



CONNOR, CLARK & LUNN

FONDS

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS

31 décembre 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**

TABLE DES MATIÈRES

Rapport de l'auditeur indépendant	3
Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L.....	7
Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L.....	106
Fonds alternatif de revenu CC&L.....	193
Fonds de rendement absolu PCJ II.....	213
Notes annexes	229



KPMG s.r.l./S.E.N.C.R.L.
C.P. 10426 777, rue Dunsmuir
Vancouver (Colombie-Britannique) V7Y 1K3
Canada
Téléphone 604-691-3000
Télécopieur 604-691-3031

RAPPORT DE L'AUDITEUR INDÉPENDANT

Aux porteurs de parts de :

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
(collectivement, les « Fonds »)

Opinion

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

- les états de la situation financière aux 31 décembre 2022 et 2021;
- les états du résultat global pour les exercices clos à cette date;
- les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les exercices clos à cette date;
- les tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos à cette date;
- ainsi que les notes annexes, y compris le résumé des principales méthodes comptables.

(ci-après, les « états financiers »).

À notre avis, les états financiers ci-joints donnent, dans tous leurs aspects significatifs, une image fidèle de la situation financière des Fonds aux 31 décembre 2022 et 2021, ainsi que de leur performance financière et de leurs flux de trésorerie pour les exercices clos à cette date, conformément aux Normes internationales d'information financière (« IFRS ») publiées par l'International Accounting Standards Board (« IASB »).

Fondement de l'opinion

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

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



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

Autres informations

La responsabilité des autres informations incombe au gestionnaire des Fonds. Les autres informations se composent :

- des informations contenues dans le Rapport de la direction sur le rendement du Fonds de chacun des Fonds, lesquels sont déposés auprès des autorités en valeurs mobilières canadiennes concernées.

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

En ce qui concerne nos audits des états financiers, notre responsabilité consiste à lire les autres informations désignées ci-dessus et, ce faisant, à apprécier s'il existe une incohérence significative entre celles-ci et les états financiers ou la connaissance que nous avons acquise au cours des audits, et à demeurer attentifs aux éléments indiquant que les autres informations semblent comporter une anomalie significative.

Nous avons obtenu les informations contenues dans le Rapport de la direction sur le rendement du Fonds de chacun des Fonds, lesquels sont déposés auprès des autorités en valeurs mobilières canadiennes concernées, à la date du présent rapport de l'auditeur. Si, à la lumière des travaux que nous avons effectués sur ces autres informations, nous concluons à la présence d'une anomalie significative dans ces autres informations, nous sommes tenus de signaler ce fait dans le rapport de l'auditeur.

Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

Responsabilités du gestionnaire et des responsables de la gouvernance à l'égard des états financiers

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

Lors de la préparation des états financiers, c'est au gestionnaire qu'il incombe d'évaluer la capacité des Fonds à poursuivre leur exploitation, de communiquer, le cas échéant, les questions relatives à la continuité de l'exploitation et d'appliquer le principe comptable de continuité d'exploitation, sauf si le gestionnaire a l'intention de liquider les Fonds ou de cesser leurs activités ou si aucune autre solution réaliste ne s'offre à elle.

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



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

Nos objectifs sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers pris dans leur ensemble sont exempts d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, et de délivrer un rapport de l'auditeur contenant notre opinion.

L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, qui ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada permettra toujours de détecter toute anomalie significative qui pourrait exister.

Les anomalies peuvent résulter de fraudes ou d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, individuellement ou collectivement, elles puissent influencer sur les décisions économiques que les utilisateurs des états financiers prennent en se fondant sur ceux-ci.

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

En outre :

- nous identifions et évaluons les risques que les états financiers comportent des anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

Le risque de non-détection d'une anomalie significative résultant d'une fraude est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, les omissions volontaires, les fausses déclarations ou le contournement du contrôle interne;

- nous acquérons une compréhension des éléments du contrôle interne pertinents pour les audits afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne des Fonds.
- nous apprécions le caractère approprié des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables faites par le gestionnaire, de même que des informations y afférentes fournies par ce dernier;



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
Page 4

- nous tirons une conclusion quant au caractère approprié de l'utilisation par le gestionnaire du principe comptable de continuité de l'exploitation et, selon les éléments probants obtenus, quant à l'existence ou non d'une incertitude significative liée à des événements ou situations susceptibles de jeter un doute important sur la capacité des Fonds à poursuivre leur exploitation. Si nous concluons à l'existence d'une incertitude significative, nous sommes tenus d'attirer l'attention des lecteurs de notre rapport de l'auditeur sur les informations fournies dans les états financiers au sujet de cette incertitude ou, si ces informations ne sont pas adéquates, d'exprimer une opinion modifiée. Nos conclusions s'appuient sur les éléments probants obtenus jusqu'à la date de notre rapport de l'auditeur. Des événements ou situations futurs pourraient par ailleurs amener les Fonds à cesser leur exploitation;
- nous évaluons la présentation d'ensemble, la structure et le contenu des états financiers, y compris les informations fournies dans les notes, et apprécions si les états financiers représentent les opérations et événements sous-jacents d'une manière propre à donner une image fidèle;
- nous communiquons aux responsables de la gouvernance notamment l'étendue et le calendrier prévus des travaux d'audit et nos constatations importantes, y compris toute déficience importante du contrôle interne que nous aurions relevée au cours de nos audits.

KPMG A. R. L. / S. E. N. C. R. L.

Comptables professionnels agréés

Vancouver (Canada)

Le 23 mars 2023

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

États de la situation financière

Aux 31 décembre

	2022	2021
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	3 521 869 \$	551 929 \$
Placements	26 093 492	36 503 976
Plus-value latente des contrats de change à terme	26 488	14 436
Plus-value latente des contrats de swap	335 931	549 356
Marge de variation quotidienne	1 669 874	2 381 898
Montant à recevoir du courtier	1 244 620	1 357 250
Dividendes à recevoir	34 215	43 627
Autres créances	264	-
	32 926 753	41 402 472
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	3 261 019	2 385 832
Placements vendus à découvert	7 238 990	9 040 374
Moins-value latente des contrats de change à terme	2 663	16 331
Moins-value latente des contrats de swap	380 013	445 883
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	9 685	7 493
Montant à payer au courtier	1 168 917	1 220 385
Frais d'emprunt de titres à payer	8 523	5 635
Charges à payer	63 129	42 961
Frais de gestion à payer	1 370	1 982
Rémunération au rendement à payer	6 944	17 346
Rachats à payer	2 400	-
	12 143 653	13 184 222
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	20 783 100 \$	28 218 250 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	146 875 \$	164 703 \$
Série F	1 930 574 \$	3 922 852 \$
Série I	18 705 651 \$	24 130 695 \$
	20 783 100 \$	28 218 250 \$
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	14 220	13 355
Série F	187 498	321 623
Série I	1 833 972	1 970 842
	2 035 690	2 305 820
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	10,33 \$	12,33 \$
Série F	10,30 \$	12,20 \$
Série I	10,20 \$	12,24 \$
	10,24 \$	12,24 \$

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

« Tim Elliott »

Administrateur

Administrateur

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

États du résultat global

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2022	2021
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	9 504 \$	113 468 \$
Variation du gain (perte) de change latent	(31 882)	(82 147)
Charges d'intérêts négatives	(64 214)	-
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	1 740	1 683
Autres revenus (pertes)	504	-
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	633 926	622 283
Charges de dividendes sur les titres vendus à découvert	(148 872)	(82 160)
Intérêts aux fins des distributions	30 523	-
Gain (perte) net réalisé sur les placements	(788 495)	4 001 756
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	1 027 770	(611 502)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	(39 614)	46 653
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	137 250	(42 181)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	233 745	815 912
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	(3 519 089)	660 734
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	332 862	1 149 869
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	25 720	15 107
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	(147 555)	42 969
Gain (perte) net total sur placements	(2 221 829)	6 619 440
Total des revenus (pertes) nets	(2 306 177)	6 652 444
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	32 167	25 909
Honoraires des dépositaires	90 618	74 344
Frais de dépôt	22 251	18 885
Honoraires du comité d'examen indépendant	4 711	4 955
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	642	547
Charges d'intérêts	12 120	19 563
Frais de gestion	19 772	18 779
Rémunération au rendement	15 185	43 118
Honoraires de professionnels	8 509	16 853
Coût d'emprunt de titres	112 804	71 758
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	8 528	7 990
Coûts d'opérations (note 9)	53 834	65 464
Total des charges d'exploitation	381 141	368 165
Retenues d'impôts (note 7)	(82 698)	(75 103)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 770 016) \$	6 209 176 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	(19 166) \$	31 154 \$
Série F	(405 255) \$	681 281 \$
Série I	(2 345 595) \$	5 496 741 \$
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	13 653	11 134
Série F	290 773	233 485
Série I	1 744 979	1 698 475
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	(1,40) \$	2,80 \$
Série F	(1,39) \$	2,92 \$
Série I	(1,34) \$	3,24 \$

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
Pour les exercices clos les 31 décembre

	Série A 2022	Série A 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	164 703 \$	90 767 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(19 166)	31 154
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	15 000	42 782
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	7 708	19 964
Rachat de parts rachetables	(13 662)	–
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	9 046	62 746
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(7 708)	–
Gains en capital nets réalisés	–	(18 123)
Remboursement de capital	–	(1 841)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(7 708)	(19 964)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(17 828)	73 936
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	146 875 \$	164 703 \$
	Série F 2022	Série F 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	3 922 852 \$	3 250 077 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(405 255)	681 281
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	242 732	2 695 846
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	101 962	494 642
Rachat de parts rachetables	(1 829 755)	(2 704 352)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(1 485 061)	486 136
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(101 962)	(16 190)
Gains en capital nets réalisés	–	(431 664)
Remboursement de capital	–	(46 788)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(101 962)	(494 642)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(1 992 278)	672 775
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	1 930 574 \$	3 922 852 \$

