rendement total	(4 641)	(107)
(100)	29 juill. 2022	Furukawa Electric Co Ltd, swap de rendement total	(2 115)	(52)
(100)	29 juill. 2022	Gmo Payment Gateway Inc, swap de rendement total	(9 068)	1 038
(600)	29 juill. 2022	Gree Inc, swap de rendement total	(4 694)	285
(400)	29 juill. 2022	Hoosiers Holdings, swap de rendement total	(3 046)	(4)
(100)	29 juill. 2022	Imasen Electric Industrial, swap de rendement total	(555)	9
(100)	29 juill. 2022	Istyle Inc, swap de rendement total	(217)	3
(100)	29 juill. 2022	Iwatani Corp, swap de rendement total	(4 966)	92
(100)	29 juill. 2022	Kakaku.Com Inc, swap de rendement total	(2 125)	218
(900)	29 juill. 2022	Kansai Electric Power Co Inc, swap de rendement total	(11 485)	(764)
(400)	29 juill. 2022	Kddi Corp, swap de rendement total	(16 290)	759
(300)	29 juill. 2022	Kirin Holdings Co Ltd, swap de rendement total	(6 089)	(326)
(100)	29 juill. 2022	Kubota Corp, swap de rendement total	(1 925)	133
(400)	29 juill. 2022	Maezawa Kasei Industries Co, swap de rendement total	(4 854)	(7)
(200)	29 juill. 2022	Matsumotokiyoshi Holdings Co, swap de rendement total	(10 426)	(1 026)
(100)	29 juill. 2022	Max Co Ltd, swap de rendement total	(1 530)	(1)
(200)	29 juill. 2022	Midac Co Ltd, swap de rendement total	(5 304)	68
(400)	29 juill. 2022	Mito Securities Co Ltd, swap de rendement total	(987)	14
(300)	29 juill. 2022	Mitsubishi Chemical Holdings, swap de rendement total	(2 099)	78

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(500)	29 juill. 2022	Mitsubishi Electric Corp, swap de rendement total	(6 889)	(77)
(400)	29 juill. 2022	Mitsubishi Estate Co Ltd, swap de rendement total	(7 478)	(36)
(300)	29 juill. 2022	Mitsubishi Motors Corp, swap de rendement total	(1 307)	-
(100)	29 juill. 2022	Mitsubishi Ufj Financial Gro, swap de rendement total	(693)	-
(200)	29 juill. 2022	Mitsui Fudosan Co Ltd, swap de rendement total	(5 540)	(92)
(100)	29 juill. 2022	Mugen Estate Co Ltd, swap de rendement total	(461)	10
(100)	29 juill. 2022	Nankai Electric Railway Co, swap sur rendement total	(2 552)	(25)
(100)	29 juill. 2022	Nh Foods Ltd, swap sur rendement total	(4 031)	(294)
(200)	29 juill. 2022	Nichicon Corp, swap sur rendement total	(2 391)	115
(100)	29 juill. 2022	Nihon House Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(375)	24
(100)	29 juill. 2022	Nippon Express Holdings Inc, swap sur rendement total	(6 998)	393
(1)	29 juill. 2022	Nomura Real Estate Master Fu, swap sur rendement total	(1 608)	(23)
(800)	29 juill. 2022	Olympus Corp, swap sur rendement total	(20 710)	(127)
(200)	29 juill. 2022	Ono Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(6 612)	(241)
(100)	29 juill. 2022	Oracle Corp Japan, swap sur rendement total	(7 463)	(129)
(100)	29 juill. 2022	Renova Inc, swap sur rendement total	(2 324)	(513)
(100)	29 juill. 2022	Ringer Hut Co Ltd, swap sur rendement total	(2 211)	(60)
(100)	29 juill. 2022	Scroll Corp, swap sur rendement total	(864)	(64)
(200)	29 juill. 2022	Senko Group Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(1 667)	(56)
(100)	29 juill. 2022	Shikibo Ltd, swap sur rendement total	(851)	11
(2 800)	29 juill. 2022	Softbank Corp, swap sur rendement total	(40 052)	(761)
(600)	29 juill. 2022	Softbank Group Corp, swap sur rendement total	(29 824)	509
(100)	29 juill. 2022	Space Co Ltd, swap sur rendement total	(864)	7
(100)	29 juill. 2022	Sumitomo Rubber Industries, swap sur rendement total	(1 100)	17
(300)	29 juill. 2022	Tanseisha Co Ltd, swap sur rendement total	(2 324)	26
(100)	29 juill. 2022	Topy Industries Ltd, swap sur rendement total	(1 295)	(27)
(400)	29 juill. 2022	Tow Co Ltd, swap sur rendement total	(1 181)	66
(1 000)	29 juill. 2022	Toyota Motor Corp, swap sur rendement total	(19 940)	102
(100)	29 juill. 2022	Ube Industries Ltd, swap sur rendement total	(1 915)	(12)
(100)	29 juill. 2022	Vt Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(458)	(23)
(100)	29 juill. 2022	Yotai Refractories Co Ltd, swap sur rendement total	(1 325)	45
				621
Dollar néo-zélandais – taux du marché des acceptations bancaires (BKBM) à 1 mois				
(450)	29 juill. 2022	Fisher & Paykel Healthcare C, swap de rendement total	(7 324)	179
(1 678)	29 juill. 2022	Kiwi Property Group Ltd, swap de rendement total	(1 312)	59
(1 295)	29 juill. 2022	Meridian Energy Ltd, swap de rendement total	(4 861)	(13)
(602)	29 juill. 2022	Sanford Limited, swap de rendement total	(1 984)	71
(418)	29 juill. 2022	Serko Ltd, swap de rendement total	(1 240)	(25)
(1 387)	29 juill. 2022	Stride Property Group, swap de rendement total	(1 847)	68
(1 701)	29 juill. 2022	Synlait Milk Ltd, swap de rendement total	(4 256)	372
				711
Dollar de Singapour – taux interbancaire offert à Singapour (SIBOR) à 1 mois				
(9 400)	29 juill. 2022	Ascott Residence Trust, swap de rendement total	(9 933)	177
(300)	29 juill. 2022	Capitaland Integrated Commerc, swap de rendement total	(603)	5
(2 300)	29 juill. 2022	Cdl Hospitality Trusts, swap de rendement total	(2 707)	(15)
(2 600)	29 juill. 2022	Comfortdelgro Corp Ltd, swap de rendement total	(3 374)	(23)
(1 500)	29 juill. 2022	Esr-Reit, swap de rendement total	(563)	6
(2 700)	29 juill. 2022	Far East Hospitality Trust, swap de rendement total	(1 602)	27
(3 682)	29 juill. 2022	First Real Estate Invt Trust, swap de rendement total	(939)	35
(4 823)	29 juill. 2022	Frasers Hospitality Trust, swap de rendement total	(3 129)	(209)
(700)	29 juill. 2022	Keppel Infrastructure Trust, swap de rendement total	(370)	(3)
(5 612)	29 juill. 2022	Lippo Malls Indonesia Retail, swap de rendement total	(265)	16
(500)	29 juill. 2022	Sats Ltd, swap de rendement total	(1 807)	198
(53 850)	29 juill. 2022	Sembcorp Marine Ltd, swap de rendement total	(5 391)	553
(10 293)	29 juill. 2022	Singapore Airlines Ltd, swap de rendement total	(48 656)	3 931
(100)	29 juill. 2022	Singapore Tech Engineering, swap de rendement total	(378)	(1)
(1 900)	29 juill. 2022	Suntec Reit, swap de rendement total	(2 853)	98
(600)	29 juill. 2022	Thai Beverage Pcl, swap de rendement total	(359)	28
(100)	29 juill. 2022	Wilmar International Ltd, swap de rendement total	(374)	9
				4 832
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
(18)	29 juill. 2022	African Rainbow Minerals Ltd, swap de rendement total	(303)	38
(1 074)	29 juill. 2022	Alexander Forbes Group Holdi, swap de rendement total	(403)	(42)
(83)	29 juill. 2022	Aspen Pharmacare Holdings Lt, swap de rendement total	(909)	1
(1 850)	29 juill. 2022	Attacq Ltd, swap de rendement total	(808)	185
(3 719)	29 juill. 2022	Fortress Reit Ltd-A, swap de rendement total	(3 130)	509
(20 112)	29 juill. 2022	Growthpoint Properties Ltd, swap sur rendement total	(19 558)	3 259
(574)	29 juill. 2022	Hyprop Investments Ltd, swap sur rendement total	(1 500)	175

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(97)	29 juill. 2022	Impala Platinum Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 384)	155
(993)	29 juill. 2022	Kap Industrial Holdings Ltd, swap sur rendement total	(344)	24
(7)	29 juill. 2022	Kumba Iron Ore Ltd, swap sur rendement total	(290)	42
(1 005)	29 juill. 2022	Massmart Holdings Ltd, swap sur rendement total	(2 759)	157
(237)	29 juill. 2022	Naspers Ltd- actions, N, swap sur rendement total	(44 185)	(11 407)
(2 649)	29 juill. 2022	Nepi Rockcastle Plc, swap sur rendement total	(18 165)	2 197
(302)	29 juill. 2022	Oceana Group Ltd, swap sur rendement total	(1 058)	289
(421)	29 juill. 2022	Remgro Ltd, swap sur rendement total	(4 306)	256
(1 356)	29 juill. 2022	Resilient Reit Ltd, swap sur rendement total	(5 704)	132
(2 352)	29 juill. 2022	Rmb Holdings Ltd, swap sur rendement total	(317)	(38)
(78)	29 juill. 2022	Royal Bafokeng Platinum Ltd, swap sur rendement total	(900)	85
(3 301)	29 juill. 2022	Vukile Property Fund Ltd, swap sur rendement total	(3 471)	133
(100)	29 juill. 2022	Wilson Bayly Holmes-Ovcon, swap sur rendement total	(637)	9
				(3 841)
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
(18)	29 juill. 2022	Aak Ab, swap de rendement total	(378)	(13)
(31)	29 juill. 2022	Addlife Ab-B, swap de rendement total	(599)	297
(83)	29 juill. 2022	Afry Ab, swap de rendement total	(1 467)	171
(33)	29 juill. 2022	Bactiguard Holding Ab, swap de rendement total	(465)	(47)
(185)	29 juill. 2022	Betsson Ab, swap de rendement total	(1 441)	110
(15)	29 juill. 2022	Bico Group Ab, swap de rendement total	(168)	77
(441)	29 juill. 2022	Bonava Ab- actions, B, swap de rendement total	(1 649)	461
(46)	29 juill. 2022	Bravida Holding Ab, swap de rendement total	(516)	16
(10)	29 juill. 2022	Bufab Ab, swap de rendement total	(334)	55
(32)	29 juill. 2022	Bulten Ab, swap de rendement total	(258)	2
(421)	29 juill. 2022	Bygghemma Group First Ab, swap de rendement total	(1 718)	748
(304)	29 juill. 2022	Castellum Ab, swap de rendement total	(5 030)	2 059
(20)	29 juill. 2022	Catena Ab, swap de rendement total	(935)	97
(41)	29 juill. 2022	Cellavision Ab, swap de rendement total	(1 744)	31
(16)	29 juill. 2022	Ctt Systems Ab, swap de rendement total	(399)	14
(142)	29 juill. 2022	Duni Ab, swap de rendement total	(1 459)	125
(12)	29 juill. 2022	Eolus Vind Ab- actions, B, swap de rendement total	(117)	28
(145)	29 juill. 2022	Fabege Ab, swap de rendement total	(1 781)	352
(42)	29 juill. 2022	Fastighets Ab Balder- actions, B, swap de rendement total	(259)	28
(62)	29 juill. 2022	Granges Ab, swap de rendement total	(597)	87
(102)	29 juill. 2022	Jm Ab, swap de rendement total	(2 174)	595
(46)	29 juill. 2022	Kambi Group Plc, swap de rendement total	(969)	319
(154)	29 juill. 2022	Kindred Group Plc, swap de rendement total	(1 649)	308
(149)	29 juill. 2022	Loomis Ab, swap de rendement total	(4 667)	(39)
(13 429)	29 juill. 2022	Lundin Energy Ab, swap de rendement total	(11 816)	6 424
(313)	29 juill. 2022	Lundin Energy Mergerco Ab, swap de rendement total	-	-
(22)	29 juill. 2022	Ncc Ab- actions, B, swap de rendement total	(285)	52
(581)	29 juill. 2022	Nolato Ab- actions, B, swap de rendement total	(4 023)	512
(1 005)	29 juill. 2022	Nordea Bank Abp, swap de rendement total	(11 386)	1 018
(79)	29 juill. 2022	Nyfosa Ab, swap de rendement total	(761)	322
(221)	29 juill. 2022	Peab Ab- cat. B, swap de rendement total	(1 664)	321
(394)	29 juill. 2022	Pricer Ab- actions, B, swap de rendement total	(764)	62
(27)	29 juill. 2022	Saab Ab-B, swap de rendement total	(1 436)	(80)
(99 759)	29 juill. 2022	Sas Ab, swap de rendement total	(8 130)	2 461
(2 459)	29 juill. 2022	Sinch Ab, swap de rendement total	(10 306)	4 259
(119)	29 juill. 2022	Skandinaviska Enskilda Ban-A, swap de rendement total	(1 504)	108
(42)	29 juill. 2022	Ssab Ab - actions, B, swap de rendement total	(224)	41
(2 113)	29 juill. 2022	Stillfront Group Ab, swap de rendement total	(6 003)	621
(137)	29 juill. 2022	Storytel Ab, swap de rendement total	(843)	321
(309)	29 juill. 2022	Svenska Cellulosa Ab Sca-B, swap de rendement total	(5 943)	117
(4 641)	29 juill. 2022	Svenska Handelsbanken- actions, A, swap de rendement total	(51 072)	4 261
(110)	29 juill. 2022	Swedbank Ab - actions, A, swap de rendement total	(1 790)	217
(576)	29 juill. 2022	Tele2 Ab- actions, B, swap de rendement total	(8 447)	192
(1 076)	29 juill. 2022	Telia Co Ab, swap sur rendement total	(5 307)	113
(98)	29 juill. 2022	Vitrolife Ab, swap sur rendement total	(2 902)	576
(52)	29 juill. 2022	Wallenstam Ab- actions, B, swap sur rendement total	(293)	34
				27 833
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
(1 317)	29 juill. 2022	Adecco Group Ag- actions ord., swap de rendement total	(57 566)	8 295
(30)	29 juill. 2022	Allreal Holding Ag- actions ord., swap de rendement total	(6 379)	410
(1 123)	29 juill. 2022	Ams Ag, swap de rendement total	(13 010)	3 421
(29)	29 juill. 2022	Baloise Holding Ag - actions ord., swap de rendement total	(6 092)	200
(6)	29 juill. 2022	Burckhardt Compression Holdi, swap de rendement total	(3 238)	481

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(260)	29 juill. 2022	Cie Financière Richemont- actions ord., swap de rendement total	(35 611)	1 116
(15)	29 juill. 2022	Dormakaba Holding Ag, swap de rendement total	(8 418)	679
(85)	29 juill. 2022	Dufry Ag- actions ord., swap de rendement total	(3 534)	996
(1 196)	29 juill. 2022	Evolva Holding Sa, swap de rendement total	(143)	29
(17)	29 juill. 2022	Geberit Ag- actions ord., swap de rendement total	(10 509)	425
(10)	29 juill. 2022	Gurit Holding Ag-Br, swap de rendement total	(1 366)	45
(60)	29 juill. 2022	Hiag Immobilien Ag, swap de rendement total	(6 791)	643
(129)	29 juill. 2022	Implenia Ag- actions ord., swap de rendement total	(3 798)	(95)
(212)	29 juill. 2022	Kuehne + Nagel Intl Ag- actions ord., swap de rendement total	(64 557)	6 241
(3 045)	29 juill. 2022	Meyer Burger Technology Ag, swap de rendement total	(1 660)	180
(3)	29 juill. 2022	Mobimo Holding Ag- actions ord., swap de rendement total	(938)	74
(10)	29 juill. 2022	Schindler Holding-Part Cert, swap de rendement total	(2 346)	(4)
(2)	29 juill. 2022	Sgs Sa- actions ord., swap de rendement total	(5 888)	33
(3)	29 juill. 2022	Siegfried Holding Ag- actions ord., swap de rendement total	(2 479)	140
(84)	29 juill. 2022	Sig Combibloc Group Ag, swap de rendement total	(2 379)	(62)
(24)	29 juill. 2022	Sika Ag- actions ord., swap de rendement total	(7 114)	86
(46)	29 juill. 2022	Softwareone Holding Ag, swap de rendement total	(709)	67
(6)	29 juill. 2022	Swatch Group Ag/The-Br, swap de rendement total	(1 831)	137
(1)	29 juill. 2022	Vat Group Ag, swap de rendement total	(307)	13
				23 550
Dollar américain – taux interbancaire offert à Londres (ICE LIBOR) à 1 mois				
(135)	29 juill. 2022	Ace Technologies Corp, swap de rendement total	(954)	490
(62)	29 juill. 2022	Advanced Process Systems Cor, swap de rendement total	(1 022)	372
(8 000)	29 juill. 2022	Alpha Networks Inc, swap de rendement total	(8 882)	867
(103)	29 juill. 2022	Alteogen Inc, swap de rendement total	(6 249)	(49)
(700)	29 juill. 2022	Alupar Investimento Sa- parts, swap de rendement total	(4 477)	508
(6 200)	29 juill. 2022	Americanas Sa -, swap de rendement total	(20 523)	13 452
(1 000)	29 juill. 2022	Ampacs Corporation, swap de rendement total	(1 585)	426
(1 500)	29 juill. 2022	Axtel Sab De Cv - Cpo, swap de rendement total	(147)	8
(200)	29 juill. 2022	Becle Sab De Cv, swap de rendement total	(558)	8
(82)	29 juill. 2022	Boryung Pharmaceutical Co, swap de rendement total	(826)	198
(4 700)	29 juill. 2022	Br Properties Sa, swap de rendement total	(10 252)	803
(1 000)	29 juill. 2022	Brogent Technologies Inc, swap de rendement total	(4 641)	653
(660)	29 juill. 2022	Bukwang Pharmaceutical Co, swap de rendement total	(5 544)	1 823
(26)	29 juill. 2022	Cafe24 Corp, swap de rendement total	(319)	124
(600)	29 juill. 2022	Calin Technology Co Ltd, swap de rendement total	(1 051)	270
(500)	29 juill. 2022	Camil Alimentos Sa, swap de rendement total	(1 213)	95
(10 000)	29 juill. 2022	Career Technology Co Ltd, swap de rendement total	(9 607)	377
(3 000)	29 juill. 2022	Catcher Technology Co Ltd, swap de rendement total	(21 534)	349
(901)	29 juill. 2022	Celltrion Healthcare Co Ltd, swap de rendement total	(61 374)	(3 328)
(11)	29 juill. 2022	Celltrion Inc, swap de rendement total	(1 950)	(103)
(452)	29 juill. 2022	Celltrion Pharm Inc, swap de rendement total	(35 322)	3 250
(1 000)	29 juill. 2022	Century Iron & Steel Indus, swap de rendement total	(4 793)	366
(1 000)	29 juill. 2022	Channel Well Technology Co, swap de rendement total	(1 418)	174
(1 000)	29 juill. 2022	China Metal Products Co Ltd, swap de rendement total	(1 381)	53
(33 000)	29 juill. 2022	China Petrochemical Dev Corp, swap de rendement total	(14 313)	2 024
(5 000)	29 juill. 2022	China Steel Corp, swap de rendement total	(6 170)	1 271
(8)	29 juill. 2022	Chong Kun Dang Pharma -, swap de rendement total	(695)	65
(45 000)	29 juill. 2022	Chun Yuan Steel Industry Co, swap de rendement total	(31 227)	8 092
(1 000)	29 juill. 2022	Cia De Transmissao De Ene- actions priv., swap de rendement total	(5 662)	673
(37 700)	29 juill. 2022	Cielo Sa, swap sur rendement total	(34 845)	5 766
(3)	29 juill. 2022	Cj Cheiljedang Corp, swap sur rendement total	(1 129)	103
(77)	29 juill. 2022	Cj Logistics Corp, swap sur rendement total	(8 716)	1 621
(89)	29 juill. 2022	Cmg Pharmaceutical Co -, swap sur rendement total	(221)	67
(13 600)	29 juill. 2022	Cogna Educacional Sa, swap sur rendement total	(7 173)	2 647
(141)	29 juill. 2022	Concraft Holding Co Ltd, swap sur rendement total	(112)	37
(1 300)	29 juill. 2022	Construtora Tenda Sa, swap sur rendement total	(1 250)	526
(6 000)	29 juill. 2022	Cosan Sa Industria Comercio -, swap sur rendement total	(26 915)	8 092
(244)	29 juill. 2022	Crystalgenomics Inc, swap sur rendement total	(981)	304
(9)	29 juill. 2022	Cs Wind Corp, swap sur rendement total	(517)	21
(100)	29 juill. 2022	Cvc Brasil Operadora E Agenc -, swap sur rendement total	(172)	110
(3 050)	29 juill. 2022	Cyrela Brazil Realty Sa Emp, swap sur rendement total	(8 886)	1 924
(110)	29 juill. 2022	Dairy Farm Intl Hldgs Ltd, swap sur rendement total	(416)	(31)
(11 060)	29 juill. 2022	Da-Li Development Co Ltd, swap sur rendement total	(14 367)	659
(1)	29 juill. 2022	Dawonsys Co Ltd -, swap sur rendement total	(24)	17
(1)	29 juill. 2022	Dawonsys Co Ltd -, swap sur rendement total	(7)	(7)
(2 100)	29 juill. 2022	Dexco Sa, swap sur rendement total	(5 109)	1 232
(200)	29 juill. 2022	Dimed Sa Distribuidora De Me, swap sur rendement total	(473)	17

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(8)	29 juill. 2022	DI Co Ltd, swap sur rendement total	(563)	23
(26)	29 juill. 2022	Dongbu Hitek Co Ltd, swap sur rendement total	(1 290)	575
(87)	29 juill. 2022	Doosan Fuel Cell Co Ltd, swap sur rendement total	(2 596)	898
(798)	29 juill. 2022	Doosan Heavy Industries, swap sur rendement total	(15 372)	1 879
(100)	29 juill. 2022	Duk San Neolux Co Ltd, swap sur rendement total	(2 989)	631
(1 000)	29 juill. 2022	Dyaco International Inc, swap sur rendement total	(1 814)	129
(60)	29 juill. 2022	Ecopro Bm Co Ltd, swap sur rendement total	(6 762)	1 081
(100)	29 juill. 2022	Engie Brasil Energia Sa, swap sur rendement total	(1 035)	12
(11 000)	29 juill. 2022	Ennostar Inc, swap sur rendement total	(25 142)	5 933
(5)	29 juill. 2022	Enzychem Lifesciences Corp, swap sur rendement total	(80)	25
(163)	29 juill. 2022	Eo Technics Co Ltd, swap sur rendement total	(13 045)	4 834
(2 400)	29 juill. 2022	Even Construtora E Inco Sa -, swap sur rendement total	(2 561)	728
(1 500)	29 juill. 2022	Ez Tec Empreendimentos E Par, swap sur rendement total	(5 342)	1 313
(75)	29 juill. 2022	Feelux Co Ltd, swap sur rendement total	(112)	52
(200)	29 juill. 2022	Fibra Uno Administracion Sa, swap sur rendement total	(257)	10
(22)	29 juill. 2022	Fila Korea Ltd, swap sur rendement total	(614)	113
(1 000)	29 juill. 2022	First Steamship, swap sur rendement total	(413)	67
(4 000)	29 juill. 2022	Fulltech Fiber Glass Corp, swap sur rendement total	(2 212)	258
(1 000)	29 juill. 2022	Gaec Educacao Sa, swap sur rendement total	(961)	560
(1 661)	29 juill. 2022	Gafisa Sa, swap sur rendement total	(438)	219
(349)	29 juill. 2022	Genexine Co Ltd, swap sur rendement total	(10 587)	3 154
(3 500)	29 juill. 2022	Genomma Lab Internacional-B, swap sur rendement total	(4 519)	40
(2 000)	29 juill. 2022	Goldsun Building Materials C, swap sur rendement total	(2 134)	283
(77)	29 juill. 2022	Green Cross Corp, swap sur rendement total	(12 883)	2 541
(214)	29 juill. 2022	Green Cross Holdings Corp, swap sur rendement total	(4 165)	713
(3)	29 juill. 2022	Green Cross Labcell Corp, swap sur rendement total	(167)	20
(105)	29 juill. 2022	Grupo Aeroport Del Sureste-B, swap sur rendement total	(2 662)	264
(200)	29 juill. 2022	Grupo Carso Sab De Cv- série A1, swap sur rendement total	(961)	51
(600)	29 juill. 2022	Grupo Cementos Chihuahua, swap sur rendement total	(4 838)	525
(5 900)	29 juill. 2022	Grupo Mexico Sab De Cv- série B, swap sur rendement total	(31 513)	5 022
(600)	29 juill. 2022	Grupo Traxion Sab De Cv, swap sur rendement total	(1 055)	200
(157)	29 juill. 2022	Gs Holdings -, swap sur rendement total	(6 524)	911
(29)	29 juill. 2022	Gs Retail Co Ltd, swap sur rendement total	(739)	75
(100)	29 juill. 2022	Guararapes Confecoes Sa, swap sur rendement total	(167)	68
(75)	29 juill. 2022	Hanall Biopharma Co Ltd, swap sur rendement total	(1 229)	114
(5)	29 juill. 2022	Hanmi Pharm Co Ltd -, swap sur rendement total	(1 529)	85
(43)	29 juill. 2022	Hanon Systems, swap sur rendement total	(429)	85
(27)	29 juill. 2022	Hansae Co Ltd -, swap sur rendement total	(454)	161
(143)	29 juill. 2022	Hanssem Co Ltd, swap sur rendement total	(9 159)	1 717
(267)	29 juill. 2022	Hanwha Chemical Corp, swap sur rendement total	(10 048)	826
(12 300)	29 juill. 2022	Hapvida Participacoes E Inve, swap sur rendement total	(16 583)	3 784
(23)	29 juill. 2022	Hdc Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(151)	22
(214)	29 juill. 2022	Helixmith Co Ltd, swap sur rendement total	(4 420)	552
(17 800)	29 juill. 2022	Highwealth Construction Corp, swap sur rendement total	(34 895)	1 763
(726)	29 juill. 2022	Hlb Inc, swap sur rendement total	(25 520)	8 941
(900)	29 juill. 2022	Hongkong Land Holdings Ltd, swap sur rendement total	(5 828)	(421)
(95 475)	29 juill. 2022	Hoteles City Express Sab De, swap sur rendement total	(24 741)	997
(4 000)	29 juill. 2022	Hsin Kuang Steel Co Ltd, swap sur rendement total	(6 879)	1 995
(2 000)	29 juill. 2022	Huaku Development Co Ltd, swap sur rendement total	(8 353)	23
(2)	29 juill. 2022	Hugel Inc, swap sur rendement total	(209)	4
(6)	29 juill. 2022	Hyundai Dept Store Co -, swap sur rendement total	(418)	67
(1 669)	29 juill. 2022	Hyundai Merchant Marine, swap sur rendement total	(40 769)	14 957
(844)	29 juill. 2022	Hyundai Rotem Company, swap sur rendement total	(17 432)	(393)
(16)	29 juill. 2022	Hyundai Wia Corp -, swap sur rendement total	(887)	223
(204)	29 juill. 2022	Ilyang Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(4 497)	1 239
(72)	29 juill. 2022	Imarketkorea Inc, swap sur rendement total	(1 873)	179
(44)	29 juill. 2022	Insun Ent Co Ltd, swap sur rendement total	(377)	25
(550)	29 juill. 2022	International Meal Company -, swap sur rendement total	(218)	97
(4 000)	29 juill. 2022	Irb Brasil Resseguros Sa, swap sur rendement total	(2 001)	1 207
(30)	29 juill. 2022	Is Dongseo Co Ltd, swap sur rendement total	(1 162)	391
(10)	29 juill. 2022	Itm Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	(308)	35
(900)	29 juill. 2022	Jhsf Participacoes Sa, swap sur rendement total	(1 293)	430
(2)	29 juill. 2022	Kcc Corp, swap sur rendement total	(571)	138
(5 000)	29 juill. 2022	Kimberly-Clark De Mexico-A, swap sur rendement total	(8 733)	1 222
(1 000)	29 juill. 2022	King'S Town Bank, swap sur rendement total	(1 535)	54
(1 000)	29 juill. 2022	Kinpo Electronics Inc, swap sur rendement total	(566)	45
(31)	29 juill. 2022	Kolmar Bnh Co Ltd, swap sur rendement total	(828)	169
(209)	29 juill. 2022	Kolmar Korea Co Ltd -, swap sur rendement total	(7 917)	1 077
(10)	29 juill. 2022	Korea Investment Holdings Co, swap sur rendement total	(613)	134