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

Pour les exercices clos les 31 décembre

	Série I 2022	Série I 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	24 130 695 \$	19 167 170 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 345 595)	5 496 741
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	590	578 402
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	1 399 181	3 368 039
Rachat de parts rachetables	(3 080 039)	(1 111 618)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(1 680 268)	2 834 823
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(1 399 181)	(377 159)
Gains en capital nets réalisés	–	(2 652 840)
Remboursement de capital	–	(338 040)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 399 181)	(3 368 039)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(5 425 044)	4 963 525
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	18 705 651 \$	24 130 695 \$
	Total 2022	Total 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	28 218 250 \$	22 508 014 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 770 016)	6 209 176
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	258 322	3 317 030
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	1 508 851	3 882 645
Rachat de parts rachetables	(4 923 456)	(3 815 970)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(3 156 283)	3 383 705
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(1 508 851)	(393 349)
Gains en capital nets réalisés	–	(3 102 627)
Remboursement de capital	–	(386 669)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 508 851)	(3 882 645)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(7 435 150)	5 710 236
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	20 783 100 \$	28 218 250 \$

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les exercices clos les 31 décembre

	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	(2 770 016) \$	6 209 176 \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	31 882	82 147
(Gain) perte net réalisé sur les placements	788 495	(4 001 756)
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	(1 027 770)	611 502
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	3 519 089	(660 734)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	(332 862)	(1 149 869)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	(25 720)	(15 107)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	147 555	(42 969)
Achat de placements	(111 393 538)	(154 758 145)
Produit de la vente de placements	117 116 848	154 700 778
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	712 024	824 302
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	9 412	(23 217)
(Augmentation) diminution des autres créances	(264)	-
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	2 888	1 862
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	2 192	4 546
Augmentation (diminution) des charges à payer	20 168	(2 314)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(612)	85
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	(10 402)	17 346
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	6 789 369	1 797 633
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	248 991	3 317 030
Rachat de parts rachetables**	(4 911 725)	(3 815 970)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(4 662 734)	(498 940)
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	2 126 635	1 298 693
Variation du gain (perte) de change latent	(31 882)	(82 147)
Trésorerie, à l'ouverture de l'exercice	551 929	51 399
Dette bancaire, à l'ouverture de l'exercice	(2 385 832)	(3 101 848)
	260 850	(1 833 903)
Trésorerie, à la clôture de l'exercice	3 521 869 \$	551 929 \$
Dette bancaire, à la clôture de l'exercice	(3 261 019) \$	(2 385 832) \$
	260 850 \$	(1 833 903) \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	560 794 \$	524 016 \$
Dividendes payés*	146 680	77 614
Intérêts reçus*	30 523	-
Intérêts payés*	12 120	19 563

* Inclus dans les activités d'exploitation.

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

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 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.	2 243	35 456	40 935	
Athabasca Oil Corp.	3 300	4 215	7 953	
Baytex Energy Corp.	100	692	608	
Canadian Natural Resources Ltd., TSE	100	7 221	7 519	
Cardinal Energy Ltd.	4 200	19 467	32 004	
Cenovus Energy Inc.	3 178	59 478	83 486	
CES Energy Solutions Corp.	200	350	552	
Crew Energy Inc.	800	3 396	4 504	
Enerflex Ltd.	200	1 443	1 708	
Ensign Energy Services Inc.	200	629	682	
Gear Energy Ltd.	800	952	904	
Headwater Exploration Inc.	200	1 340	1 184	
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	100	6 570	6 595	
MEG Energy Corp.	700	5 300	13 195	
NexGen Energy Ltd., TSE	1 300	7 988	7 787	
Parex Resources Inc.	2 300	36 746	46 345	
PrairieSky Royalty Ltd.	400	6 985	8 680	
Secure Energy Services Inc.	4 802	23 926	33 758	
Suncor Énergie Inc.	200	8 455	8 590	
Surge Energy Inc.	537	4 805	4 892	
Tamarack Valley Energy Ltd.	3 655	14 045	16 301	
Corporation TC Énergie, TSE	500	28 289	26 990	
Tourmaline Oil Corp.	100	8 139	6 832	
Vaalco Energy Inc.	136	851	840	
Whitcap Resources Inc.	3 700	23 266	39 738	
Yangarra Resources Ltd.	600	1 667	1 686	
		311 671	404 268	1,95
Matières premières (31 décembre 2021 : 3,42%)				
Argonaut Gold Inc.	1 700	5 666	884	
Aris Mining Corp.	1 000	5 723	3 350	
B2Gold Corp.	200	949	962	
Société aurifère Barrick	500	10 105	11 605	
Capstone Mining Corp.	600	2 181	2 964	
Cascades inc.	1 200	16 232	10 152	
Centerra Gold Inc.	5 500	51 417	38 555	
Dundee Precious Metals Inc.	400	2 596	2 604	
Eldorado Gold Corp.	1 100	9 576	12 419	
First Majestic Silver Corp.	500	6 333	5 640	
GoldMining Inc.	1 000	1 773	1 540	
IAMGOLD Corp.	2 100	8 575	7 287	
Interfor Corp.	600	21 838	12 600	
Ivanhoe Mines Ltd.	1 600	17 042	17 120	
Karara Resources Inc.	200	897	930	
Kinross Gold Corp., TSE	8 200	59 077	45 264	
Labrador Iron Ore Royalty Corp.	1 500	53 901	50 370	
Neo Performance Materials Inc.	100	1 032	960	
New Gold Inc.	2 900	4 718	3 857	
OceanaGold Corp.	7 585	17 167	19 569	
Minière Osisko Inc.	800	3 074	2 800	
Pan American Silver Corp.	2 900	68 350	64 090	
Sabina Gold & Silver Corp.	300	394	399	
Sandstorm Gold Ltd.	200	1 431	1 424	
Silvercorp Metals Inc.	500	2 376	1 990	
SSR Mining Inc.	1 100	25 977	23 309	
Taseko Mines Ltd.	1 601	1 744	3 170	
Transcontinental Inc.	100	1 425	1 528	
West Fraser Timber Co., Ltd., TSE	300	31 365	29 331	
Western Copper & Gold Corp.	200	401	482	
Western Forest Products Inc.	600	781	696	
Wheaton Precious Metals Corp.	100	4 412	5 290	
		438 528	383 141	1,84