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(3 000)	29 juill. 2022	Kuo Toong Intl Co Ltd, swap sur rendement total	(2 303)	386
(7)	29 juill. 2022	L&F Co Ltd, swap sur rendement total	(1 460)	402
(3 000)	29 juill. 2022	Land Mark Optoelectronics, swap sur rendement total	(15 093)	4 191
(72)	29 juill. 2022	Legochem Biosciences Inc, swap sur rendement total	(2 999)	107
(2)	29 juill. 2022	Lg Chem Ltd, swap sur rendement total	(1 025)	206
(4 000)	29 juill. 2022	Li Cheng Enterprise Co Ltd, swap sur rendement total	(4 979)	(727)
(3 900)	29 juill. 2022	Locaweb Servicios De Internet, swap sur rendement total	(5 402)	1 625
(600)	29 juill. 2022	Log-In Logistica Intermodal, swap sur rendement total	(4 487)	1 072
(400)	29 juill. 2022	Lojas Americanas Sa -, swap sur rendement total	(650)	(104)
(400)	29 juill. 2022	Lojas Renner S.A., swap sur rendement total	(2 230)	323
(18)	29 juill. 2022	Lotte Shopping Co -, swap sur rendement total	(1 859)	53
(1 000)	29 juill. 2022	Macronix International, swap sur rendement total	(1 540)	155
(500)	29 juill. 2022	Magazine -, swap sur rendement total	(288)	14
(1 400)	29 juill. 2022	Magazine Luiza Sa, swap sur rendement total	(821)	332
(54)	29 juill. 2022	Mando Corp, swap sur rendement total	(2 550)	556
(500)	29 juill. 2022	Manulife Us Real Estate Inv, swap sur rendement total	(368)	20
(10)	29 juill. 2022	Medpacto Inc, swap sur rendement total	(229)	86
(704)	29 juill. 2022	Meritz Securities Co Ltd, swap sur rendement total	(3 174)	1 299
(1 900)	29 juill. 2022	Metalurgica Gerdau Sa, swap sur rendement total	(4 472)	1 840
(100)	29 juill. 2022	Minerva Sa, swap sur rendement total	(327)	12
(1 433)	29 juill. 2022	Mirae Asset Daewoo Co Ltd, swap sur rendement total	(9 420)	2 779
(2 100)	29 juill. 2022	Mrv Engenharia -, swap sur rendement total	(4 145)	1 316
(1 000)	29 juill. 2022	Nan Kang Rubber Tire Co Ltd, swap sur rendement total	(1 657)	156
(90)	29 juill. 2022	Nasmedia Co Ltd -, swap sur rendement total	(9 839)	2 039
(4 200)	29 juill. 2022	Natura &Co Holding Sa, swap sur rendement total	(13 892)	4 907
(1)	29 juill. 2022	Ncsoft Co, swap sur rendement total	(347)	128
(11 600)	29 juill. 2022	Nemak Sab De Cv, swap sur rendement total	(2 961)	435
(10 000)	29 juill. 2022	Newmax Technology Co Ltd, swap sur rendement total	(11 862)	1 589
(203)	29 juill. 2022	Nh Investment & Securities C, swap sur rendement total	(1 824)	463
(258)	29 juill. 2022	Nkmax Co Ltd, swap sur rendement total	(3 804)	1 646
(2 000)	29 juill. 2022	Novatek Microelectronics Cor, swap sur rendement total	(26 196)	9 482
(12)	29 juill. 2022	Oci Co Ltd, swap sur rendement total	(1 710)	(91)
(1 600)	29 juill. 2022	Omega Energia Sa, swap sur rendement total	(4 732)	(137)
(3 000)	29 juill. 2022	Optotech Corp, swap sur rendement total	(5 556)	1 152
(80)	29 juill. 2022	Oscotec Inc, swap sur rendement total	(2 204)	245
(1 000)	29 juill. 2022	O-Ta Precision Industry Co, swap sur rendement total	(5 213)	1 200
(53)	29 juill. 2022	Pan Ocean Co Ltd, swap sur rendement total	(313)	106
(1 300)	29 juill. 2022	Pla Administradora Industria, swap sur rendement total	(2 241)	245
(30)	29 juill. 2022	Posco Daewoo Corp -, swap sur rendement total	(573)	167
(139)	29 juill. 2022	Posco Ict Co Ltd, swap sur rendement total	(723)	177
(100)	29 juill. 2022	Prologis Property Mexico Sa, swap sur rendement total	(338)	(8)
(1 000)	29 juill. 2022	Radiant Opto-Electronics Cor, swap sur rendement total	(4 112)	535
(1 000)	29 juill. 2022	Radium Life Tech Co Ltd, swap sur rendement total	(405)	23
(2 544)	29 juill. 2022	Run Long Construction Co Ltd, swap sur rendement total	(7 404)	465
(23)	29 juill. 2022	Samsung Electr- CIAE, swap sur rendement total	(32 369)	7 326
(23)	29 juill. 2022	Samsung Sds Co Ltd, swap sur rendement total	(2 969)	594
(434)	29 juill. 2022	Samsung Securities Co Ltd, swap sur rendement total	(14 415)	3 537
(507)	29 juill. 2022	Seegene Inc, swap sur rendement total	(18 199)	5 312
(632)	29 juill. 2022	Seoul Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	(6 589)	1 754
(100)	29 juill. 2022	Ser Educacional Sa -, swap sur rendement total	(155)	63
(1 000)	29 juill. 2022	Shun On Electronic Co Ltd, swap sur rendement total	(1 310)	246
(1 600)	29 juill. 2022	Siam Commercial Bank Pub Co, swap sur rendement total	(6 080)	582
(6 000)	29 juill. 2022	Sincere Navigation, swap sur rendement total	(5 309)	1 879
(200)	29 juill. 2022	Singia Sa, swap sur rendement total	(781)	264
(94)	29 juill. 2022	Sk Chemicals Co Ltd/New, swap sur rendement total	(8 597)	3 988
(44)	29 juill. 2022	Sk Discovery Co Ltd, swap sur rendement total	(1 527)	321
(4)	29 juill. 2022	Sk Innovation Co Ltd, swap sur rendement total	(763)	193
(46)	29 juill. 2022	S-Oil Corp, swap sur rendement total	(4 750)	794
(141)	29 juill. 2022	St Pharm Co Ltd, swap sur rendement total	(12 587)	2 682
(297)	29 juill. 2022	State Bank Of Indi-CIAE, actions ord., S, swap sur rendement total	(22 297)	440
(20 000)	29 juill. 2022	Ta Chen Stainless Pipe Co, swap sur rendement total	(29 362)	8 891
(3 000)	29 juill. 2022	Taiwan Surface Mounting Tech, swap sur rendement total	(11 762)	3 182
(700)	29 juill. 2022	Tegma Gestao Logistica, swap sur rendement total	(2 365)	572
(602)	29 juill. 2022	Telcon Rf Pharmaceutical Inc, swap sur rendement total	(837)	429
(1 000)	29 juill. 2022	Telesites Sab De Cv, swap sur rendement total	(1 580)	(149)
(66)	29 juill. 2022	Tes Co Ltd -TRS	(1 294)	392
(800)	29 juill. 2022	Totvs Sa -, swap sur rendement total	(4 586)	1 386
(300)	29 juill. 2022	Trisul Sa, swap sur rendement total	(252)	65
(300)	29 juill. 2022	Tupy Sa, swap sur rendement total	(1 644)	248

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

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

Au 30 juin 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(195)	29 juill. 2022	Tway Air Co Ltd, swap sur rendement total	(178)	(10)
(500)	29 juill. 2022	Ultrapar Participacoes Sa, swap sur rendement total	(1 568)	379
(1 200)	29 juill. 2022	Unifin Financiera Sab De Cv, swap sur rendement total	(1 339)	(7)
(61 000)	29 juill. 2022	Upc Technology Corp, swap sur rendement total	(41 537)	4 935
(600)	29 juill. 2022	Usinas Sider Minas Ger- actions priv., A, swap sur rendement total	(1 279)	414
(6 000)	29 juill. 2022	Via S/A, swap sur rendement total	(2 839)	2 273
(300)	29 juill. 2022	Vivara Participacoes Sa, swap sur rendement total	(1 625)	350
(1 000)	29 juill. 2022	Wan Hai Lines Ltd, swap sur rendement total	(5 161)	1 515
(1 000)	29 juill. 2022	Winbond Electronics Corp, swap sur rendement total	(985)	318
(13)	29 juill. 2022	Wonik Ips Co Ltd -, swap sur rendement total	(385)	39
(66)	29 juill. 2022	Woongjin Coway Co Ltd, swap sur rendement total	(4 188)	735
(2 000)	29 juill. 2022	Xintec Inc, swap sur rendement total	(11 407)	1 641
(3 000)	29 juill. 2022	Yageo Corporation, swap sur rendement total	(40 075)	13 949
(1 200)	29 juill. 2022	Yduqs Part, swap sur rendement total	(3 866)	1 410
(4 000)	29 juill. 2022	Yulon Motor Company, swap sur rendement total	(8 189)	(242)
(118)	29 juill. 2022	Yungjin Pharmaceutical Co, swap sur rendement total	(425)	93
(31)	29 juill. 2022	Zinus Inc, swap sur rendement total	(1 502)	401
(1 000)	29 juill. 2022	Zongtai Real Estate Developm, swap sur rendement total	(1 215)	391
				<u>246 009</u>
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position vendeur		<u>521 113</u>
		Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total		741 875
		Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total		(694 985)
		Plus-value (moins-value) latente des swaps sur rendement total, montant net		46 890

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (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 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.

L'objectif de placement du Fonds est de constituer un portefeuille diversifié d'actions canadiennes et mondiales en prenant à la fois des positions acheteur et vendeur, tout en tentant de maintenir une position acheteur nette de 100 %, en actions canadiennes en vue de maximiser le rendement total à long terme. Le Fonds a pour objectif d'obtenir un rendement supérieur à celui de l'indice composé S&P/TSX (RG) au cours d'un cycle de marché.

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 2022

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	18 840 435 \$	– \$	– \$	18 840 435 \$
Actions américaines – position acheteur	1 300 341	2 001	–	1 302 342
Actions étrangères – position acheteur	2 030 736	5 404	–	2 036 140
Contrats de change à terme	–	9 632	–	9 632
Contrats de swap	–	741 875	–	741 875
	22 171 512 \$	758 912 \$	– \$	22 930 424 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	462 738 \$	– \$	– \$	462 738 \$
Actions américaines – position vendeur	1 535 785	–	–	1 535 785
Actions étrangères – position vendeur	2 619 785	15 333	–	2 635 118
Contrats de change à terme	–	15 245	–	15 245
Contrats de swap	–	694 985	–	694 985
	4 618 308 \$	725 563 \$	– \$	5 343 871 \$

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Au 31 décembre 2021

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	25 283 110 \$	– \$	– \$	25 283 110 \$
Actions américaines – position acheteur	1 844 478	7 452	–	1 851 930
Actions étrangères – position acheteur	3 348 479	4 763	–	3 353 242
Contrats de change à terme	–	11 691	–	11 691
Contrats de swap	–	594 701	–	594 701
	30 476 067 \$	618 607 \$	– \$	31 094 674 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	613 658 \$	– \$	– \$	613 658 \$
Actions américaines – position vendeur	1 960 927	–	–	1 960 927
Actions étrangères – position vendeur	4 157 597	6 282	–	4 163 879
Contrats de change à terme	–	7 123	–	7 123
Contrats de swap	–	460 255	–	460 255
	6 732 182 \$	473 660 \$	– \$	7 205 842 \$

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 2022 et l'exercice clos le 31 décembre 2021. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2022 et l'exercice clos le 31 décembre 2021, 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
2022					
Série A	41 855	2 102	–	–	43 957
Série F	35 406	330 120	–	(52)	365 474
Série I	2 004 975	2 762	–	(702 490)	1 305 247
2021					
Série A	21 600	12 804	7 451	–	41 855
Série F	25 945	8 438	6 322	(5 299)	35 406
Série I	1 618 362	6 098	380 844	(329)	2 004 975

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2021, le Fonds disposait de pertes en capital inutilisées de néant (néant au 31 décembre 2020) 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 2020).

Au cours de la période, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2021).

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (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 1,50 % pour la série A et de 0,50 % 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 20 % 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 composé S&P/TSX (RG).

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 2022, CCLFGII détenait 1 260 155 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 13 636 011 \$ (1 962 376 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 23 470 017 \$ au 31 décembre 2021). Au 30 juin 2022, GFCC&L détenait 6 265 parts de série A, 6 318 parts de série F et 6 492 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 65 982 \$, de 68 188 \$ et de 70 249 \$ (6 265 parts de série A, 6 318 parts de série F et 6 492 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 73 551 \$, de 75 626 \$ et de 77 644 \$ au 31 décembre 2021).

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

Le Fonds a payé 14 488 \$ (11 577 \$ en 2021) 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 1 831 \$ (3 150 \$ en 2021).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, 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 d'actions canadiennes CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Au 30 juin 2022

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar australien	(43 910)	306 914	263 004	1,4	13 150
Livre sterling	65 086	(65 796)	(710)	–	(36)
Renminbi chinois	384	–	384	–	19
Couronne danoise	20 784	–	20 784	0,1	1 039
Euro	75 861	84 960	160 821	0,9	8 041
Dollar de Hong Kong	66 915	(170 635)	(103 720)	(0,6)	(5 186)
Forint hongrois	(5 998)	–	(5 998)	–	(300)
Nouveau shekel israélien	28 535	–	28 535	0,2	1 427
Yen japonais	23 246	248 561	271 807	1,5	13 590
Peso mexicain	3 284	–	3 284	–	164
Dollar néo-zélandais	6 580	–	6 580	–	329
Couronne norvégienne	17 155	(120 120)	(102 965)	(0,5)	(5 148)
Peso philippin	35	–	35	–	2
Dollar de Singapour	18 014	–	18 014	0,1	901
Rand sud-africain	(26 745)	77 243	50 498	0,3	2 525
Couronne suédoise	7 546	–	7 546	–	377
Franc suisse	39 293	–	39 293	0,2	1 965
Dollar américain	725 928	(89 566)	636 362	3,4	31 818
Total	1 021 993	271 561	1 293 554	7,0	64 677

Au 31 décembre 2021

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar australien	53 488	393 982	447 470	1,8	22 374
Livre sterling	87 600	150 557	238 157	1,0	11 908
Couronne danoise	22 821	–	22 821	0,1	1 141
Euro	64 949	116 353	181 302	0,7	9 065
Dollar de Hong Kong	33 807	(369 080)	(335 273)	(1,4)	(16 764)
Forint hongrois	(5 172)	–	(5 172)	–	(259)
Nouveau shekel israélien	58 106	–	58 106	0,2	2 905
Yen japonais	(17 073)	63 456	46 383	0,2	2 319
Peso mexicain	6 053	–	6 053	–	303
Dollar néo-zélandais	21 613	–	21 613	0,1	1 081
Couronne norvégienne	38 971	–	38 971	0,2	1 949
Peso Philippin	7	–	7	–	–
Zloty polonais	574	–	574	–	29
Dollar de Singapour	21 949	–	21 949	0,1	1 097
Rand sud-africain	24 034	–	24 034	0,1	1 202
Couronne suédoise	90 774	(78 687)	12 087	–	604
Franc suisse	19 211	–	19 211	0,1	961
Dollar américain	288 321	127 753	416 074	1,7	20 804
Total	810 033	404 334	1 214 367	4,9	60 719

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, 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 2022 et au 31 décembre 2021, 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 1 755 000 \$ (2 375 000 \$ au 31 décembre 2021). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Risque de crédit

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, 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 4,1 % (2,4 % au 31 décembre 2021) 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 2022 et 2021, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2022	2021
	(\$)	(\$)
Revenus bruts tirés du prêt de titres	1 422	2 346
Charges liées au prêt de titres	(281)	(468)
Revenus nets tirés du prêt de titres	1 141	1 878
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	(85)	(31)
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	1 056	1 847

Les charges liées au prêt de titres ont représenté 19,8 % (19,9 % en 2021) 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 2022 et au 31 décembre 2021.

	30 juin 2022	31 décembre 2021
	(en milliers de \$)	(en milliers de \$)
Titres prêtés	844	924
Garanties reçues	886	970
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Effet de levier et emprunt (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2022 et de l'exercice clos le 31 décembre 2021, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié entre 65,4 % et 130,8 % (entre 62,4 % et 70,6 % en 2021) 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 2022, l'exposition totale du Fonds correspondait à 74,5 % (62,4 % au 31 décembre 2021) 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 2022 et de l'exercice clos le 31 décembre 2021, le niveau de la dette bancaire du Fonds était de 2 518 906 \$ à 12 262 358 \$ (de 1 915 637 \$ à 3 443 789 \$ en 2021) avec un taux d'intérêt moyen de 0,83 % (0,29 % en 2021). Au 30 juin 2022, la dette bancaire correspondait à 19,7 % (7,7 % au 31 décembre 2021) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de la situation financière aux

	30 juin 2022 (non audité)	31 décembre 2021 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	1 082 553 \$	852 931 \$
Placements à court terme	4 172 651	13 912 881
Placements	48 506 813	52 431 222
Plus-value latente des contrats de change à terme	128 681	101 010
Plus-value latente des contrats à terme normalisés	216 699	61 714
Plus-value latente des swaps sur défaillance de crédit	–	4 147
Marge de variation quotidienne	784 119	549 430
Montant à recevoir du courtier	317 338	–
Intérêts à recevoir	487 892	550 241
Autres créances	453	–
Souscriptions à recevoir	300	10 000
	<hr/>	<hr/>
	55 697 499	68 473 576
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	1 027 215	665 817
Placements vendus à découvert	25 930 366	30 637 333
Moins-value latente des contrats de change à terme	286 860	63 356
Moins-value latente des contrats à terme normalisés	201 725	41 873
Moins-value latente des contrats de swap	–	71 623
Moins-value latente des swaps sur défaillance de crédit	10 706	2 489
Intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	291 526	167 645
Montant à payer au courtier	1 550 857	–
Frais d'emprunt de titres à payer	7 063	111
Charges à payer	33 450	35 397
Frais de gestion à payer	2 234	1 366
Rémunération au rendement à payer	–	4 408
Rachats à payer	143 540	–
	<hr/>	<hr/>
	29 485 542	31 691 418
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	<hr/> 26 211 957 \$	<hr/> 36 782 158 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de la situation financière aux

	30 juin 2022 (non audité)	31 décembre 2021 (audité)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	105 243 \$	99 388 \$
Série F	2 874 237 \$	2 781 622 \$
Série I	23 232 477 \$	33 901 148 \$
	<hr/>	<hr/>
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	12 555	10 663
Série F	333 173	291 593
Série I	2 582 314	3 416 269
	<hr/>	<hr/>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	8,38 \$	9,32 \$
Série F	8,63 \$	9,54 \$
Série I	9,00 \$	9,92 \$
	<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

	2022	2021
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	(77 668) \$	(62 743) \$
Variation du gain (perte) de change latent	(16 779)	5 681
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	811	766
Autres revenus (pertes)	12 000	806
Gain (perte) net sur placements		
Intérêts aux fins des distributions	1 163 775	1 116 089
Charges d'intérêts sur les titres vendus à découvert	(459 772)	(347 444)
Gain (perte) net réalisé sur les placements	(2 771 971)	(419 546)
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	1 258 978	560 992
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	67 665	467 897
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme à terme sur obligations	-	(80 374)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	(164 099)	292 485
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	(437 918)	(3 660)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	(4 045 641)	(211 101)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	2 893 113	10 365
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	(195 833)	(190 294)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats à terme sur obligations	-	(20 745)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats à terme normalisés	(4 867)	25 609
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	59 259	21 034
Gain (perte) net total sur placements	(2 637 311)	1 221 307
Total des revenus (pertes) nets	(2 718 947)	1 165 817
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	13 191	10 172
Honoraires des dépositaires	38 325	26 807
Frais de dépôt	22 251	18 885
Honoraires du comité d'examen indépendant	2 480	2 476
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	321	313
Charges d'intérêts	2 116	441
Frais de gestion	7 844	4 665
Rémunération au rendement	-	8 338
Coût d'emprunt de titres	49 552	31 028
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	5 803	5 430
Coûts d'opérations (note 9)	4 453	4 234
Total des charges d'exploitation	146 336	112 789
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 865 283) \$	1 053 028 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2022	2021
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	(8 862) \$	2 406 \$
Série F	(242 046) \$	40 931 \$
Série I	(2 614 375) \$	1 009 691 \$
	<hr/>	<hr/>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	11 084	11 667
Série F	311 871	153 916
Série I	3 355 634	2 920 594
	<hr/>	<hr/>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	(0,80) \$	0,21 \$
Série F	(0,78) \$	0,27 \$
Série I	(0,78) \$	0,35 \$
	<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 2022	Série A 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	99 388 \$	129 112 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(8 862)	2 406
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	26 000	25 000
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	1 304	1 490
Rachat de parts rachetables	(11 089)	(37 705)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	16 215	(11 215)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(1 498)	(1 676)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 498)	(1 676)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	5 855	(10 485)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	105 243 \$	118 627 \$
	Série F 2022	Série F 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	2 781 622 \$	1 528 419 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(242 046)	40 931
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	557 871	222 000
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	34 881	19 730
Rachat de parts rachetables	(214 978)	(236 709)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	377 774	5 021
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(43 113)	(22 376)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(43 113)	(22 376)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	92 615	23 576
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	2 874 237 \$	1 551 995 \$

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 2022	Série I 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	33 901 148 \$	27 639 812 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 614 375)	1 009 691
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	259 322	3 163 250
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	472 889	441 781
Rachat de parts rachetables	(8 313 618)	(8 689)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(7 581 407)	3 596 342
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(472 889)	(441 781)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(472 889)	(441 781)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(10 668 671)	4 164 252
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	23 232 477 \$	31 804 064 \$
	Total 2022	Total 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	36 782 158 \$	29 297 343 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 865 283)	1 053 028
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	843 193	3 410 250
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	509 074	463 001
Rachat de parts rachetables	(8 539 685)	(283 103)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(7 187 418)	3 590 148
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(517 500)	(465 833)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(517 500)	(465 833)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(10 570 201)	4 177 343
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	26 211 957 \$	33 474 686 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2022	2021
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 865 283) \$	1 053 028 \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	16 779	(5 681)
(Gain) perte net réalisé sur les placements	2 771 971	419 546
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	(1 258 978)	(560 992)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	4 045 641	211 101
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	(2 893 113)	(10 365)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	195 833	190 294
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats à terme sur obligations	-	20 745
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats à terme normalisés	4 867	(25 609)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	(59 259)	(21 034)
Achat de placements	(310 013 135)	(194 753 477)
Produit des placements vendus	317 538 805	190 483 153
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	(234 689)	(225 568)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	62 349	(42 106)
(Augmentation) diminution des autres créances	(453)	(507)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	6 952	(1 368)
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	123 881	18 625
Augmentation (diminution) des charges à payer	(1 947)	(7 424)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	868	(42)
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	(4 408)	(3 335)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	7 436 681	(3 261 016)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	851 842	3 294 128
Rachat de parts rachetables**	(8 395 094)	(278 103)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des réinvestissements	(8 426)	(2 832)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(7 551 678)	3 013 193
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	(114 997)	(247 823)
Variation du gain (perte) de change latent	(16 779)	5 681
Trésorerie, à l'ouverture de la période	852 931	501 870
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	(665 817)	-
	55 338	259 728
Trésorerie, à la clôture de la période	1 082 553 \$	418 013 \$
Dette bancaire, à la clôture de la période	(1 027 215) \$	(158 285) \$
	55 338 \$	259 728 \$
Intérêts reçus*	1 226 124 \$	1 073 983 \$
Intérêts payés*	338 007	329 260

* Inclus dans les activités d'exploitation.