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Industries (31 décembre 2021 : 0,65 %)				
Groupe Aecon Inc.	300	2 942	2 733	
Air Canada	2 100	37 322	40 719	
ATS Corp.	1 500	68 505	63 135	
Ballard Power Systems Inc.	100	744	648	
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	1 000	98 069	100 950	
Civeo Corp.	31	697	1 306	
Dexterra Group Inc.	100	355	553	
Doman Building Materials Group Ltd.	400	2 706	2 300	
GFL Environmental Inc., TSE	1 100	40 117	43 494	
Magellan Aerospace Corp.	200	1 563	2 000	
NFI Group Inc.	300	4 959	2 856	
Thomson Reuters Corp., TSE	400	54 449	61 784	
Waste Connections Inc.	100	15 459	17 948	
WSP Global Inc.	100	16 512	15 709	
		344 399	356 135	1,71
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 0,32 %)				
Aritzia Inc.	500	23 603	23 675	
BRP Inc.	100	10 317	10 323	
La Société Canadian Tire Ltée	100	14 895	14 150	
Les Industries Dorel Inc., cat B	400	3 969	2 080	
Martinrea International Inc.	300	2 542	3 378	
Roots Corp.	500	1 465	1 375	
		56 791	54 981	0,26
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 0,40%)				
Alimentation Couche-Tard inc.	200	12 224	11 900	
Empire Co., Ltd.	1 200	45 226	42 792	
Les Aliments Maple Leaf Inc.	300	6 896	7 335	
		64 346	62 027	0,30
Soins de santé (31 décembre 2021 : 0,05 %)				
Sienna Senior Living Inc.	1 937	28 654	21 113	
VBI Vaccines Inc.	311	356	165	
Viemed Healthcare Inc.	100	578	1 027	
		29 588	22 305	0,11
Services financiers (31 décembre 2021 : 1,74 %)				
La Banque de Nouvelle-Écosse	400	26 526	26 536	
Brookfield Asset Management Ltd.	249	9 891	9 654	
Brookfield Corp., TSE	1 900	86 088	80 902	
Groupe Canaccord Genuity Inc.	100	803	839	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	400	23 606	21 908	
CI Financial Corp.	3 400	79 531	45 934	
Corporation Fiera Capital	200	1 736	1 736	
iA Société financière inc.	399	27 785	31 629	
Société financière IGM Inc.	300	13 427	11 340	
Banque nationale du Canada	100	9 482	9 123	
Power Corporation du Canada	200	6 672	6 370	
Financière Sun Life inc.	200	12 456	12 570	
La Banque Toronto-Dominion, TSE	500	45 219	43 835	
		343 222	302 376	1,45
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 0,32 %)				
Absolute Software Corp.	3 200	35 120	45 248	
Blackberry Ltd.	1 700	9 961	7 497	
Canadian Solar Inc.	358	16 373	14 989	
Celestica Inc.	100	1 040	1 526	
CGI Inc., TSE	100	11 834	11 671	
Descartes Systems Group Inc.	300	26 229	28 317	
Quarterhill Inc.	300	441	474	
Shopify Inc.	800	39 159	37 608	
		140 157	147 330	0,71
Services de communication (31 décembre 2021 : 0,44 %)				
AcuityAds Holdings Inc.	900	1 954	1 881	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Aimia Inc.	300	1 120	1 107	
BCE Inc.	300	18 350	17 847	
Cogeco Communications inc.	300	30 326	23 037	
Corus Entertainment Inc.	4 600	22 593	9 936	
Lions Gate Entertainment Corp., cat. A	645	5 802	4 990	
Shaw Communications Inc., cat. B	100	3 356	3 901	
TELUS Corp.	2 900	91 844	75 777	
		175 345	138 476	0,67
Services publics (31 décembre 2021 : 0,27 %)				
Algonquin Power & Utilities Corp.	5 900	98 543	52 038	
AltaGas Ltd.	600	17 207	14 028	
Brookfield Infrastructure Corp.	650	39 951	34 236	
Emera Inc.	500	27 466	25 875	
Fortis Inc.	200	10 841	10 836	
Hydro One Ltd.	100	3 760	3 627	
Northland Power Inc.	100	3 883	3 713	
Polaris Renewable Energy Inc.	100	1 831	1 407	
Superior Plus Corp.	400	4 664	4 492	
		208 146	150 252	0,72
Immobilier (31 décembre 2021 : 0,73 %)				
Groupe Altus limitée	340	21 080	18 374	
FirstService Corp.	300	62 598	49 743	
FPI Granite	1 000	84 344	69 080	
InterRent REIT	200	2 451	2 560	
Killam Apartment REIT	900	18 804	14 589	
Minto Apartment REIT	200	2 803	2 810	
Morguard North American Residential Real Estate Investment	100	1 625	1 620	
Summit Industrial Income REIT	1 500	31 643	34 035	
		225 348	192 811	0,93
Total des actions canadiennes – position acheteur		2 337 541	2 214 102	10,65
Actions canadiennes – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2021 : -1,26 %)				
Birchcliff Energy Ltd.	(300)	(3 305)	(2 829)	
Corporation Cameco, TSE	(800)	(26 592)	(24 552)	
Canacol Energy Ltd.	(4 100)	(9 971)	(8 036)	
Computer Modelling Group Ltd.	(2 500)	(14 763)	(14 575)	
Denison Mines Corp.	(36 100)	(68 022)	(55 955)	
Energy Fuels Inc., NYSE	(4 314)	(34 280)	(36 241)	
Energy Fuels Inc., TSE	(1 600)	(15 921)	(13 408)	
North American Construction Group Ltd.	(500)	(7 275)	(9 040)	
Pason Systems Inc.	(2 000)	(12 014)	(31 880)	
Pembina Pipeline Corp.	(400)	(18 362)	(18 384)	
Shawcor Ltée	(2 200)	(11 529)	(30 228)	
Tidewater Midstream and Infrastructure Ltd.	(1 100)	(1 145)	(1 111)	
Total Energy Services Inc.	(200)	(1 383)	(1 722)	
Trican Well Service Ltd.	(1 900)	(7 157)	(6 954)	
Ur-Energy Inc.	(1 800)	(2 137)	(2 826)	
Vermilion Energy Inc.	(2 600)	(66 278)	(62 322)	
		(300 134)	(320 063)	(1,54)
Matières premières (31 décembre 2021 : -2,16 %)				
Altius Minerals Corp.	(100)	(2 119)	(2 221)	
Americas Gold & Silver Corp.	(7 200)	(21 892)	(5 544)	
Calibre Mining Corp.	(200)	(272)	(180)	
Canfor Pulp Products Inc.	(500)	(4 627)	(2 070)	
Equinox Gold Corp.	(2 000)	(13 301)	(8 860)	
ERO Copper Corp.	(100)	(1 513)	(1 864)	
Fortuna Silver Mines Inc.	(9 400)	(47 567)	(47 846)	
Galiano Gold Inc.	(3 300)	(2 866)	(2 376)	
Jaguar Mining Inc.	(600)	(1 987)	(1 620)	
Largo Inc.	(900)	(7 422)	(6 606)	
Lithium Americas Corp.	(1 100)	(38 208)	(28 237)	
Lundin Gold Inc.	(2 100)	(19 952)	(27 783)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
MAG Silver Corp.	(1 200)	(25 197)	(25 380)	
Major Drilling Group International Inc.	(2 200)	(20 443)	(23 144)	
Maverix Metals Inc.	(900)	(4 676)	(5 688)	
Nevada Copper Corp.	(500)	(377)	(145)	
Northern Dynasty Minerals Ltd.	(23 800)	(24 164)	(7 140)	
Novagold Resources Inc.	(100)	(652)	(809)	
Novo Resources Corp.	(300)	(392)	(86)	
Nutrien Ltd.	(100)	(9 960)	(9 885)	
Orla Mining Ltd.	(3 000)	(12 753)	(16 440)	
Redevances aurifères Osisko Ltée	(900)	(11 817)	(14 688)	
Perpetua Resources Corp.	(100)	(262)	(395)	
Platinum Group Metals Ltd.	(600)	(1 492)	(1 422)	
SilverCrest Metals Inc.	(4 524)	(48 605)	(36 644)	
Skeena Resources Ltd.	(2 300)	(17 423)	(16 583)	
Ressources Teck Ltée	(1 300)	(56 313)	(66 521)	
Victoria Gold Corp.	(400)	(6 242)	(2 860)	
Wesdome Gold Mines Ltd.	(200)	(1 855)	(1 496)	
		(404 349)	(364 533)	(1,75)
Industries (31 décembre 2021 : -1,01 %)				
CAE inc., TSE	(2 300)	(64 931)	(60 237)	
Chorus Aviation Inc.	(6 300)	(19 938)	(20 412)	
DIRTT Environmental Solutions	(3 300)	(15 810)	(2 277)	
Exchange Income Corp.	(356)	(15 188)	(18 736)	
K-Bro Linen Inc.	(400)	(14 991)	(10 920)	
La Compagnie Électrique Lion	(400)	(1 197)	(1 216)	
Corporation Internationale Masonite	(2)	(303)	(218)	
PyroGenèse Canada Inc.	(6 707)	(25 210)	(6 908)	
Corporation Savaria	(700)	(10 244)	(9 793)	
Transat AT inc.	(2 100)	(8 287)	(6 174)	
Westport Fuel Systems Inc.	(600)	(1 176)	(624)	
Xebec Adsorption Inc.	(1 500)	(4 106)	(780)	
		(181 381)	(138 295)	(0,67)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -0,74 %)				
Bragg Gaming Group Inc.	(1 200)	(7 086)	(6 300)	
ElectraMeccanica Vehicles Corp.	(17 250)	(67 601)	(14 110)	
Fire & Flower Holdings Corp.	(2 400)	(6 609)	(2 832)	
Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	(1 400)	(55 420)	(51 912)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.	(1 200)	(61 068)	(68 484)	
Park Lawn Corp.	(100)	(3 414)	(2 585)	
Pollard Banknote Ltd.	(300)	(5 413)	(5 736)	
Uni-Sélect inc.	(200)	(8 611)	(8 568)	
		(215 222)	(160 527)	(0,77)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -0,28%)				
Andrew Peller Ltée	(300)	(1 715)	(1 497)	
Les Compagnies Loblaw Ltée	(400)	(47 700)	(47 888)	
Primo Water Corp.	(700)	(13 047)	(14 714)	
SunOpta Inc.	(1 900)	(13 829)	(21 622)	
		(76 291)	(85 721)	(0,41)
Soins de santé (31 décembre 2021 : -1,08 %)				
Aurora Cannabis Inc.	(2 000)	(4 449)	(2 500)	
Bausch Health Cos Inc.	(800)	(6 966)	(6 800)	
CannTrust Holdings Inc.	(1 600)	(4 665)	-	
Canopy Growth Corp.	(4 900)	(21 368)	(15 386)	
Chartwell résidences pour retraités	(100)	(1 298)	(844)	
Cronos Group Inc.	(8 000)	(50 408)	(27 520)	
Extencicare Inc.	(100)	(833)	(656)	
HEXO Corp.	(2 942)	(63 564)	(4 089)	
HLS Therapeutics Inc.	(100)	(1 007)	(983)	
Thérapeutique Knight Inc.	(2 700)	(14 143)	(13 986)	
Organigram Holdings Inc.	(500)	(528)	(550)	
Profound Medical Corp.	(100)	(1 411)	(1 448)	
SNDL Inc.	(10 400)	(56 310)	(29 451)	
Valens Co Inc.	(1 900)	(2 877)	(1 729)	
Well Health Technologies Corp.	(13 800)	(71 779)	(39 192)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
		(301 606)	(145 134)	(0,70)
Services financiers (31 décembre 2021 : -0,02 %)				
ECN Capital Corp.	(5)	(37)	(14)	
Société Financière Manuvie	(900)	(19 937)	(21 735)	
		(19 974)	(21 749)	(0,10)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -0,47 %)				
Converge Technology Solutions Corp.	(300)	(1 819)	(1 377)	
Dye & Durham Ltd.	(100)	(1 536)	(1 641)	
Enghouse Systems Ltd.	(200)	(6 151)	(7 194)	
Hut 8 Mining Corp.	(15 300)	(58 535)	(17 748)	
Lightspeed Commerce Inc., TSE	(2 300)	(85 507)	(44 505)	
Open Text Corp.	(300)	(16 022)	(12 036)	
Sangoma Technologies Corp.	(100)	(599)	(635)	
Softchoice Corp.	(100)	(1 736)	(1 826)	
Sylogist Ltd.	(200)	(1 118)	(1 232)	
		(173 023)	(88 194)	(0,42)
Services de communication (31 décembre 2021 : -0,24 %)				
Enthusiast Gaming Holdings Inc.	(8 200)	(11 605)	(6 068)	
IMAX Corp.	(959)	(21 703)	(19 049)	
Rogers Communications Inc., TSE	(700)	(41 101)	(44 359)	
Groupe Stingray Inc.	(1 298)	(6 679)	(6 321)	
Telesat Corp.	(263)	(3 110)	(2 673)	
WildBrain Ltd.	(1 000)	(2 539)	(3 120)	
		(86 737)	(81 590)	(0,39)
Services publics (31 décembre 2021 : -0,41 %)				
Immobilier (31 décembre 2021 : -0,03 %)				
Automotive Properties REIT	(300)	(3 390)	(3 891)	
Fonds de placement immobilier d'immeubles résidentiels canadiens	(200)	(8 264)	(8 536)	
European Residential REIT	(1 300)	(4 506)	(3 939)	
Fonds de placement immobilier First Capital	(800)	(13 643)	(13 448)	
Inovalis REIT	(900)	(3 774)	(3 393)	
Nexus Industrial REIT	(100)	(973)	(964)	
Slate Office REIT	(400)	(1 743)	(1 728)	
True North Commercial REIT	(500)	(2 908)	(2 895)	
		(39 201)	(38 794)	(0,19)
Total des actions canadiennes – position vendeur		(1 797 918)	(1 444 600)	(6,94)
Actions américaines – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2021 : 2,43 %)				
Alto Ingredients Inc.	226	1 294	882	
American Resources Corp.	297	578	531	
Antero Midstream Corp.	2 061	28 597	30 132	
Arch Resources Inc.	132	26 889	25 539	
Archrock Inc.	139	1 457	1 691	
Berry Corp.	333	2 987	3 610	
Cactus Inc.	24	1 755	1 634	
Cheniere Energy Inc.	62	7 114	12 598	
Chevron Corp.	811	173 364	197 236	
ConocoPhillips	815	122 967	130 306	
Coterra Energy Inc.	220	5 959	7 324	
Delek US Holdings Inc.	23	1 013	841	
Denbury Inc.	3	358	354	
Devon Energy Corp.	170	14 055	14 168	
Diamondback Energy Inc.	252	51 533	46 703	
DT Midstream Inc.	30	2 319	2 246	
Earthstone Energy Inc.	362	5 731	6 980	
EnLink Midstream LLC	315	5 204	5 250	
Enviva Inc.	20	1 544	1 435	
Equitrans Midstream Corp.	298	3 014	2 705	
Exxon Mobil Corp.	1 250	164 367	186 810	
Gran Tierra Energy Inc., ASE	1 040	437	1 395	
Gran Tierra Energy Inc., TSE	3 300	6 761	4 455	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Green Plains Inc.	174	8 204	7 191	
Helix Energy Solutions Group Inc.	153	967	1 530	
Hess Midstream LP	1 666	59 934	67 540	
HF Sinclair Corp	748	60 752	52 591	
Kinder Morgan Inc.	1 352	32 859	33 121	
Kinetik Holdings Inc.	14	694	628	
KLX Energy Services Holdings Inc.	134	2 127	3 143	
Kosmos Energy Ltd.	502	4 243	4 326	
Liberty Energy Inc.	650	12 623	14 100	
Magnolia Oil & Gas Corp.	66	2 270	2 097	
Mammoth Energy Services Inc.	200	1 093	2 344	
Marathon Petroleum Corp.	117	15 014	18 451	
Murphy Oil Corp.	7	445	408	
New Fortress Energy Inc.	230	14 724	13 220	
Newpark Resources Inc.	524	1 810	2 946	
NextDecade Corp.	253	2 019	1 693	
Nine Energy Service Inc.	102	1 305	2 008	
Northern Oil and Gas Inc.	11	523	459	
Occidental Petroleum Corp.	424	37 369	36 188	
Oceaneering International Inc.	207	3 189	4 906	
Oil States International Inc.	472	3 853	4 771	
Par Pacific Holdings Inc.	11	349	347	
Patterson-UTI Energy Inc.	27	616	616	
PBF Energy Inc.	465	25 753	25 694	
Peabody Energy Corp.	274	10 624	9 809	
PHX Minerals Inc.	649	2 992	3 421	
Pioneer Natural Resources Co.	209	63 368	64 677	
Plains GP Holdings LP	53	905	893	
ProPetro Holding Corp.	1 302	15 756	18 294	
Ranger Oil Corp.	366	7 960	20 050	
Ring Energy Inc.	630	1 552	2 100	
SEACOR Marine Holdings Inc.	43	367	534	
Sitio Royalties Corp.	205	5 175	8 014	
Solaris Oilfield Infrastructure Inc.	140	1 959	1 884	
Talos Energy Inc.	18	474	460	
Texas Pacific Land Corp.	2	7 028	6 353	
Uranium Energy Corp.	662	3 273	3 480	
US Silica Holdings Inc.	160	3 043	2 710	
Viper Energy Partners LP	140	6 132	6 030	
Williams Cos Inc.	451	20 565	20 105	
World Fuel Services Corp.	38	1 320	1 407	
		1 074 525	1 155 364	5,56
Matières premières (31 décembre 2021 : 1,06 %)				
Advanced Emissions Solutions Inc.	119	889	392	
Air Products and Chemicals Inc.	61	25 784	25 478	
Alcoa Corp.	140	8 224	8 625	
Ascent Industries Co.	79	1 698	928	
ATI Inc.	55	2 133	2 225	
Ball Corp.	230	16 145	15 937	
Berry Global Group Inc.	13	1 084	1 064	
Celanese Corp.	167	23 979	23 135	
Cleveland-Cliffs Inc.	320	6 383	6 985	
Compass Minerals International Inc.	8	440	444	
Corteva Inc.	349	30 141	27 796	
DuPont de Nemours Inc.	175	16 428	16 273	
Eastman Chemical Co.	35	4 186	3 862	
Ecolab Inc.	140	28 261	27 612	
Element Solutions Inc.	55	1 453	1 356	
FMC Corp.	34	5 611	5 749	
Gold Resource Corp.	110	373	228	
International Flavors & Fragrances Inc.	70	9 740	9 944	
International Paper Co.	98	5 978	4 598	
Livent Corp.	53	2 319	1 427	
Martin Marietta Materials Inc.	17	7 064	7 785	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
McEwen Mining Inc., TSE	30	343	239	
Mosaic Co.	104	6 151	6 182	
Nucor Corp.	71	12 004	12 680	
Rayonier Advanced Materials Inc.	84	757	1 093	
Ryerson Holding Corp.	67	2 401	2 747	
Scotts Miracle-Gro Co.	26	2 058	1 712	
Sealed Air Corp.	159	11 391	10 746	
Sherwin-Williams Co.	67	21 922	21 545	
Steel Dynamics Inc.	49	7 288	6 487	
Vulcan Materials Co.	36	6 426	8 542	
		269 054	263 816	1,27
Industries (31 décembre 2021 : 5,36 %)				
3M Co.	151	24 651	24 535	
Air Lease Corp.	32	1 700	1 666	
Alta Equipment Group Inc.	21	378	375	
American Airlines Group Inc.	2 156	40 520	37 159	
American Superconductor Corp.	55	347	274	
American Woodmark Corp.	6	374	397	
AO Smith Corp., cat. B	12	932	931	
Astronics Corp.	100	1 118	1 396	
Bloom Energy Corp.	629	13 015	16 295	
BlueLinx Holdings Inc	18	1 527	1 734	
Boeing Co.	154	34 418	39 748	
Boise Cascade Co.	5	433	465	
Casella Waste Systems Inc.	3	316	322	
Caterpillar Inc.	138	43 459	44 794	
CH Robinson Worldwide Inc.	48	6 343	5 955	
Cintas Corp.	26	9 649	15 910	
Core & Main Inc.	13	359	340	
CSX Corp.	586	23 795	24 598	
Cummins Inc.	38	12 452	12 475	
Deere & Co.	22	12 759	12 781	
Delta Air Lines Inc.	46	2 087	2 048	
Dover Corp.	40	7 263	7 339	
Emerson Electric Co	162	21 327	21 085	
Energpac Tool Group Corp.	7	144	241	
Equifax Inc.	4	1 119	1 053	
Expeditors International of Washington Inc	45	7 120	6 336	
Fastenal Co.	157	10 117	10 066	
Flowserve Corp.	75	3 172	3 118	
Fortune Brands Innovations Inc	35	2 707	2 708	