** Déduction faite d'échanges hors trésorerie de 1 051 \$ (0 \$ en 2021)

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	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 2021 : 25,32 %)						
Bons du Trésor du Canada	1,840	18 août 2022	60 000	59 722	59 859	
Bons du Trésor du Canada	1,992	15 sept. 2022	1 138 000	1 132 627	1 133 278	
Bons du Trésor du Canada	2,110	29 sept. 2022	2 995 000	2 979 087	2 979 514	
				4 171 436	4 172 651	15,92
Billets à ordre (31 décembre 2021 : 12,50 %)						
Total des placements à court terme – position acheteur						
				4 171 436	4 172 651	15,92
Obligations – position acheteur						
Obligations fédérales canadiennes (31 décembre 2021 : 7,62 %)						
Obligations du gouvernement du Canada	0,250	1 ^{er} mars 2026	53 000	47 450	47 831	
Obligations du gouvernement du Canada	0,500	1 ^{er} déc. 2030	4 533 000	3 599 548	3 629 059	
Obligations du gouvernement du Canada	1,500	1 ^{er} déc. 2031	2 338 000	2 104 192	2 012 739	
Obligations du gouvernement du Canada	2,000	1 ^{er} juin 2032	1 864 000	1 643 777	1 671 431	
Obligations du gouvernement du Canada	2,000	1 ^{er} déc. 2051	786 000	608 972	612 259	
Obligations du gouvernement du Canada	2,750	1 ^{er} déc. 2064	691 000	787 676	624 140	
Obligations à rendement réel du gouvernement du Canada	0,577	1 ^{er} déc. 2050	186 000	228 722	170 884	
				9 020 337	8 768 343	33,45
Obligations provinciales canadiennes (31 décembre 2021 : 24,32 %)						
Province de l'Alberta	3,100	1 ^{er} juin 2050	855 000	1 002 952	710 064	
Province de l'Alberta	2,950	1 ^{er} juin 2052	11 000	11 022	8 860	
Province de la Colombie-Britannique	2,750	18 juin 2052	1 038 000	992 968	793 163	
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	3,150	2 déc. 2052	643 000	637 560	502 500	
Province d'Ontario	1,850	1 ^{er} fév. 2027	180 000	189 815	167 144	
Province d'Ontario	2,050	2 juin 2030	1 064 000	978 533	930 185	
Province de Saskatchewan	3,100	2 juin 2050	310 000	373 674	254 179	
Province de Saskatchewan	2,800	2 déc. 2052	203 000	174 262	155 402	
				4 360 786	3 521 497	13,43
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2021 : 18,41 %)						
Banque de Montréal	3,650	1 ^{er} avr. 2027	1 124 000	1 086 279	1 075 224	
Banque de Montréal	4,309	1 ^{er} juin 2027	536 000	535 685	527 018	
Banque de Montréal	2,077	17 juin 2030	283 000	258 770	261 237	
Banque de Montréal	1,928	22 juill. 2031	197 000	175 098	174 639	
Banque de Montréal	4,800	31 déc. 2049	157 000	216 600	182 761	
La Banque de Nouvelle-Écosse	3,890	18 janv. 2029	226 000	223 180	223 358	
La Banque de Nouvelle-Écosse	2,836	3 juill. 2029	646 000	624 142	622 662	
La Banque de Nouvelle-Écosse	3,934	3 mai 2032	340 000	339 980	321 589	
La Banque de Nouvelle-Écosse	4,900	31 déc. 2049	294 000	399 987	353 477	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2,750	7 mars 2025	521 000	506 389	498 475	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	4,950	29 juin 2027	700 000	698 929	704 944	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2,010	21 juill. 2030	466 000	428 950	427 812	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	1,960	21 avril 2031	138 000	132 137	123 475	
Le Fonds de placement immobilier First Capital	4,790	30 août 2024	100 000	107 162	99 101	
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	1,540	3 mai 2028	69 000	66 546	59 314	
Intact Corporation financière	3,691	24 mars 2025	217 000	219 804	213 225	
Intact Corporation financière	2,850	7 juin 2027	464 000	491 902	429 280	
Inter Pipeline Ltd.	6,625	19 nov. 2079	102 000	107 903	94 778	
Banque Laurentienne du Canada	4,600	2 sept. 2025	123 000	123 037	122 215	
Banque Nationale du Canada	2,580	3 fév. 2025	240 000	232 215	229 117	
Rogers Communications Inc.	5,000	17 déc. 2081	192 000	192 000	174 710	
Rogers Communications Inc.	5,250	15 mars 2082	350 000	443 836	393 771	
Banque Royale du Canada	2,880	23 déc. 2029	212 000	201 074	202 512	
Banque Royale du Canada	2,088	30 juin 2030	30 000	27 410	27 710	
Banque Royale du Canada	2,140	3 nov. 2031	161 000	145 527	142 798	
Suncor Énergie Inc.	5,000	9 avr. 2030	257 000	287 100	254 574	
La Banque Toronto-Dominion	4,210	1 ^{er} juin 2027	354 000	354 000	346 862	
La Banque Toronto-Dominion	3,105	22 avr. 2030	315 000	301 300	300 645	
La Banque Toronto-Dominion	4,859	4 mars 2031	57 000	57 622	56 753	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
La Banque Toronto-Dominion	5,750	31 déc. 2049	389 000	389 000	372 816	
Transcanada Trust	4,650	18 mai 2077	169 000	171 858	155 198	
				9 545 422	9 172 050	34,99
Obligations de sociétés américaines (31 décembre 2021 : 84,27 %)						
AMC Entertainment Holdings Inc.	10,000	15 juin 2026	793 000	894 135	682 272	
American Airlines 2016-3, cat. B, à flux identiques	3,750	15 oct. 2025	98 470	105 292	112 858	
AT&T Inc.	1,650	1 ^{er} fév. 2028	481 000	541 524	538 249	
AT&T Inc.	2,250	1 ^{er} fév. 2032	154 000	174 924	162 747	
AT&T Inc.	2,550	1 ^{er} déc. 2033	125 000	150 326	131 417	
AT&T Inc.	4,850	25 mai 2047	5 000	4 891	4 313	
AT&T Inc.	3,650	1 ^{er} juin 2051	119 000	151 940	121 103	
AT&T Inc.	3,300	1 ^{er} fév. 2052	235 000	235 975	225 069	
Avis Budget Car Rental LLC	5,750	15 juill. 2027	220 000	255 324	252 638	
Cable One Inc.	4,000	15 nov. 2030	429 000	485 397	454 533	
Calpine Corp.	4,625	1 ^{er} fév. 2029	280 000	340 027	301 099	
CCO Holdings LLC	5,000	1 ^{er} fév. 2028	277 000	321 120	330 114	
CCO Holdings LLC	4,750	1 ^{er} mars 2030	182 000	203 637	201 702	
Centene Corp.	2,450	15 juill. 2028	1 041 000	1 182 452	1 124 371	
Charter Communications Operating LLC	5,050	30 mars 2029	241 000	304 423	300 154	
Charter Communications Operating LLC	2,300	1 ^{er} fév. 2032	437 000	436 653	428 378	
Charter Communications Operating LLC	5,250	1 ^{er} avr. 2053	48 000	54 920	53 014	
Cinemark USA Inc.	5,875	15 mars 2026	832 000	1 046 243	958 621	
Cinemark USA Inc.	5,250	15 juill. 2028	205 000	246 388	212 939	
Comcast Corp.	2,937	1 ^{er} nov. 2056	172 000	159 723	155 347	
Consolidated Communications Inc.	6,500	1 ^{er} oct. 2028	208 000	230 801	226 454	
Continental Resources Inc.	4,500	15 avr. 2023	38 000	46 691	49 268	
Continental Resources Inc.	5,750	15 janv. 2031	169 000	247 237	210 475	
CSC Holdings LLC	5,375	1 ^{er} fév. 2028	570 000	702 964	637 881	
CSC Holdings LLC	5,750	15 janv. 2030	120 000	131 046	113 031	
CSC Holdings LLC	4,500	15 nov. 2031	46 000	48 771	45 800	
Equinix Inc.	2,150	15 juill. 2030	681 000	790 650	713 287	
Ford Motor Co.	3,250	12 fév. 2032	344 000	399 262	330 590	
Ford Motor Credit Co LLC	4,063	1 ^{er} nov. 2024	1 148 000	1 361 067	1 404 977	
Ford Motor Credit Co LLC	4,271	9 janv. 2027	48 000	57 728	55 652	
Frontier Communications Holdings LLC	5,875	1 ^{er} nov. 2029	256 000	260 101	254 787	
GLP Capital LP	4,000	15 janv. 2030	434 000	502 613	491 160	
HCA Inc.	4,125	15 juin 2029	307 000	369 268	362 129	
Iron Mountain Inc.	5,250	15 juill. 2030	157 000	208 421	176 458	
Kraft Heinz Foods Co.	3,875	15 mai 2027	460 000	603 681	575 194	
Kraft Heinz Foods Co.	4,375	1 ^{er} juin 2046	186 000	207 300	201 488	
Level 3 Financing Inc.	3,400	1 ^{er} mars 2027	260 000	308 121	289 402	
Level 3 Financing Inc.	4,625	15 sept. 2027	82 000	113 343	90 483	
Level 3 Financing Inc.	4,250	1 ^{er} juill. 2028	209 000	281 800	218 657	
Lithia Motors Inc.	4,625	15 déc. 2027	175 000	216 995	207 165	
Lithia Motors Inc.	3,875	1 ^{er} juin 2029	1 379 000	1 640 980	1 514 806	
Live Nation Entertainment Inc.	5,625	15 mars 2026	371 000	459 886	455 219	
Live Nation Entertainment Inc.	3,750	15 janv. 2028	4 000	5 017	4 476	
Lumen Technologies Inc.	4,500	15 janv. 2029	237 000	238 976	228 406	
Molina Healthcare Inc.	3,875	15 nov. 2030	182 000	198 188	201 049	
NRG Energy Inc.	2,000	2 déc. 2025	234 000	295 274	272 765	
NRG Energy Inc.	4,450	15 juin 2029	142 000	200 583	164 465	
Ovintiv Exploration Inc.	5,375	1 ^{er} janv. 2026	49 000	68 657	64 045	
Pacific Gas and Electric Co.	4,550	1 ^{er} juill. 2030	217 000	278 613	249 561	
Penn National Gaming Inc.	4,125	1 ^{er} juill. 2029	506 000	596 149	496 183	
Performance Food Group Inc.	5,500	15 oct. 2027	317 000	383 490	379 270	
Performance Food Group Inc.	4,250	1 ^{er} août 2029	212 000	235 198	228 490	
Premier Entertainment Sub LLC	5,625	1 ^{er} sept. 2029	316 000	366 757	290 833	
Premier Entertainment Sub LLC	5,875	1 ^{er} sept. 2031	70 000	84 248	62 792	
Sensata Technologies Inc.	3,750	15 fév. 2031	269 000	323 770	278 719	
Sprint Corp.	7,625	15 fév. 2025	704 000	1 014 805	948 653	
Station Casinos LLC	4,500	15 fév. 2028	359 000	404 357	391 801	
Sysco Corp.	3,250	15 juill. 2027	741 000	919 524	912 195	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Sysco Corp.	5,950	1 ^{er} avr. 2030	104 000	141 963	143 522	
Sysco Corp.	3,150	14 déc. 2051	300 000	286 205	279 538	
T-Mobile USA Inc.	3,375	15 avr. 2029	677 000	856 054	765 967	
United Rentals North America Inc.	4,000	15 juill. 2030	108 000	122 389	119 341	
Univision Communications Inc.	7,375	30 juin 2030	41 000	51 411	51 972	
US Foods Inc.	4,625	1 ^{er} juin 2030	168 000	188 311	184 853	
Verizon Communications Inc.	2,375	22 mars 2028	16 000	14 774	14 103	
Verizon Communications Inc.	2,550	21 mars 2031	1 322 000	1 560 194	1 463 420	
VICI Properties LP	4,625	15 juin 2025	11 000	14 809	13 522	
VMware Inc.	1,800	15 août 2028	904 000	1 092 694	971 402	
				26 426 450	24 556 644	93,68
Obligations étrangères (31 décembre 2021 : 7,92 %)						
Carnival Corp.	5,750	1 ^{er} mars 2027	481 000	588 547	452 731	
Nabors Industries Ltd.	7,500	15 juin 2028	277 000	337 601	307 753	
NCL Corp. Ltd.	5,875	15 mars 2026	270 000	342 627	273 406	
Nissan Motor Co., Ltd.	4,810	17 sept. 2030	775 000	1 031 892	891 141	
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5,500	1 ^{er} avr. 2028	344 000	373 703	309 448	
Sensata Technologies BV	4,000	15 avr. 2029	106 000	135 140	116 265	
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd.	5,625	15 fév. 2029	135 000	162 770	137 535	
				2 972 280	2 488 279	9,49
Total des obligations – position acheteur				52 325 275	48 506 813	185,04
Obligations – position vendeur						
Obligations fédérales canadiennes (31 décembre 2021 : -27,95 %)						
Obligations du gouvernement du Canada	1,500	1 ^{er} mai 2024	(3 684 000)	(3 583 132)	(3 579 917)	
Obligations du gouvernement du Canada	1,250	1 ^{er} mars 2025	(79 000)	(75 344)	(75 282)	
Obligations du gouvernement du Canada	1,500	1 ^{er} juin 2026	(53 000)	(52 772)	(49 944)	
Obligations du gouvernement du Canada	1,000	1 ^{er} juin 2027	(2 346 000)	(2 200 860)	(2 124 325)	
Obligations du gouvernement du Canada	2,000	1 ^{er} juin 2028	(118 000)	(119 416)	(110 882)	
Obligations du gouvernement du Canada	2,250	1 ^{er} juin 2029	(931 000)	(872 178)	(879 225)	
Obligations du gouvernement du Canada	5,000	1 ^{er} juin 2037	(86 000)	(124 131)	(103 661)	
				(7 027 833)	(6 923 236)	(26,41)
Obligations provinciales canadiennes (31 décembre 2021 : -16,67 %)						
Province d'Ontario	2,550	2 déc. 2052	(1 333 000)	(1 021 485)	(963 447)	
Province de Québec	3,100	1 ^{er} déc. 2051	(3 021 000)	(3 381 608)	(2 482 879)	
Province de Québec	2,850	1 ^{er} déc. 2053	(633 000)	(576 386)	(491 422)	
				(4 979 479)	(3 937 748)	(15,02)
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2021 : -10,02 %)						
Baytex Energy Corp.	8,750	1 ^{er} avr. 2027	(838 000)	(1 114 128)	(1 085 534)	
Brookfield Renewable Partners ULC	4,250	15 janv. 2029	(474 000)	(537 991)	(458 424)	
Capital Power Corp.	3,147	1 ^{er} oct. 2032	(708 000)	(689 837)	(573 520)	
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	2,981	4 mars 2030	(212 000)	(210 315)	(180 447)	
Enbridge Inc.	5,375	27 sept. 2077	(85 000)	(80 147)	(79 514)	
Great-West Lifeco Inc.	2,981	8 juill. 2050	(230 000)	(201 512)	(157 047)	
Inter Pipeline Ltd.	4,232	1 ^{er} juin 2027	(17 000)	(16 527)	(16 220)	
Inter Pipeline Ltd.	3,983	25 nov. 2031	(11 000)	(10 378)	(9 412)	
Les Compagnies Loblaw ltée	2,284	7 mai 2030	(1 042 000)	(1 025 011)	(860 103)	
Ontario Power Generation Inc.	3,651	13 sept. 2050	(442 000)	(454 048)	(350 403)	
Rogers Communications Inc.	6,560	22 mars 2041	(85 000)	(113 790)	(90 151)	
Toronto Hydro Corp.	2,990	10 déc. 2049	(180 000)	(181 276)	(132 624)	
TransCanada PipeLines Ltd.	3,800	5 avr. 2027	(37 000)	(35 969)	(35 466)	
				(4 670 929)	(4 028 865)	(15,37)
Obligations américaines (31 décembre 2021 : -27,82 %)						
Allison Transmission Inc.	5,875	1 ^{er} juin 2029	(963 000)	(1 210 307)	(1 157 639)	
Allison Transmission Inc.	3,750	30 janv. 2031	(263 000)	(302 074)	(272 499)	
American Airlines Inc.	5,750	20 avr. 2029	(624 000)	(768 382)	(691 739)	
Aramark Services Inc.	5,000	1 ^{er} fév. 2028	(525 000)	(632 689)	(615 132)	
Callon Petroleum Co.	8,000	1 ^{er} août 2028	(498 000)	(641 495)	(618 035)	
Callon Petroleum Co.	7,500	15 juin 2030	(49 000)	(60 273)	(58 467)	
Calpine Corp.	3,750	1 ^{er} mars 2031	(101 000)	(125 642)	(105 590)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	7,500	1 ^{er} juin 2029	(246 000)	(325 090)	(228 635)	
Cleveland-Cliffs Inc.	4,625	1 ^{er} mars 2029	(8 000)	(9 408)	(9 047)	
Cleveland-Cliffs Inc.	4,875	1 ^{er} mars 2031	(130 000)	(155 562)	(148 217)	
Conagra Brands Inc.	5,400	1 ^{er} nov. 2048	(81 000)	(128 629)	(99 441)	
Cumulus Media New Holdings Inc.	6,750	1 ^{er} juill. 2026	(382 000)	(465 477)	(454 646)	
Delta Air Lines Inc.	7,375	15 janv. 2026	(297 000)	(404 533)	(383 077)	
Kroger Co.	3,950	15 janv. 2050	(156 000)	(206 330)	(171 378)	
Lamar Media Corp.	3,750	15 fév. 2028	(373 000)	(439 237)	(423 167)	
Lamar Media Corp.	4,875	15 janv. 2029	(369 000)	(454 102)	(429 107)	
Lamar Media Corp.	4,000	15 fév. 2030	(135 000)	(157 346)	(146 497)	
Lamar Media Corp.	3,625	15 janv. 2031	(90 000)	(105 854)	(95 204)	
Nordstrom Inc.	5,000	15 janv. 2044	(379 000)	(414 565)	(349 823)	
Outfront Media Capital LLC	5,000	15 août 2027	(234 000)	(277 280)	(264 128)	
Outfront Media Capital LLC	4,625	15 mars 2030	(376 000)	(415 548)	(382 910)	
Radiate Holdco LLC	4,500	15 sept. 2026	(60 000)	(70 131)	(66 855)	
Scripps Escrow II Inc.	3,875	15 janv. 2029	(290 000)	(310 493)	(311 171)	
United Airlines Inc.	4,625	15 avr. 2029	(438 000)	(491 635)	(477 595)	
United Rentals North America Inc.	5,250	15 janv. 2030	(1 027 000)	(1 389 008)	(1 231 083)	
United States Steel Corp.	6,875	1 ^{er} mars 2029	(130 000)	(154 231)	(145 460)	
United States Steel Corp.	6,650	1 ^{er} juin 2037	(151 000)	(161 716)	(157 157)	
United States Treasury Note/Bond	2,375	15 mai 2051	(142 000)	(151 598)	(155 984)	
United States Treasury Note/Bond	2,250	15 fév. 2052	(609 000)	(635 290)	(652 280)	
Vistra Operations Co LLC	5,625	15 fév. 2027	(590 000)	(737 823)	(715 121)	
Vistra Operations Co LLC	5,000	31 juill. 2027	(20 000)	(24 504)	(23 433)	
				<u>(11 826 252)</u>	<u>(11 040 517)</u>	(42,12)
Total des obligations – position vendeur				<u>(28 504 493)</u>	<u>(25 930 366)</u>	(98,92)
Total des placements				<u>27 992 218</u>	<u>26 749 098</u>	102,04
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)					128 681	0,49
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)					(286 860)	(1,09)
Total de la plus-value latente des contrats à terme normalisés (Annexe 2)					216 699	0,83
Total de la moins-value latente des contrats à terme normalisés (Annexe 2)					(201 725)	(0,77)
Total de la moins-value latente des swaps sur défaillance de crédit (Annexe 3)					(10 706)	(0,04)
Autres actifs, moins les passifs					<u>(383 230)</u>	<u>(1,46)</u>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables					<u>26 211 957</u>	<u>100,00</u>

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 2022

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	(3 885 832)	USD	3 088 872	21 sept. 2022	97 613
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(491 834)	USD	382 000	21 sept. 2022	856
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(262 655)	USD	204 000	21 sept. 2022	457
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(43 419)	USD	34 000	21 sept. 2022	431
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(620 000)	CAD	807 829	21 sept. 2022	8 124
Banque Royale du Canada	CAD	(149 392)	USD	116 000	21 sept. 2022	222
Banque Royale du Canada	USD	(137 000)	CAD	178 121	21 sept. 2022	1 414
Banque Royale du Canada	USD	(439 000)	CAD	567 232	21 sept. 2022	1 014
Banque Royale du Canada	USD	(46 000)	CAD	59 656	21 sept. 2022	324
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(289 602)	USD	231 000	21 sept. 2022	8 293
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(151 670)	USD	120 825	21 sept. 2022	4 146
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(724 440)	USD	563 000	21 sept. 2022	1 696
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(114 521)	USD	89 000	21 sept. 2022	268
La Banque Toronto-Dominion	USD	(1 198 000)	CAD	1 548 862	21 sept. 2022	3 689
La Banque Toronto-Dominion	USD	(45 550)	CAD	58 884	21 sept. 2022	134
						128 681
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(60 745)	USD	47 000	21 sept. 2022	(125)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(195 601)	USD	151 011	21 sept. 2022	(827)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(764 564)	USD	592 000	21 sept. 2022	(1 010)
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(5 000)	CAD	6 347	21 sept. 2022	(102)
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(4 508)	CAD	5 671	21 sept. 2022	(142)
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(117 000)	CAD	147 049	21 sept. 2022	(3 835)
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(236 000)	CAD	295 880	21 sept. 2022	(8 463)
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(1 291 000)	CAD	1 622 565	21 sept. 2022	(42 315)
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(7 161 265)	CAD	9 008 943	21 sept. 2022	(226 309)
Banque Royale du Canada	CAD	(19 395)	USD	15 000	21 sept. 2022	(48)
Banque Royale du Canada	CAD	(69 773)	USD	54 000	21 sept. 2022	(125)
Banque Royale du Canada	CAD	(18 202)	USD	14 000	21 sept. 2022	(144)
Banque Royale du Canada	CAD	(38 879)	USD	30 000	21 sept. 2022	(184)
Banque Royale du Canada	CAD	(1 069 293)	USD	827 000	21 sept. 2022	(2 633)
Banque Royale du Canada	USD	(119 000)	CAD	153 255	21 sept. 2022	(227)
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(57 024)	USD	44 000	21 sept. 2022	(272)
La Banque Toronto-Dominion	USD	(56 000)	CAD	72 196	21 sept. 2022	(31)
La Banque Toronto-Dominion	USD	(15 583)	CAD	20 030	21 sept. 2022	(68)
						(286 860)
						(158 179)

* 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 2022

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. 2022	(97)	(10 950 330)	198 025
Contrats à terme normalisés sur bons du Trésor américain à 10 ans, CBOT	21 sept. 2022	(13)	(1 987 692)	13 614
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 10 ans	20 sept. 2022	5	619 950	4 100
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 2 ans, MTL	20 sept. 2022	(1)	(104 540)	960
			(12 422 612)	216 699
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 2 ans, MTL	20 sept. 2022	(20)	(2 090 800)	(1 300)
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 5 ans	20 sept. 2022	(8)	(903 120)	(9 200)
Contrats à terme normalisés sur bons du Trésor américain à 10 ans, CBOT	21 sept. 2022	(31)	(4 739 881)	(45 330)
Contrats à terme normalisés sur obligations, CBOT Ultra	21 sept. 2022	10	1 990 957	(58 420)
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 10 ans	20 sept. 2022	23	2 851 770	(87 475)
			(2 891 074)	(201 725)
			(15 313 686)	14 974

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

Au 30 juin 2022

Description	Date d'entrée en vigueur	Date d'expiration	Notionnel	Juste valeur \$	Plus-value (moins-value) latente \$
CDX.NA.HY.38 5 %	20 juin 2022	20 juin 2027	10 880 USD	(394)	(157)
CDX.NA.HY.38 5 %	27 juin 2022	20 juin 2027	303 930 USD	(10 997)	(6 867)
CDX.NA.HY.38 5 %	28 juin 2022	20 juin 2027	152 460 USD	(5 517)	(3 682)
				(16 908)	(10 706)
				(16 908)	(10 706)

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (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 2022

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– \$	4 172 651 \$	– \$	4 172 651 \$
Obligations – position acheteur	–	48 506 813	–	48 506 813
Contrats de change à terme	–	128 681	–	128 681
Contrats à terme normalisés	216 699	–	–	216 699
	216 699 \$	52 808 145 \$	– \$	53 024 844 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Obligations – position vendeur	– \$	25 930 366 \$	– \$	25 930 366 \$
Contrats de change à terme	–	286 860	–	286 860
Contrats à terme normalisés	201 725	–	–	201 725
Swaps sur défaillance de crédit	10 706	–	–	10 706
	212 431 \$	26 217 226 \$	– \$	26 429 657 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Au 31 décembre 2021

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– \$	13 912 881 \$	– \$	13 912 881 \$
Obligations – position acheteur	–	52 431 222	–	52 431 222
Contrats de change à terme	–	101 010	–	101 010
Contrats à terme normalisés	61 714	–	–	61 714
Swaps sur défaillance de crédit	4 147	–	–	4 147
	65 861 \$	66 445 113 \$	– \$	66 510 974 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Obligations – position vendeur	– \$	30 637 333 \$	– \$	30 637 333 \$
Contrats de change à terme	–	63 356	–	63 356
Contrats à terme normalisés	41 873	–	–	41 873
Swaps sur défaillance de crédit	2 489	–	–	2 489
Contrats de swap	–	71 623	–	71 623
	44 362 \$	30 772 312 \$	– \$	30 816 674 \$

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 2022 et l'exercice clos le 31 décembre 2021. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2022 et l'exercice clos le 31 décembre 2021, 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
2022					
Série A	10 663	2 975	149	(1 232)	12 555
Série F	291 593	61 232	3 871	(23 523)	333 173
Série I	3 416 269	26 804	50 284	(911 043)	2 582 314

2021

Série A	13 335	3 065	717	(6 454)	10 663
Série F	156 304	159 869	15 013	(39 593)	291 593
Série I	2 752 328	431 854	237 166	(5 079)	3 416 269

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2021, le Fonds disposait de pertes en capital inutilisées de néant (néant au 31 décembre 2020) 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 2020).

Au cours de la période, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2021).

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (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 2022, GFCC&L détenait 5 982 parts de série A, 6 032 parts de série F et 2 128 058 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 50 149 \$, de 52 041 \$ et de 19 146 989 \$ (5 891 parts de série A, 5 941 parts de série F et 2 962 012 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 54 904 \$, de 56 677 \$ et de 29 383 159 \$ au 31 décembre 2021).

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

Le Fonds a payé 4 453 \$ (4 234 \$ en 2021) 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 2021).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, 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 2022 et 2021 (non audité)

Au 30 juin 2022

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar américain	16 420 273	(6 305 531)	10 114 742	38,6	505 737
Total	16 420 273	(6 305 531)	10 114 742	38,6	505 737

Au 31 décembre 2021

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar américain	24 767 973	(11 209 199)	13 558 774	36,9	677 939
Total	24 767 973	(11 209 199)	13 558 774	36,9	677 939

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, 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 2022 et au 31 décembre 2021. 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 2022

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total \$	% de l'actif net
Moins de 1 an	4 221 919	16,1
De 1 à 3 ans	(248 129)	(1,0)
De 3 à 5 ans	2 681 495	10,2
Plus de 5 ans	20 093 813	76,7
Total	26 749 098	102,0

Au 31 décembre 2021

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total \$	% de l'actif net
Moins de 1 an	13 912 881	37,8
De 1 à 3 ans	(1 657 216)	(4,5)
De 3 à 5 ans	6 460 129	17,6
Plus de 5 ans	16 990 976	46,2
Total	35 706 770	97,1

Au 30 juin 2022, si les taux d'intérêt en vigueur avaient augmenté ou diminué de 1,0 %, toutes les autres variables demeurant inchangées, l'actif net aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 1 313 000 \$ (1 397 000 \$ au 31 décembre 2021). 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 2022 et 2021 (non audité)

Autre risque de prix

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, 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 2022 et au 31 décembre 2021. 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 2022

Notations des créances et des contreparties	Total \$	% de l'actif net
AAA	12 962 194	49,4
AA	2 015 169	7,7
A	5 833 626	22,3
BBB	16 433 699	62,7
BB	8 674 634	33,1
B	5 290 386	20,2
CCC	1 598 437	6,1
Total	52 808 145	201,5

Au 31 décembre 2021

Notations des créances et des contreparties	Total \$	% de l'actif net
AAA	2 981 896	8,1
AA	17 591 938	47,8
A	5 377 349	14,6
BBB	11 911 655	32,4
BB	18 032 629	49,0
B	8 515 294	23,2
CCC	2 034 352	5,5
Total	66 445 113	180,6

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Prêt de titres (note 12)

Pour les périodes closes les 30 juin 2022 et 2021, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2022	2021
	\$	\$
Revenus bruts tirés du prêt de titres	1 014	957
Charges liées au prêt de titres	(203)	(191)
Revenus nets tirés du prêt de titres	811	766
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	–	–
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	811	766

Les charges liées au prêt de titres ont représenté 20,0 % (20,0 % en 2021) 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 2022.

	30 juin 2022
	(en milliers de \$)
Titres prêtés	7 964
Garanties reçues	8 363
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %

Au 31 décembre 2021, il n'y avait aucun titre prêté.

Effet de levier (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2022 et de l'exercice clos le 31 décembre 2021, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié entre 85,2 % et 187,3 % (entre 82,8 % et 191,8 % en 2021) 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 2022, l'exposition totale du Fonds correspondait à 182,1 % (94,3 % au 31 décembre 2021) 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 et de contrats à terme sur obligations.