Generac Holdings Inc.	131	17 598	17 867	
General Electric Co.	301	37 006	34 173	
GXO Logistics Inc.	1	64	58	
Harsco Corp.	735	4 640	6 264	
HEICO Corp.	89	17 060	18 528	
Heidrick & Struggles International Inc.	7	371	265	
Herc Holdings Inc.	2	317	357	
Heritage-Crystal Clean Inc.	8	353	352	
Hexcel Corp.	6	340	478	
Howmet Aerospace Inc.	100	4 929	5 340	
IDEX Corp.	21	5 165	6 497	
Ingersoll Rand Inc.	110	6 038	7 788	
Jacobs Solutions Inc.	231	38 918	37 581	
KBR Inc.	128	8 999	9 157	
Knight-Swift Transportation Holdings Inc.	145	10 265	10 297	
Korn Ferry	16	1 117	1 097	
L3Harris Technologies Inc.	51	14 295	14 388	
Landstar System Inc	2	394	441	
LSI Industries Inc.	67	740	1 111	
Manitowoc Co Inc.	16	353	199	
Mayville Engineering Co Inc.	20	369	343	
Mesa Air Group Inc.	37	382	77	
Mistras Group Inc.	100	655	668	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Moog Inc.	37	4 233	4 400	
NL Industries Inc.	30	356	277	
NN Inc.	307	1 872	624	
Old Dominion Freight Line Inc.	66	21 589	25 378	
Parker-Hannifin Corp.	35	13 000	13 800	
Proto Labs Inc.	142	12 957	4 912	
Quad/Graphics Inc.	673	2 927	3 721	
Quanta Services Inc.	39	7 545	7 530	
Raytheon Technologies Corp.	440	49 413	60 167	
Republic Services Inc.	134	23 101	23 420	
Robert Half International Inc.	31	3 698	3 101	
Rockwell Automation Inc.	33	12 359	11 517	
Rollins Inc.	63	3 275	3 119	
Science Applications International Corp.	11	1 652	1 653	
Southwest Airlines Co.	42	2 172	1 916	
Spirit AeroSystems Holdings Inc	353	11 927	14 158	
Stanley Black & Decker Inc.	43	4 699	4 377	
Stericycle Inc.	6	355	406	
Sterling Infrastructure Inc.	100	2 894	4 444	
SunPower Corp.	458	13 536	11 189	
Sunworks Inc.	147	594	315	
Tetra Tech Inc.	5	1 027	984	
Textron Inc.	57	5 419	5 468	
Timken Co.	4	380	383	
Toro Co.	3	408	460	
TPI Composites Inc.	24	372	330	
TransDigm Group Inc.	15	12 175	12 797	
TransUnion	93	10 095	7 151	
Triumph Group Inc.	143	2 287	2 038	
Tutor Perini Corp.	41	363	419	
U-Haul Holding Co.	2	934	163	
U-Haul Holding Co., cat. B	23	2 012	1 713	
Union Pacific Corp.	171	49 403	47 978	
United Airlines Holdings Inc.	143	7 500	7 305	
United Parcel Service Inc., cat. B	58	13 671	13 662	
United Rentals Inc.	19	8 553	9 150	
Upwork Inc.	230	5 752	3 254	
V2X Inc.	25	1 449	1 399	
Verisk Analytics Inc	43	9 719	10 279	
Vertiv Holdings Co.	143	2 734	2 647	
Waste Management Inc.	113	17 195	24 020	
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	50	5 860	6 762	
Willis Lease Finance Corp.	29	777	2 319	
Xylem Inc.	49	6 394	7 341	
Yellow Corp.	389	5 918	1 323	
		818 520	839 239	4,04
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 8,79 %)				
2U Inc.	101	3 221	858	
ADT Inc.	490	5 547	6 022	
Advance Auto Parts Inc.	22	5 126	4 383	
Airbnb Inc.	263	41 410	30 468	
Amazon.com Inc.	2 871	506 422	326 767	
American Axle & Manufacturing Holdings Inc.	37	489	392	
Aramark	71	3 383	3 977	
Barnes & Noble Education Inc.	100	358	237	
Bath & Body Works Inc.	71	3 678	4 054	
Beazer Homes USA Inc.	360	5 606	6 224	
BJ's Restaurants Inc	83	2 696	2 967	
Bluegreen Vacations Holding Corp.	84	1 289	2 841	
Boyd Gaming Corp.	9	680	665	
Bright Horizons Family Solutions Inc.	40	3 728	3 420	
Brunswick Corp.	213	21 356	20 803	
Burlington Stores Inc.	18	4 810	4 945	
Carriage Services Inc.	26	1 138	970	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Carrols Restaurant Group Inc.	125	348	230	
Cavco Industries Inc.	1	278	307	
Century Communities Inc.	6	382	407	
Chegg Inc.	411	10 828	14 073	
Chipotle Mexican Grill Inc.	10	18 288	18 800	
Cracker Barrel Old Country Store Inc.	3	390	385	
Dana Inc.	24	489	492	
Dave & Buster's Entertainment Inc.	16	763	768	
Dick's Sporting Goods Inc.	55	8 613	8 964	
Dine Brands Global Inc.	33	2 860	2 888	
Dollar Tree Inc.	118	23 017	22 614	
DoorDash Inc.	155	17 234	10 253	
eBay Inc.	151	9 883	8 485	
Etsy Inc.	50	9 020	8 115	
Expedia Group Inc.	43	5 329	5 104	
Five Below Inc.	10	2 432	2 397	
Ford Motor Co.	1 085	17 011	17 098	
GameStop Corp.	51	1 606	1 276	
General Motors Co.	381	18 264	17 366	
Genuine Parts Co.	39	9 347	9 169	
Green Brick Partners Inc.	28	868	919	
Group 1 Automotive Inc.	2	454	489	
Hanesbrands Inc.	616	5 606	5 308	
Harley-Davidson Inc.	70	3 969	3 946	
Hilton Grand Vacations Inc.	73	4 282	3 812	
Hilton Worldwide Holdings Inc.	75	13 690	12 841	
Home Depot Inc.	114	45 598	48 789	
Hyatt Hotels Corp.	10	1 347	1 226	
Jack in the Box Inc.	3	352	277	
Kohl's Corp.	115	4 273	3 934	
Las Vegas Sands Corp.	315	20 523	20 517	
La-Z-Boy Inc.	8	347	247	
Leslie's Inc.	70	1 442	1 158	
Lindblad Expeditions Holdings Inc.	35	369	365	
LKQ Corp.	76	5 280	5 500	
Lowe's Cos Inc.	241	61 010	65 061	
M/I Homes Inc.	4	324	250	
MarineMax Inc.	48	3 122	2 030	
Marriott International Inc.	100	20 391	20 174	
Marriott Vacations Worldwide Corp.	2	339	365	
MasterCraft Boat Holdings Inc.	10	392	351	
McDonald's Corp.	377	131 965	134 616	
MGM Resorts International	83	4 176	3 771	
Mister Car Wash Inc.	65	833	813	
NIKE Inc., cat. B	351	51 887	55 649	
Nordstrom Inc.	221	5 256	4 833	
NVR Inc.	1	4 302	6 250	
Penn Entertainment Inc.	436	19 068	17 546	
Penske Automotive Group Inc.	16	2 685	2 492	
Perdoceo Education Corp.	25	357	471	
Petco Health & Wellness Co Inc.	745	10 444	9 570	
PlayAGS Inc.	264	1 626	1 824	
Polaris Inc.	10	1 502	1 369	
Porch Group Inc	19	601	48	
PulteGroup Inc.	318	19 424	19 618	
Qurate Retail Inc.	1 562	7 449	3 450	
Ralph Lauren Corp.	3	422	430	
Red Robin Gourmet Burgers Inc.	56	726	423	
Red Rock Resorts Inc.	59	2 932	3 199	
Rivian Automotive Inc.	89	9 498	2 222	
Ross Stores Inc.	96	15 084	15 098	
Sally Beauty Holdings Inc.	37	706	628	
Shake Shack Inc.	11	710	619	
Starbucks Corp.	314	42 002	42 205	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Stitch Fix Inc.	618	12 181	2 604	
Strategic Education Inc.	7	629	743	
Target Corp.	279	58 964	56 342	
Taylor Morrison Home Corp.	11	362	452	
Tesla Inc.	1 057	295 091	176 417	
Texas Roadhouse Inc.	3	407	370	
TJX Cos Inc.	8	664	863	
Tractor Supply Co.	45	12 362	13 717	
Travel + Leisure Co.	7	343	345	
Ulta Beauty Inc.	15	8 154	9 534	
Universal Technical Institute Inc.	100	857	911	
VF Corp.	138	4 936	5 163	
Vivint Smart Home Inc.	746	13 333	12 029	
Wayfair Inc.	644	76 860	28 700	
Whirlpool Corp.	16	3 886	3 067	
Williams-Sonoma Inc.	4	648	623	
Wynn Resorts Ltd.	213	24 607	23 801	
Yum China Holdings Inc.	115	7 463	8 516	
Yum! Brands Inc.	80	10 608	13 883	
		1 827 307	1 451 967	6,99
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 3,44 %)				
Andersons Inc.	9	422	427	
Campbell Soup Co.	73	5 600	5 613	
Church & Dwight Co Inc.	67	7 400	7 318	
Clorox Co.	56	11 276	10 648	
Coca-Cola Co.	1 379	105 916	118 855	
Coca-Cola Consolidated Inc.	2	1 333	1 388	
Colgate-Palmolive Co.	217	22 182	23 166	
Conagra Brands Inc.	131	6 901	6 869	
Constellation Brands Inc.	62	17 167	19 469	
Costco Wholesale Corp.	236	136 938	145 970	
Coty Inc.	103	1 111	1 195	
Darling Ingredients Inc.	404	36 993	34 262	
Elf Beauty Inc.	199	14 830	14 911	
Estee Lauder Cos Inc.	227	76 453	76 313	
General Mills Inc.	3	345	341	
Hershey Co.	63	16 372	19 767	
Hostess Brands Inc.	26	790	791	
Kellogg Co.	69	6 934	6 660	
Keurig Dr Pepper Inc.	214	10 887	10 340	
Kimberly-Clark Corp.	93	17 122	17 106	
Kroger Co.	187	11 993	11 296	
Lamb Weston Holdings Inc.	39	4 730	4 722	
McCormick & Co Inc.	211	23 706	23 698	
Mondelez International Inc.	896	75 543	80 916	
Monster Beverage Corp.	346	44 717	47 599	
Oil-Dri Corp. of America	65	2 192	2 954	
PepsiCo Inc.	418	80 843	102 321	
Philip Morris International Inc.	556	76 207	76 247	
Procter & Gamble Co.	654	110 836	134 304	
Simply Good Foods Co.	82	3 877	4 225	
Spectrum Brands Holdings Inc.	3	342	248	