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 2022 et de l'exercice clos le 31 décembre 2021, le niveau de la dette bancaire du Fonds était de néant à 7 973 344 \$ (de 60 \$ à 2 546 241 \$ en 2021), avec un taux d'intérêt moyen de 5,32 % (4,99 % en 2021). Au 30 juin 2022, la dette bancaire correspondait à 3,9 % (1,8 % au 31 décembre 2021) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds de rendement absolu PCJ II

États de la situation financière aux

	30 juin 2022 (non audité)	31 décembre 2021 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	17 322 \$	9 \$
Placements à court terme	48 646 966	37 195 286
Placements	26 431 199	32 408 805
Montant à recevoir du courtier	1 886 787	1 108 727
Dividendes à recevoir	64 438	28 899
Autres créances	1 669	6 789
Souscriptions à recevoir	549 368	100 760
	<hr/>	<hr/>
	77 597 749	70 849 275
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	1 671 148	2 917 980
Placements vendus à découvert	23 690 290	29 355 109
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	75 472	56 438
Montant à payer au courtier	2 117 157	542 216
Frais d'emprunt de titres à payer	11 338	4 503
Charges à payer	30 526	27 304
Frais de gestion à payer	42 241	29 684
Rachats à payer	62 184	59 720
	<hr/>	<hr/>
	27 700 356	32 992 954
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	<hr/> 49 897 393 \$	<hr/> 37 856 321 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	1 556 625 \$	1 716 918 \$
Série F	44 113 960 \$	31 876 784 \$
Série I	4 226 808 \$	4 262 619 \$
	<hr/>	<hr/>
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	167 109	180 637
Série F	4 675 032	3 330 483
Série I	440 000	440 000
	<hr/>	<hr/>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	9,32 \$	9,50 \$
Série F	9,44 \$	9,57 \$
Série I	9,61 \$	9,69 \$
	<hr/>	<hr/>

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

Administrateur

« Tim Elliott »

Administrateur

Fonds de rendement absolu PCJ II

État du résultat global (non audité)

Pour le semestre clos le 30 juin 2021 et la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 30 juin 2021

	2022	2021
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	165 398 \$	72 770 \$
Variation du gain (perte) de change latent	(45 553)	510
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	155 835	88 672
Charges de dividendes sur les titres vendus à découvert	(284 630)	(159 708)
Intérêts aux fins des distributions	80 368	9 601
Gain (perte) net réalisé sur les placements	(1 545 441)	(159 628)
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	1 686 325	(515 211)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	(3 159 375)	774 027
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	3 048 908	(974 214)
Gain (perte) net total sur placements	<u>(18 010)</u>	<u>(936 461)</u>
Total des revenus (pertes) nets	<u>101 835</u>	<u>(863 181)</u>
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	13 191	7 511
Honoraires des dépositaires	23 723	5 571
Frais de dépôt	22 251	-
Honoraires du comité d'examen indépendant	2 480	1 600
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	321	-
Charges d'intérêts	3 729	578
Frais de gestion	234 192	65 302
Honoraires de professionnels	3 058	601
Coût d'emprunt de titres	70 004	10 611
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	24 454	11 296
Coûts d'opérations (note 9)	<u>109 813</u>	<u>57 188</u>
Total des charges d'exploitation	<u>507 216</u>	<u>160 258</u>
Retenues d'impôts (note 7)	<u>(6 638)</u>	<u>(2 250)</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>(412 019) \$</u>	<u>(1 025 689) \$</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	(34 377) \$	(40 811) \$
Série F	(341 831) \$	(813 210) \$
Série I	<u>(35 811) \$</u>	<u>(171 668) \$</u>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	173 108	96 604
Série F	3 911 850	1 730 304
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	(0,20) \$	(0,42) \$
Série F	(0,09) \$	(0,47) \$
Série I	<u>(0,08) \$</u>	<u>(0,39) \$</u>

Fonds de rendement absolu PCJ II

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)
Pour le semestre clos le 30 juin 2021 et la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 30 juin 2021

	Série A 2022	Série A 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	1 716 918 \$	– \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(34 377)	(40 811)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	–	1 480 283
Rachat de parts rachetables	(125 916)	
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(125 916)	1 480 283
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(160 293)	1 439 472
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	1 556 625 \$	1 439 472 \$
	Série F 2022	Série F 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	31 876 784 \$	– \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(341 831)	(813 210)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	16 764 716	25 629 593
Rachat de parts rachetables	(4 185 709)	(142 615)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	12 579 007	25 486 978
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	12 237 176	24 673 768
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	44 113 960 \$	24 673 768 \$

Fonds de rendement absolu PCJ II

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)
Pour le semestre clos le 30 juin 2021 et la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 30 juin 2021

	Série I 2022	Série I 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	4 262 619 \$	– \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(35 811)	(171 668)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	–	4 400 000
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	–	4 400 000
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	(35 811)	4 228 332
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	4 226 808 \$	4 228 332 \$
	Total 2022	Total 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	37 856 321 \$	– \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(412 019)	(1 025 689)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	16 764 716	31 509 876
Rachat de parts rachetables	(4 311 625)	(142 615)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	12 453 091	31 367 261
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	12 041 072	30 341 572
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	49 897 393 \$	30 341 572 \$

Fonds de rendement absolu PCJ II

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour le semestre clos le 30 juin 2021 et la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 30 juin 2021

	2022	2021
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(412 019) \$	(1 025 689) \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	45 553	(510)
(Gain) perte net réalisé sur les placements	1 545 441	159 628
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	(1 686 325)	515 211
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	3 159 375	(774 027)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	(3 048 908)	974 214
Achat de placements	(238 464 667)	(110 711 513)
Produit de la vente de placements	228 153 072	80 478 323
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(35 539)	(26 840)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	(9 418)
(Augmentation) diminution des autres créances	5 120	-
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	6 835	1 137
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	19 034	45 990
Augmentation (diminution) des charges à payer	3 222	10 520
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	12 557	24 302
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	(10 697 249)	(30 338 672)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	16 306 777	31 509 876
Rachat de parts rachetables**	(4 299 830)	(142 615)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	12 006 947	31 367 261
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	1 309 698	1 028 589
Variation du gain (perte) de change latent	(45 553)	510
Trésorerie, à l'ouverture de la période	9	-
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	(2 917 980)	-
	(1 653 826)	1 029 099
Trésorerie, à la clôture de la période	17 322 \$	1 029 099 \$
Dette bancaire, à la clôture de la période	(1 671 148) \$	-
	(1 653 826) \$	1 029 099 \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	113 658 \$	59 582 \$
Dividendes payés*	265 596	113 718
Intérêts reçus*	80 368	183
Intérêts payés*	3 729	578

* Inclus dans les activités d'exploitation.

** Déduction faite d'échanges hors trésorerie de 9 331 \$ (0 \$ en 2021).

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	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 2021 : 98,25 %)						
Bons du Trésor du Canada	2,843	7 juill. 2022	2 050 000	2 045 575	2 049 451	
Bons du Trésor du Canada	1,704	21 juill. 2022	17 050 000	16 998 516	17 036 070	
Bons du Trésor du Canada	1,687	4 août 2022	3 050 000	3 040 843	3 045 433	
Bons du Trésor du Canada	1,840	18 août 2022	13 950 000	13 906 926	13 917 245	
Bons du Trésor du Canada	1,976	1 ^{er} sept. 2022	1 500 000	1 494 360	1 495 037	
Bons du Trésor du Canada	1,992	15 sept. 2022	11 150 000	11 100 924	11 103 730	
				<u>48 587 144</u>	<u>48 646 966</u>	97,49
Total des placements à court terme – position acheteur				<u>48 587 144</u>	<u>48 646 966</u>	97,49
Obligations – position acheteur						
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2021 : 1,77 %)						
Chorus Aviation Inc.	6,000	30 juin 2026	1 032 000	1 062 384	1 026 840	2,06
Total des obligations – position acheteur				<u>1 062 384</u>	<u>1 026 840</u>	2,06
Actions canadiennes – position acheteur						
Énergie (31 décembre 2021 : 5,85 %)						
Corporation Cameco, NYSE			3 780	147 405	102 494	
CES Energy Solutions Corp.			107 610	227 908	250 731	
NexGen Energy Ltd., NYSE			15 750	122 920	72 937	
Corporation Parkland			38 940	1 421 335	1 361 341	
Pembina Pipeline Corp.,			5 880	294 043	268 128	
Precision Drilling Corp., NYSE			470	39 357	38 814	
Precision Drilling Corp., TSE			3 620	211 601	299 410	
Rubellite Energy Inc.			56 160	208 531	183 082	
Tamarack Valley Energy Ltd.			158 030	606 476	684 270	
Trican Well Service Ltd.			224 050	814 159	826 745	
				<u>4 093 735</u>	<u>4 087 952</u>	8,19
Matières premières (31 décembre 2021 : 14,91 %)						
Algoma Steel Group Inc., NASD			15 390	212 593	178 275	
Arizona Metals Corp.			32 370	151 439	127 214	
Aya Or & Argent Inc.			6 820	56 934	44 739	
Franco-Nevada Corp., NYSE			3 650	649 418	619 523	
NanoXplore Inc.			36 440	189 945	119 888	
Minière Osisko Inc.			50 530	186 603	154 622	
Wesdome Gold Mines Ltd.			6 330	79 115	70 580	
				<u>1 526 047</u>	<u>1 314 841</u>	2,64
Industries (31 décembre 2021 : 18,63 %)						
ATS Automation Tooling Systems Inc.			17 570	729 791	621 100	
CAE inc., NYSE			27 820	908 145	883 528	
Finning International Inc.			5 960	218 364	161 456	
K-Bro Linen Inc.			7 240	296 843	234 069	
Parkit Enterprise Inc.			194 330	290 800	186 557	
TFI International Inc., NYSE			4 170	450 179	431 836	
Thomson Reuters Corp., NYSE			6 500	818 275	873 771	
WSP Global Inc.			1 190	176 427	173 193	
				<u>3 888 824</u>	<u>3 565 510</u>	7,15
Bien de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 3,55 %)						
Uni-Sélect inc.			52 470	1 340 929	1 500 642	3,01
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 7,00 %)						
GURU Organic Energy Corp.			19 690	329 386	157 717	
Saputo inc.			20 210	550 620	567 295	
				<u>880 006</u>	<u>725 012</u>	1,45
Soins de santé (31 décembre 2021 : 0,26%)						
HLS Therapeutics Inc.			5 830	114 768	70 951	0,14

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Services financiers (31 décembre 2021 : 2,47 %)						
Element Fleet Management Corp.			36 600	472 641	491 172	
EQB Inc., reçus de souscription			3 000	211 500	156 540	
				684 141	647 712	1,30
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 3,17 %)						
Kinaxis Inc.			3 130	474 001	434 945	
Lightspeed Commerce Inc., NYSE			10 480	390 431	301 468	
TELUS International CDA Inc., NYSE			7 100	250 508	229 608	
				1 114 940	966 021	1,94
Services de communication (31 décembre 2021 : 0,39 %)						
Leaf Mobile Inc.			41 557	152 313	85 607	
Rogers Communications Inc., NYSE			19 390	1 198 764	1 198 087	
				1 351 077	1 283 694	2,57
Services publics (31 décembre 2021 : 1,65 %)						
Boralex inc.			8 300	343 475	355 904	
TransAlta Corp., NYSE			61 770	884 083	908 359	
				1 227 558	1 264 263	2,53
Immobilier (31 décembre 2021 : 4,00 %)						
Fonds de placement immobilier H&R			55 470	742 492	690 602	
Tricon Residential Inc.			40 860	539 682	534 455	
				1 282 174	1 225 057	2,46
Total des actions canadiennes – position acheteur				17 504 199	16 651 655	33,38
Actions canadiennes – position vendeur						
Énergie (31 décembre 2021 : -4,34 %)						
Gibson Energy Inc.			(17 550)	(445 889)	(418 392)	
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée			(8 390)	(571 338)	(509 105)	
PrairieSky Royalty Ltd.			(12 940)	(213 552)	(209 757)	
Spartan Delta Corp.			(10 140)	(90 043)	(125 432)	
Corporation TC Énergie			(3 430)	(244 095)	(228 712)	
Whitecap Resources Inc.			(43 040)	(414 274)	(384 778)	
				(1 979 191)	(1 876 176)	(3,76)
Matières premières (31 décembre 2021 : -6,26 %)						
Alamos Gold Inc.			(24 300)	(216 241)	(219 429)	
Cascades inc.			(43 260)	(513 814)	(438 224)	
Equinox Gold Corp.			(109 560)	(727 742)	(628 874)	
Labrador Iron Ore Royalty Corp.			(2 440)	(92 621)	(69 174)	
Novagold Resources Inc.			(12 770)	(133 224)	(78 536)	
Pan American Silver Corp.			(18 260)	(479 194)	(461 795)	
West Fraser Timber Co., Ltd.			(16 800)	(1 771 185)	(1 659 337)	
				(3 934 021)	(3 555 369)	(7,13)
Industries (31 décembre 2021 : -2,95 %)						
Groupe Aecon Inc.			(14 180)	(192 115)	(186 183)	
Calian Group Ltd.			(4 090)	(243 253)	(257 915)	
Mullen Group Ltd.			(53 140)	(702 430)	(599 951)	
NFI Group Inc.			(12 870)	(223 164)	(172 329)	
				(1 360 962)	(1 216 378)	(2,44)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -2,20%)						
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -4,32 %)						
Soins de santé (31 décembre 2021 : -0,46 %)						
Extencicare Inc.			(9 060)	(69 786)	(62 152)	(0,12)
Services financiers (31 décembre 2021 : -2,97 %)						
EQB Inc.			(3 000)	(213 930)	(159 450)	
Société financière IGM Inc.			(15 080)	(650 778)	(520 260)	
Onex Corp.			(1 770)	(117 526)	(113 457)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Société financière Sun Life Inc.			(2 250)	(136 629)	(132 705)	
Groupe TMX Ltée			(1 680)	(224 172)	(220 080)	
				(1 343 035)	(1 145 952)	(2,30)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -1,10 %)						
Services de communication (31 décembre 2021 : -0,93 %)						
Services publics (31 décembre 2021 : -1,79 %)						
Hydro One Ltd.			(35 340)	(1 219 108)	(1 223 117)	(2,45)
Immobilier (31 décembre 2021 : -4,91 %)						
FPI Granite Inc.			(8 740)	(808 452)	(690 023)	
SmartCentres REIT			(9 950)	(301 570)	(273 526)	
				(1 110 022)	(963 549)	(1,93)
Total des actions canadiennes – position vendeur						
				(11 016 125)	(10 042 693)	(20,13)
Actions américaines – position acheteur						
Matières premières (31 décembre 2021 : 2,78 %)						
Industries (31 décembre 2021 : 5,73%)						
AECOM			3 930	361 722	330 635	
CSX Corp.			3 040	113 812	113 958	
Jacobs Engineering Group Inc.			1 080	198 679	177 112	
Trex Co Inc.			2 400	198 298	168 479	
United Rentals Inc.			2 540	1 114 878	795 892	
				1 987 389	1 586 076	3,18
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 4,15%)						
Dollar Tree Inc.			5 930	1 198 337	1 192 165	
General Motors Co.			11 990	585 012	491 218	
				1 783 349	1 683 383	3,37
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 0,54 %)						
Sysco Corp.			6 550	732 077	715 733	1,43
Soins de santé (31 décembre 2021 : néant)						
Elevance Health Inc.			1 170	738 958	728 333	
Humana Inc.			1 580	955 483	953 988	
				1 694 441	1 682 321	3,37
Services financiers (31 décembre 2021 : 1,03%)						
Progressive Corp.			2 950	434 506	442 451	
SVB Financial Group			960	541 637	489 139	
W R Berkley Corp.			5 905	497 594	519 950	
				1 473 737	1 451 540	2,91
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 1,94 %)						
Visa Inc.			3 600	952 115	914 326	1,83
Services de communication (31 décembre 2021 : néant)						
Radius Global Infrastructure Inc.			18 920	357 213	372 435	0,75
Immobilier (31 décembre 2021 : 3,53 %)						
Total des actions américaines – position acheteur						
				8 980 321	8 405 814	16,84
Actions américaines – position vendeur						
Matières premières (31 décembre 2021 : -2,66 %)						
Louisiana-Pacific Corp.			(2 330)	(195 185)	(157 523)	(0,32)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	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 2021 : -6,56 %)						
American Airlines Group Inc.			(10 100)	(246 157)	(165 202)	
Builders FirstSource Inc.			(2 310)	(175 441)	(160 015)	
Deluxe Corp.			(6 860)	(334 427)	(191 760)	
Dover Corp.			(1 130)	(191 755)	(176 842)	
Expeditors International of Washington Inc.			(2 030)	(290 106)	(255 210)	
Graco Inc.			(6 020)	(446 264)	(461 351)	
HEICO Corp.			(1 720)	(286 419)	(290 919)	
Herc Holdings Inc.			(1 080)	(203 119)	(125 593)	
Middleby Corp.			(2 950)	(543 216)	(477 041)	
Old Dominion Freight Line Inc.			(680)	(229 894)	(224 801)	
Oshkosh Corp.			(6 460)	(786 246)	(684 482)	
Otis Worldwide Corp.			(1 130)	(119 558)	(103 012)	
PGT Innovations Inc.			(17 770)	(421 652)	(381 431)	
Terex Corp.			(5 480)	(245 619)	(193 477)	
United Parcel Service Inc., cat. B			(1 700)	(391 156)	(400 297)	
				(4 911 029)	(4 291 433)	(8,60)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -4,35 %)						
Darden Restaurants Inc.			(1 370)	(210 707)	(199 910)	
DoorDash Inc.			(2 930)	(371 287)	(242 535)	
Floor & Decor Holdings Inc.			(1 670)	(173 436)	(135 630)	
Home Depot Inc.			(4 300)	(1 565 577)	(1 521 324)	
Marriott International Inc.			(1 090)	(241 335)	(191 237)	
Nordstrom Inc.			(4 090)	(123 808)	(111 480)	
Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc.			(1 730)	(97 712)	(131 108)	
Polaris Inc.			(2 140)	(276 477)	(274 063)	
Tesla Inc.			(340)	(300 879)	(295 352)	
TJX Cos Inc.			(1 740)	(130 010)	(125 357)	
Whirlpool Corp.			(610)	(151 956)	(121 863)	
				(3 643 184)	(3 349 859)	(6,71)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -1,85 %)						
Services financiers (31 décembre 2021 : -2,21 %)						
Coinbase Global Inc.			(7 080)	(792 684)	(429 429)	
Moody's Corp.			(1 240)	(454 124)	(435 029)	
SEI Investments Co.			(3 640)	(255 374)	(253 648)	
T Rowe Price Group Inc.			(3 380)	(511 808)	(495 346)	
Wintrust Financial Corp.			(5 930)	(628 440)	(613 103)	
				(2 642 430)	(2 226 555)	(4,46)
Immobilier (31 décembre 2021 : -0,25 %)						
Iron Mountain Inc.			(4 620)	(287 610)	(290 173)	(0,58)
Total des actions américaines – position vendeur				(11 679 438)	(10 315 543)	(20,67)
Actions étrangères – position acheteur						
Industries (31 décembre 2021 : 1,94 %)						
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 0,31 %)						
Services publics (31 décembre 2021 : néant)						
Brookfield Infrastructure Partners LP, NYSE			7 036	376 066	346 890	0,70
Total des actions étrangères – position acheteur				376 066	346 890	0,70
Actions étrangères – position vendeur						
Énergie (31 décembre 2021 : -0,40 %)						
Services financiers (31 décembre 2021 : -0,51 %)						
Services publics (31 décembre 2021 : -1,20 %)						

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Fonds négociés en bourse – position vendeur						
(31 décembre 2021 : -25,31 %)						
BMO S&P 500 Index ETF			(7 640)	(491 967)	(408 129)	
Invesco QQQ Trust Series 1			(1 710)	(690 682)	(618 249)	
iShares Core S&P/TSX Capped Composite Index ETF			(24 750)	(842 470)	(742 748)	
iShares S&P/TSX 60 Index ETF			(6 710)	(223 950)	(194 657)	
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF			(7 900)	(1 057 731)	(924 394)	
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF			(2 880)	(408 862)	(443 877)	
Total des fonds négociés en bourse – position vendeur				<u>(3 715 662)</u>	<u>(3 332 054)</u>	(6,68)
Commissions de courtage intégrées (note 3)				<u>(25 519)</u>		
Total des placements				<u>50 073 370</u>	<u>51 387 875</u>	<u>102,99</u>
Autres actifs, moins les passifs					<u>(1 490 482)</u>	<u>(2,99)</u>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables					<u>49 897 393</u>	<u>100,00</u>

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (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 (soit un rendement brut total de 8 % à 12 % sur une base annualisée), 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 est un produit de placement non traditionnel qui cherche à générer un rendement absolu par la sélection de titres tout en ciblant une faible volatilité et une faible corrélation avec les mouvements de marché. Le conseiller en valeurs cherche à atteindre cet objectif en investissant principalement dans des titres dont le cours est attrayant et dont les facteurs fondamentaux sont solides, notamment l'évaluation, le profil de croissance et la rentabilité, tout en prenant à des fins de couverture des positions vendeur sur des titres qui présentent un profil de rendement inférieur de manière à atténuer les risques liés au marché. Le Fonds peut aussi investir dans de la trésorerie, des instruments dérivés du marché monétaire et des titres de créance.

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 31 décembre 2021

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– \$	48 646 966 \$	– \$	48 646 966 \$
Obligations – position acheteur	–	1 026 840	–	1 026 840
Actions canadiennes – position acheteur	16 651 655	–	–	16 651 655
Actions américaines – position acheteur	8 405 814	–	–	8 405 814
Actions étrangères – position acheteur	346 890	–	–	346 890
	25 404 359 \$	49 673 806 \$	– \$	75 078 165 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	10 042 693 \$	– \$	– \$	10 042 693 \$
Actions américaines – position vendeur	10 315 543	–	–	10 315 543
Fonds négociés en bourse – position vendeur	3 332 054	–	–	3 332 054
	23 690 290 \$	– \$	– \$	23 690 290 \$

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Au 31 décembre 2021

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– \$	37 195 286 \$	– \$	37 195 286 \$
Obligations – position acheteur	–	669 282	–	669 282
Actions canadiennes – position acheteur	23 156 966	272 489	–	23 429 455
Actions américaines – position acheteur	7 459 585	–	–	7 459 585
Actions étrangères – position acheteur	850 483	–	–	850 483
	31 467 034 \$	38 137 057 \$	– \$	69 604 091 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	12 202 918 \$	– \$	– \$	12 202 918 \$
Actions américaines – position vendeur	6 772 191	–	–	6 772 191
Actions étrangères – position vendeur	799 138	–	–	799 138
Fonds négociés en bourse – position vendeur	9 580 862	–	–	9 580 862
	29 355 109 \$	– \$	– \$	29 355 109 \$

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 2022 et la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 31 décembre 2021. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2022 et la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 31 décembre 2021, 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
2022					
Série A	180 637	–	–	(13 528)	167 109
Série F	3 330 483	1 791 457	–	(446 908)	4 675 032
Série I	440 000	–	–	–	440 000
2021					
Série A	–	184 016	–	(3 379)	180 637
Série F	–	3 632 494	–	(302 011)	3 330 483
Série I	–	440 000	–	–	440 000

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, 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 2022 et 2021 (non audité)

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2021, le Fonds avait des pertes en capital inutilisées de néant, 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 1 952 198 \$ 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	1 952 198	2041
Total	1 952 198	

Au cours de la période considérée, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2021).

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.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

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

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 2022, 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 46 595 \$, 47 200 \$ et 4 228 576 \$ (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 47 500 \$, 47 850 \$ et 4 262 619 \$ au 31 décembre 2021).

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

Le Fonds a payé 109 813 \$ (57 188 \$ en 2021) 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 2021).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résumant l'exposition du Fonds aux devises au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, 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 2022

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar américain	(2 587 804)	(5,2)	(129 390)
	(2 587 804)	(5,2)	(129 390)

Au 31 décembre 2021

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar américain	(2 567 851)	(6,8)	(128 393)
	(2 567 851)	(6,8)	(128 393)

Risque lié aux taux d'intérêt

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, 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 résumant l'exposition du Fonds au risque lié aux taux d'intérêt au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021. 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 2022 et 2021 (non audité)

Au 30 juin 2022

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total \$	% de l'actif net
Moins de 1 an	48 646 966	97,5
De 3 à 5 ans	1 026 840	2,1
Total	49 673 806	99,6

Au 31 décembre 2021

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total \$	% de l'actif net
Moins de 1 an	37 195 286	98,2
De 3 à 5 ans	669 282	1,8
Total	37 864 568	100,0

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 61 000 \$ (44 000 \$ au 31 décembre 2021). 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 2022, environ 3,4 % (6,2 % au 31 décembre 2021) 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 171 000 \$ (235 000 \$ au 31 décembre 2021). 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 2022 et au 31 décembre 2021. Les montants présentés sont fondés sur la valeur comptable des instruments de créance.

Au 30 juin 2022 :

Notations des créances et des contreparties	Total \$	% de l'actif net
AAA	48 646 966	97,5
Non notées	1 026 840	2,1
Total	49 673 806	99,6

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

Au 31 décembre 2021 :

Notations des créances et des contreparties	Total \$	% de l'actif net
AAA	37 195 286	98,2
Non notées	669 282	1,8
Total	37 864 568	100,0

Effet de levier (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2022 et de la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 31 décembre 2021, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié entre 37,6 % et 84,4 % (entre 68,2 % et 95,9 % en 2021) 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 2022, l'exposition totale du Fonds correspondait à 51,9 % (85,3 % au 31 décembre 2021) 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 2022 et de la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 31 décembre 2021, le niveau de la dette bancaire du Fonds était de néant à 3 432 505 \$ (de néant à 3 358 317 \$ en 2021), avec un taux d'intérêt moyen de 0,66 % (0,32 % en 2021). Au 30 juin 2022, la dette bancaire correspondait à 3,4 % (7,7 % au 31 décembre 2021) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2022 et 2021 (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 alternatif d'actions mondiales CC&L
- 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 26 août 2022.

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 2022 et 2021 (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.

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.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

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 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.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2022 et 2021 (non audité)

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 2022 et 2021 (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 pas 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 2022 et 2021 (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 2022 et 2021 (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 2022 et 2021 (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.

Aux 30 juin 2022 et 2021, 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 2022 et 2021 (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.

La pandémie attribuable à l'écllosion de COVID-19 a eu des conséquences sur les marchés des capitaux de l'ensemble de la planète en 2021 et en 2022. Cette situation a occasionné une importante volatilité des prix des titres de capitaux propres, des taux d'intérêt, des rendements des obligations et des taux de change. La durée et les conséquences à long terme de la pandémie de COVID-19 sont toujours inconnues, ce qui entraîne un degré élevé d'incertitude et de volatilité qui pourrait avoir des conséquences sur les marchés des capitaux de l'ensemble de la planète pendant le reste de l'exercice et les périodes futures.

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 2022 et 2021 (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 2022 et 2021 (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 2022, 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)

Le gestionnaire continuera de surveiller l'avancement de la transition des TIO vers les nouveaux taux d'intérêt de référence, et il s'attend à ce que tout soit prêt bien avant la date d'expiration des TIO 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 2022 et au 31 décembre 2021, le cas échéant, 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 2022 et 2021 (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 2022, à l'exception des parts rachetables, qui sont remboursables à vue, des positions vendeur sur obligations et de certains dérivés. Au 31 décembre 2021, 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 2022 et au 31 décembre 2021.

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 2022 et 2021 (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 2022 et de l'exercice clos le 31 décembre 2021, 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 2022 et 2021 (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.