Sprouts Farmers Market Inc.	10	369	439	
Sysco Corp.	446	50 274	46 200	
Turning Point Brands Inc.	45	1 329	1 319	
Tyson Foods Inc.	79	6 968	6 663	
Village Super Market Inc.	22	721	694	
Vintage Wine Estates Inc.	333	1 594	1 471	
Walgreens Boots Alliance Inc.	201	11 198	10 175	
Walmart Inc.	43	7 103	8 261	
		1 011 514	1 085 161	5,22
Soins de santé (31 décembre 2021 : 9,27 %)				
10X Genomics Inc.	11	475	543	
4D Molecular Therapeutics Inc.	14	429	421	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Abbott Laboratories	479	68 596	71 256	
AbbVie Inc.	481	93 426	105 327	
ABIOMED Inc., droits	13	–	–	
Acadia Healthcare Co Inc	3	340	335	
AdaptHealth Corp.	137	3 919	3 568	
Adaptive Biotechnologies Corp.	74	1 403	766	
ADMA Biologics Inc.	716	2 853	3 764	
Adverum Biotechnologies Inc.	909	2 325	714	
Agilent Technologies Inc.	81	16 467	16 424	
Agios Pharmaceuticals Inc.	346	19 444	13 164	
Albireo Pharma Inc.	165	5 170	4 831	
Alector Inc.	186	4 606	2 326	
Alnylam Pharmaceuticals Inc.	53	15 258	17 066	
Alpine Immune Sciences Inc.	120	1 315	1 195	
AmerisourceBergen Corp.	175	35 781	39 293	
Amgen Inc.	157	44 588	55 871	
AMN Healthcare Services Inc.	15	2 099	2 090	
Amneal Pharmaceuticals Inc.	1 375	5 551	3 708	
AnaptysBio Inc.	204	4 118	8 566	
Apellis Pharmaceuticals Inc.	92	5 876	6 446	
Ardelyx Inc.	170	398	656	
Arrowhead Pharmaceuticals Inc.	9	397	495	
Arvinas Inc.	382	38 700	17 707	
Assembly Biosciences Inc.	181	1 086	319	
Assertio Holdings Inc.	126	401	734	
Avantor Inc.	1 247	36 763	35 634	
Axonics Inc.	55	3 892	4 660	
Azenta Inc.	8	625	631	
Baxter International Inc.	146	10 363	10 083	
Biogen Inc.	61	24 328	22 888	
BioMarin Pharmaceutical Inc.	297	36 695	41 647	
Bio-Rad Laboratories Inc.	6	3 391	3 418	
Bristol-Myers Squibb Co.	583	54 991	56 836	
Brookdale Senior Living Inc.	201	761	744	
Cardinal Health Inc.	163	14 146	16 977	
CareDx Inc.	222	6 704	3 432	
Castle Biosciences Inc.	31	928	989	
Celldx Therapeutics Inc.	153	5 713	9 240	
Centene Corp.	295	31 901	32 780	
Chemed Corp.	1	652	692	
Chimerix Inc.	407	2 439	1 026	
Chinook Therapeutics Inc.	233	5 986	8 271	
Cigna Corp.	83	30 777	37 263	
Citius Pharmaceuticals Inc.	1	2	1	
Cogent Biosciences Inc.	420	5 083	6 579	
Coherus Biosciences Inc.	51	657	547	
Concert Pharmaceuticals Inc.	350	5 061	2 770	
Corcept Therapeutics Inc.	33	939	908	
Crinetics Pharmaceuticals Inc.	13	376	322	
Cutera Inc.	32	2 169	1 917	
CVS Health Corp.	931	112 170	117 556	
Cymabay Therapeutics Inc.	1 077	8 202	9 150	
Cytokinetics Inc.	385	20 281	23 902	
CytomX Therapeutics Inc.	1 070	2 639	2 320	
Danaher Corp.	203	73 117	73 006	
DaVita Inc.	15	1 529	1 518	
DENTSPLY SIRONA Inc.	554	22 748	23 901	
Edwards Lifesciences Corp.	552	56 822	55 804	
Eiger BioPharmaceuticals Inc.	156	1 412	249	
Elevance Health Inc.	85	46 065	59 080	
Eli Lilly & Co.	221	53 925	109 549	
Embecka Corp.	15	632	514	
Enovis Corp.	30	2 267	2 176	
EQRx Inc.	303	864	1 010	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Esperion Therapeutics Inc.	784	6 273	6 618	
Exact Sciences Corp.	49	3 507	3 287	
Exelixis Inc.	720	16 389	15 648	
Fate Therapeutics Inc.	314	10 906	4 293	
Flexion Therapeutics Inc., droits	54	–	–	
Gilead Sciences Inc.	88	10 221	10 236	
Glaukos Corp.	138	10 969	8 167	
Gossamer Bio Inc.	239	3 663	703	
Gritstone bio Inc.	101	337	472	
Halozyme Therapeutics Inc.	159	12 494	12 258	
Health Catalyst Inc.	111	3 486	1 599	
HealthEquity Inc.	45	3 680	3 758	
HealthStream Inc.	12	366	404	
Henry Schein Inc. Heron Therapeutics Inc.	37	4 053	4 004	
Homology Medicines Inc.	147	868	498	
Humana Inc.	100	773	171	
Humana Inc.	102	67 124	70 788	
Illumina Inc.	168	62 328	46 027	
Incyte Corp.	252	28 107	27 425	
Insmid Inc.	513	13 989	13 888	
Inspire Medical Systems Inc.	16	4 862	5 461	
Insulet Corp.	74	28 831	29 518	
Intercept Pharmaceuticals Inc.	294	7 866	4 928	
Intra-Cellular Therapies Inc.	213	15 728	15 273	
Ionis Pharmaceuticals Inc.	315	16 675	16 121	
iRhythm Technologies Inc.	9	1 419	1 142	
Ironwood Pharmaceuticals Inc.	95	1 559	1 595	
Johnson & Johnson	1 011	226 609	241 986	
Karuna Therapeutics Inc.	29	9 265	7 721	
Karyopharm Therapeutics Inc.	294	1 418	1 354	
Kezar Life Sciences Inc.	242	2 647	2 308	
Krystal Biotech Inc.	5	416	537	
Laboratory Corp. of America Holdings	111	35 347	35 416	
Madrigal Pharmaceuticals Inc.	48	12 692	18 877	
MannKind Corp.	142	1 010	1 014	
McKesson Corp.	68	28 277	34 562	
Medpace Holdings Inc.	5	1 456	1 439	
Merck & Co Inc.	223	29 481	33 524	
Mersana Therapeutics Inc.	88	839	699	
Miram Pharmaceuticals Inc.	16	339	423	
Molina Healthcare Inc.	56	23 877	25 056	
Myriad Genetics Inc.	23	443	452	
NeoGenomics Inc.	8	406	100	
Neurocrine Biosciences Inc.	141	22 064	22 819	
Nevro Corp.	109	9 875	5 849	
NuVasive Inc.	6	358	335	
Omniceil Inc.	3	419	205	
OPKO Health Inc.	1 021	3 408	1 729	
Optinose Inc.	176	845	441	
Ovid therapeutics Inc.	582	4 025	1 467	
Oyster Point Pharma Inc.	42	355	636	
Pacira BioSciences Inc.	10	754	523	
Paratek Pharmaceuticals Inc.	158	551	400	
PDL BioPharma Inc.	501	1 218	579	
Pediatrix Medical Group Inc.	15	352	302	
PerkinElmer Inc.	41	7 724	7 790	
Pfizer Inc.	1 538	98 412	106 780	
Precigen Inc.	135	358	278	
Prestige Consumer Healthcare Inc.	5	355	424	
Prometheus Biosciences Inc.	13	1 967	1 938	
Protagonist Therapeutics Inc.	527	5 820	7 790	
PTC Therapeutics Inc.	187	11 403	9 671	
Quanterix Corp.	11	721	206	
Regeneron Pharmaceuticals Inc.	29	26 167	28 350	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Repligen Corp.	21	5 058	4 818	
Replimune Group Inc.	33	849	1 216	
Revance Therapeutics Inc.	29	1 001	725	
Sage Therapeutics Inc.	99	4 981	5 116	
Sangamo Therapeutics Inc.	385	4 569	1 638	
Sarepta Therapeutics Inc.	68	10 251	11 939	
Savara Inc.	531	1 030	1 115	
Select Medical Holdings Corp.	63	2 156	2 120	
Shockwave Medical Inc.	97	31 069	27 024	
SI-BONE Inc.	15	429	276	
Syndax Pharmaceuticals Inc.	11	354	379	
Syneos Health Inc.	292	12 898	14 512	
Tabula Rasa HealthCare Inc.	83	586	557	
Tactile Systems Technology Inc.	282	2 821	4 386	
Tandem Diabetes Care Inc.	262	16 372	15 957	
TCR2 Therapeutics Inc.	387	1 651	524	
Teladoc Health Inc.	781	37 388	25 027	
Thermo Fisher Scientific Inc.	107	63 268	79 839	
Traverse Therapeutics Inc.	788	23 200	22 454	
Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	109	7 113	6 843	
United Therapeutics Corp.	2	590	754	
UnitedHealth Group Inc.	268	129 045	192 524	
Vanda Pharmaceuticals Inc.	51	752	511	
Veeva Systems Inc.	151	39 766	33 018	
Vertex Pharmaceuticals Inc.	70	29 884	27 390	
Viatis Inc.	198	2 785	2 986	
ViewRay Inc.	155	728	941	
Viking Therapeutics Inc.	152	735	1 936	
Viridian Therapeutics Inc.	158	5 765	6 253	
Voyager Therapeutics Inc.	544	3 738	4 496	
vTv Therapeutics Inc.	284	384	251	
Y-mAbs Therapeutics Inc.	222	1 793	1 468	
Zimvie Inc.	5	243	63	
		2 414 434	2 564 893	12,34
Services financiers (31 décembre 2021 : 6,71 %)				
Aflac Inc.	211	14 300	20 567	
Allstate Corp.	113	18 836	20 762	
Ally Financial Inc.	837	31 410	27 729	
American Equity Investment Life Holding Co.	68	3 425	4 203	
American Express Co.	231	45 625	46 245	
American Financial Group Inc.	34	5 376	6 324	
Ameris Bancorp	6	376	383	
Apollo Global Management Inc.	27	2 310	2 334	
Arch Capital Group Ltd.	255	17 641	21 691	
Arthur J Gallagher & Co.	58	8 976	14 817	
Artisan Partners Asset Management Inc.	9	351	362	
Assurant Inc.	14	2 032	2 372	
Bank of America Corp.	3 236	133 854	145 219	
Bankwell Financial Group Inc.	21	722	837	
Berkshire Hathaway Inc., cat. B	180	49 249	75 338	
BlackRock Inc.	41	35 644	39 367	
Bread Financial Holdings Inc.	93	5 202	4 746	
Brown & Brown Inc.	87	6 978	6 716	
BRP Group Inc.	184	7 142	6 268	
Capital One Financial Corp.	105	12 682	13 225	
Carter Bankshares Inc.	18	367	405	
Charles Schwab Corp.	398	39 787	44 900	
Cincinnati Financial Corp.	41	5 709	5 688	
Citigroup Inc.	1 703	121 944	104 368	
Citizens Financial Group Inc.	135	6 955	7 202	
CME Group Inc.	99	27 188	22 557	
CNB Financial Corp.	12	357	387	
Coinbase Global Inc.	585	36 250	28 052	
Columbia Banking System Inc.	22	932	898	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Crawford & Co., cat. A	74	773	557	
Customers Bancorp Inc.	15	669	576	
Discover Financial Services	75	9 903	9 942	
Eagle Bancorp Inc.	5	363	299	
eHealth Inc.	6	453	39	
Ellington Financial Inc.	19	352	318	
Employers Holdings Inc.	15	888	877	
Equitable Holdings Inc.	105	4 333	4 083	
ESSA Bancorp Inc.	14	369	396	
FactSet Research Systems Inc.	13	6 556	7 067	
Federated Hermes Inc.	117	5 782	5 756	
Fifth Third Bancorp	432	21 788	19 205	
First Citizens BancShares Inc.	3	3 054	3 083	
Franklin Resources Inc.	82	2 938	2 931	
Goldman Sachs Group Inc.	93	45 699	43 270	
Hanover Insurance Group Inc.	2	380	366	
Hartford Financial Services Group Inc.	89	7 465	9 144	
HBT Financial Inc.	15	398	398	
Home Bancorp Inc.	43	1 968	2 332	
Home BancShares Inc.	39	1 223	1 204	
Huntington Bancshares Inc.	2 048	39 095	39 127	
Independent Bank Group Inc.	45	4 068	3 663	
Interactive Brokers Group Inc.	136	13 192	13 332	
JPMorgan Chase & Co.	804	124 638	146 087	
KeyCorp	473	13 182	11 164	
Lincoln National Corp.	811	37 928	33 757	
Live Oak Bancshares Inc.	9	428	368	
LPL Financial Holdings Inc.	23	6 243	6 737	
M&T Bank Corp.	50	10 761	9 828	
MarketAxess Holdings Inc.	11	7 398	4 157	
Marsh & McLennan Cos Inc.	173	31 545	38 790	
Medallion Financial Corp.	49	365	474	
Mercury General Corp.	37	1 472	1 715	
MetLife Inc.	185	12 447	18 141	
Metropolitan Bank Holding Corp.	3	357	238	
MGIC Investment Corp.	68	1 210	1 198	
Moody's Corp.	57	21 041	21 519	
Morgan Stanley	352	36 901	40 550	
Morningstar Inc.	1	292	293	
MSCI Inc.	34	17 890	21 430	
NMI Holdings Inc.	13	368	368	
Northern Trust Corp.	54	6 747	6 475	
Oportun Financial Corp	176	1 591	1 314	
Pinnacle Financial Partners Inc.	3	358	298	
PNC Financial Services Group Inc.	418	91 214	89 453	
Primerica Inc.	2	392	384	
Principal Financial Group Inc	79	5 732	8 983	
PROG Holdings Inc.	15	539	343	
Progressive Corp.	160	19 950	28 120	
Prudential Financial Inc.	276	38 254	37 195	
Radian Group Inc	14	357	362	
Redwood Trust Inc.	34	352	311	
RLI Corp.	23	4 010	4 091	
Ryan Specialty Holdings Inc.	212	11 534	11 924	
S&P Global Inc.	251	113 203	113 911	
Sculptor Capital Management Inc.	679	20 791	7 967	
Seacoast Banking Corp. of Florida	8	354	338	
SEI Investments Co.	32	2 502	2 528	
ServisFirst Bancshares Inc.	3	297	280	
Shore Bancshares Inc.	14	367	331	
Signature Bank	17	3 236	2 654	
Silvergate Capital Corp.	90	3 066	2 122	
State Street Corp.	101	10 529	10 616	
Stifel Financial Corp.	19	1 464	1 503	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
SVB Financial Group	23	10 173	7 172	
T Rowe Price Group Inc.	119	19 010	17 585	
Texas Capital Bancshares Inc.	5	423	409	
Tradeweb Markets Inc.	31	2 539	2 727	
Truist Financial Corp.	413	30 014	24 079	
Trupanion Inc.	5	343	322	
US Bancorp	391	23 724	23 104	
W R Berkley Corp.	84	5 650	8 260	
Webster Financial Corp.	48	3 055	3 079	
Wells Fargo & Co.	1 060	76 765	59 303	
Western New England Bancorp Inc.	113	1 159	1 448	
Zions Bancorp NA	27	1 848	1 798	
		1 649 337	1 679 530	8,08
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 17,72 %)				
Adobe Inc.	125	71 852	56 998	
Affirm Holdings Inc.	198	7 477	2 594	
Alarm.com Holdings Inc.	5	339	335	
Alteryx Inc.	345	27 495	23 686	
Amphenol Corp.	40	4 154	4 127	
Amtech Systems Inc.	34	401	350	
Analog Devices Inc.	177	37 816	39 339	
ANSYS Inc.	73	26 402	23 896	
Apple Inc.	4 734	641 931	833 420	
Applied Materials Inc.	279	35 358	36 813	
AppLovin Corp.	682	12 724	9 731	
Arista Networks Inc.	67	11 756	11 016	
Arrow Electronics Inc.	26	3 855	3 684	
Asana Inc.	21	2 030	392	
Atlassian Corp.	214	35 506	37 312	
Autodesk Inc.	60	15 214	15 192	
Automatic Data Processing Inc.	114	37 251	36 896	
Black Knight Inc.	44	4 547	3 681	
Blackbaud Inc.	27	2 130	2 153	
Blackline Inc.	63	6 128	5 742	
Box Inc.	304	11 111	12 823	
Broadcom Inc.	15	10 264	11 364	
Cadence Design Systems Inc.	75	15 238	16 325	
CEVA Inc.	16	900	555	
Ciena Corp.	12	830	829	
Cirrus Logic Inc.	19	1 885	1 917	
Cisco Systems Inc.	30	2 029	1 937	
Cognex Corp.	58	4 113	3 702	
Cognizant Technology Solutions Corp.	142	11 300	11 004	
CommScope Holding Co Inc.	108	1 242	1 076	
Computer Task Group Inc.	100	912	1 024	
Coupa Software Inc.	243	27 316	26 067	
CrowdStrike Holdings Inc.	109	17 187	15 550	
Daktronics Inc.	72	456	275	
DigitalOcean Holdings Inc.	216	8 156	7 454	
Diodes Inc.	90	10 715	9 285	
DocuSign Inc.	782	59 324	58 722	
Dolby Laboratories Inc.	6	597	573	
Enphase Energy Inc.	89	26 034	31 952	
Entegris Inc.	43	4 240	3 821	
Extreme Networks Inc.	659	17 834	16 349	
F5 Inc.	17	3 393	3 306	
Fidelity National Information Services Inc.	167	26 341	15 353	
First Solar Inc.	106	15 677	21 514	
FleetCor Technologies Inc.	22	7 271	5 475	
FormFactor Inc.	6	338	181	
Fortinet Inc.	184	15 274	12 189	
Global Payments Inc.	76	13 955	10 228	
Guidewire Software Inc.	438	38 338	37 128	
Hewlett Packard Enterprise Co.	357	6 708	7 720	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
HP Inc.	347	15 467	12 633	
HubSpot Inc.	49	22 980	19 196	
Impinj Inc.	56	8 279	8 284	
Intel Corp.	1 664	68 245	59 590	
Juniper Networks Inc.	90	2 895	3 897	
KLA Corp.	4	1 986	2 043	
Lattice Semiconductor Corp.	30	2 935	2 637	
Littelfuse Inc.	24	7 852	7 161	
LiveRamp Holdings Inc.	107	4 447	3 398	
Magnachip Semiconductor Corp.	15	366	191	
Marvell Technology Inc.	233	11 635	11 694	
Mastercard Inc.	236	106 578	111 194	
MaxLinear Inc.	183	9 208	8 418	
Microchip Technology Inc.	151	14 734	14 373	
Micron Technology Inc.	369	32 223	24 989	
Microsoft Corp.	1 717	478 719	557 933	
Momentive Global Inc.	1 045	17 968	9 912	
MongoDB Inc.	130	31 671	34 672	
Monolithic Power Systems Inc.	89	46 306	42 642	
Motorola Solutions Inc.	46	14 951	16 063	
NetApp Inc.	493	42 840	40 120	
Nutanix Inc.	707	19 287	24 955	
NVE Corp.	4	322	351	
NVIDIA Corp.	309	70 237	61 186	
ON Semiconductor Corp.	793	74 066	67 015	
OneSpan Inc.	20	349	303	
Palo Alto Networks Inc.	82	16 962	15 504	
Paychex Inc.	90	13 492	14 092	
Paycom Software Inc.	16	8 283	6 727	
PayPal Holdings Inc.	335	53 086	32 328	
Power Integrations Inc.	8	829	777	
Pure Storage Inc.	1 509	49 611	54 714	
Q2 Holdings Inc.	38	1 875	1 383	
Qorvo Inc.	28	3 450	3 439	
Quantum Corp.	147	360	217	
Rapid7 Inc.	244	28 832	11 234	
Rimini Street Inc.	65	359	336	
RingCentral Inc.	367	21 591	17 603	
Rogers Corp.	17	2 593	2 749	
Roper Technologies Inc.	2	1 066	1 171	
Sabre Corp.	552	4 471	4 622	
Salesforce Inc.	3	538	539	
SecureWorks Corp.	19	345	165	
Semtech Corp.	121	4 685	4 704	
Silicon Laboratories Inc.	2	364	368	
Skyworks Solutions Inc.	109	15 443	13 459	
Smartsheet Inc.	761	44 460	40 585	
SolarEdge Technologies Inc.	81	29 533	31 089	
SolarWinds Corp.	1 039	21 488	13 177	
Splunk Inc.	331	38 186	38 611	
Squarespace Inc.	72	2 078	2 163	
SS&C Technologies Holdings Inc.	64	6 217	4 515	
StarTek Inc.	56	375	285	
Super Micro Computer Inc.	26	3 095	2 892	
Synopsys Inc.	42	11 681	18 170	
TD SYNNEX Corp.	2	381	257	
Tenable Holdings Inc.	338	22 163	17 472	
Teradyne Inc.	116	14 805	13 729	
Texas Instruments Inc.	127	29 072	28 431	
Toast Inc.	70	1 886	1 710	
Trimble Inc.	71	5 058	4 864	
Unity Software Inc.	150	8 650	5 811	
Upland Software Inc.	12	560	116	
Varonis Systems Inc.	164	8 196	5 320	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Verint Systems Inc.	13	638	639	
VeriSign Inc.	30	8 133	8 351	
Visa Inc.	631	171 698	177 630	
VMware Inc.	58	9 001	9 647	
Western Digital Corp.	99	4 730	4 232	
Western Union Co.	113	2 593	2 108	
WEX Inc.	2	443	443	
Wolfspeed Inc.	107	11 858	10 009	
Workday Inc.	241	56 746	54 641	
Workiva Inc.	49	4 698	5 575	
Zscaler Inc.	23	3 660	3 487	
		3 200 207	3 329 995	16,02
Services de communication (31 décembre 2021 : 6,97 %)				
Activision Blizzard Inc.	215	22 064	22 300	
Alphabet Inc., cat. A	1 091	105 174	130 427	
Alphabet Inc., cat. C	1 458	174 312	175 289	
Altice USA Inc.	674	5 047	4 201	
Angi Inc.	1 472	17 542	4 687	
AT&T Inc.	1 954	52 098	48 742	
Bandwidth Inc.	40	1 576	1 244	
Charter Communications Inc.	31	13 085	14 243	
DHI Group Inc.	352	2 613	2 523	
DISH Network Corp.	985	20 352	18 738	
Electronic Arts Inc.	76	12 857	12 582	
Fox Corp., cat. A	1 273	54 873	52 384	
Iridium Communications Inc.	30	2 086	2 089	
JOYY Inc.	13	557	556	
Liberty Media Corp-Liberty Formula One	298	24 411	24 138	
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	966	54 577	51 217	
Live Nation Entertainment Inc.	47	5 617	4 441	
Lumen Technologies Inc.	2 021	16 542	14 294	
Meta Platforms Inc.	504	99 799	82 180	
Netflix Inc.	23	9 280	9 190	
News Corp., NAS	67	1 566	1 652	
News Corp., NASD	38	894	949	
NII Holdings Inc.	500	1 424	176	
Paramount Global	407	11 134	9 309	
Pinterest Inc.	1 558	47 667	51 256	
ROBLOX Corp.	892	36 946	34 397	
Roku Inc.	432	36 715	23 823	
Snap Inc.	553	6 829	6 706	
Spok Holdings Inc.	435	5 171	4 827	
Take-Two Interactive Software Inc.	281	38 787	39 647	
Telephone and Data Systems Inc.	229	3 506	3 255	
T-Mobile US Inc.	551	107 302	104 522	
TripAdvisor Inc.	798	28 857	19 441	
TrueCar Inc.	107	579	364	
Walt Disney Co.	1 112	164 614	130 903	
Warner Bros Discovery Inc.	655	20 380	8 413	
World Wrestling Entertainment Inc.	31	3 093	2 878	
Yelp Inc.	167	7 102	6 186	
ZoomInfo Technologies Inc.	523	21 425	21 337	
		1 238 453	1 145 506	5,51
Services publics (31 décembre 2021 : 1,51 %)				
AES Corp.	281	9 310	10 950	
Alliant Energy Corp.	67	4 912	5 012	
American Water Works Co Inc.	50	9 914	10 326	
Clearway Energy Inc., cat. C	53	2 381	2 289	
CMS Energy Corp.	78	6 100	6 693	
Constellation Energy Corp.	93	4 333	10 863	
Dominion Energy Inc.	228	22 027	18 944	
Edison International	105	7 923	9 051	
Entergy Corp.	56	8 600	8 536	
Evergy Inc.	66	5 530	5 628	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Exelon Corp.	274	10 737	16 050	
FirstEnergy Corp.	148	8 469	8 410	
New Jersey Resources Corp.	6	339	403	
NextEra Energy Partners LP	12	1 223	1 140	
NRG Energy Inc.	774	41 180	33 371	
Otter Tail Corp.	21	1 706	1 671	
Portland General Electric Co.	6	393	398	
Sempra Energy	120	23 327	25 127	
Southern Co.	4	392	387	
Sunnova Energy International Inc	274	7 812	6 686	
		176 608	181 935	0,88
Immobilier (31 décembre 2021 : 1,92 %)				
American Homes 4 Rent	89	4 181	3 635	
Boston Properties Inc.	39	6 033	3 571	
Braemar Hotels & Resorts Inc.	1 076	7 552	5 992	
Brixmor Property Group Inc.	495	15 437	15 205	
Camden Property Trust	27	5 675	4 093	
CBRE Group Inc.	88	9 226	9 176	
CubeSmart	6	329	327	
Digital Realty Trust Inc.	193	31 234	26 221	
Extra Space Storage Inc.	235	46 838	46 864	
Iron Mountain Inc.	418	28 664	28 234	
Kimco Realty Corp.	169	4 832	4 850	
Medical Properties Trust Inc.	2 582	41 599	38 973	
Outfront Media Inc.	32	706	719	
Prologis Inc.	253	38 737	38 644	
Public Storage	43	16 893	16 325	
Regency Centers Corp.	44	3 921	3 726	
SL Green Realty Corp.	12	736	548	
Uniti Group Inc.	53	712	397	
VICI Properties Inc.	1 719	73 618	75 465	
Vornado Realty Trust	222	7 644	6 260	
Welltower Inc.	378	34 884	33 573	
Weyerhaeuser Co.	203	8 497	8 527	
		387 948	371 325	1,79
Total des actions américaines – position acheteur		14 067 907	14 068 731	67,70
Actions américaines – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2021 : -1,16 %)				
Antero Resources Corp.	(28)	(1 301)	(1 176)	
APA Corp.	(609)	(40 221)	(38 519)	
Clean Energy Fuels Corp.	(93)	(768)	(655)	
Comstock Resources Inc.	(239)	(4 601)	(4 440)	
EQT Corp.	(1 466)	(82 251)	(67 199)	
Gevo Inc.	(2 202)	(6 639)	(5 669)	
Halliburton Co.	(127)	(6 701)	(6 771)	
Helmerich & Payne Inc.	(150)	(9 701)	(10 075)	
Laredo Petroleum Inc.	(307)	(23 224)	(21 389)	
Marathon Oil Corp.	(1 075)	(36 306)	(39 430)	
NexTier Oilfield Solutions Inc.	(271)	(3 425)	(3 393)	
NOV Inc.	(28)	(763)	(793)	
ONEOK Inc.	(5)	(379)	(445)	
PDC Energy Inc.	(20)	(1 749)	(1 720)	
Permian Resources Corp.	(1 840)	(23 343)	(23 435)	
Phillips 66	(18)	(2 538)	(2 538)	
Range Resources Corp.	(1 257)	(48 728)	(42 614)	
REX American Resources Corp.	(100)	(4 260)	(4 317)	
RPC Inc.	(1 243)	(9 303)	(14 973)	
Southwestern Energy Co.	(122)	(1 015)	(967)	
Tidewater Inc.	(30)	(1 296)	(1 498)	
W&T Offshore Inc.	(1 107)	(10 397)	(8 370)	
		(318 909)	(300 386)	(1,45)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Matières premières (31 décembre 2021 : -0,11 %)				
Alpha Metallurgical Resources Inc.	(7)	(1 500)	(1 388)	
Ampco-Pittsburgh Corp.	(95)	(733)	(323)	
Amyris Inc.	(2 074)	(7 163)	(4 300)	
Aspen Aerogels Inc.	(82)	(1 638)	(1 310)	
Balchem Corp.	(2)	(439)	(331)	
Cabot Corp.	(4)	(360)	(362)	
CF Industries Holdings Inc.	(32)	(4 325)	(3 694)	
Danimer Scientific Inc.	(881)	(2 699)	(2 137)	
Dow Inc.	(5)	(344)	(341)	
Ecovyst Inc.	(35)	(444)	(420)	
Flotek Industries Inc.	(1 424)	(2 186)	(2 161)	
Freeport-McMoRan Inc.	(53)	(2 719)	(2 729)	
Kaiser Aluminum Corp.	(69)	(7 985)	(7 102)	
LSB Industries Inc.	(21)	(385)	(378)	
Mativ Holdings Inc.	(61)	(1 966)	(1 727)	
Olympic Steel Inc.	(100)	(4 228)	(4 550)	
Piedmont Lithium Inc.	(61)	(4 577)	(3 638)	
Quaker Chemical Corp.	(2)	(565)	(452)	
Ramaco Resources Inc.	(224)	(3 702)	(2 668)	
Reliance Steel & Aluminum Co.	(6)	(1 659)	(1 646)	
Royal Gold Inc.	(6)	(898)	(916)	
RPM International Inc.	(15)	(2 020)	(1 981)	
Schnitzer Steel Industries Inc.	(147)	(6 473)	(6 105)	
Southern Copper Corp.	(81)	(5 759)	(6 628)	
TimkenSteel Corp.	(73)	(1 799)	(1 797)	
Tredegar Corp.	(25)	(363)	(346)	
Westlake Corp.	(12)	(1 438)	(1 667)	
		(68 367)	(61 097)	(0,29)
Industries (31 décembre 2021 : -0,91 %)				
AAON Inc.	(34)	(2 337)	(3 470)	
ACCO Brands Corp.	(50)	(420)	(379)	
Advanced Drainage Systems Inc.	(39)	(4 743)	(4 332)	
Advent Technologies Holdings Inc.	(380)	(1 983)	(932)	
Air Transport Services Group Inc.	(10)	(380)	(352)	
Albany International Corp.	(24)	(2 421)	(3 206)	
Allison Transmission Holdings Inc.	(17)	(978)	(958)	
Ameresco Inc.	(4)	(338)	(310)	
API Group Corp.	(22)	(485)	(561)	
Apogee Enterprises Inc.	(15)	(886)	(904)	
Applied Industrial Technologies Inc.	(4)	(690)	(683)	
ASGN Inc.	(3)	(346)	(331)	
Astec Industries Inc.	(41)	(3 662)	(2 259)	
Avis Budget Group Inc.	(9)	(2 708)	(1 999)	
Axon Enterprise Inc.	(5)	(1 269)	(1 124)	
AZEK Co Inc.	(388)	(10 476)	(10 683)	
Blade Air Mobility Inc.	(71)	(438)	(344)	
Blink Charging Co.	(100)	(1 625)	(1 486)	
Brink's Co.	(4)	(392)	(291)	
Builders FirstSource Inc.	(73)	(6 365)	(6 417)	
CACI International Inc.	(1)	(404)	(407)	
ChargePoint Holdings Inc.	(1 413)	(24 233)	(18 246)	
Clean Harbors Inc.	(2)	(324)	(309)	
Desktop Metal Inc.	(3 576)	(22 698)	(6 590)	
Douglas Dynamics Inc.	(7)	(374)	(343)	
Dycom Industries Inc.	(21)	(2 623)	(2 663)	
Energous Corp.	(275)	(367)	(312)	
ESS Tech Inc.	(106)	(357)	(349)	
FedEx Corp.	(9)	(2 146)	(2 112)	
FuelCell Energy Inc.	(2 844)	(12 967)	(10 713)	
GEO Group Inc.	(104)	(1 694)	(1 543)	
Gibraltar Industries Inc.	(48)	(3 216)	(2 984)	
Global Industrial Co.	(30)	(1 042)	(956)	
Greenbrier Cos Inc.	(40)	(1 867)	(1 817)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Hawaiian Holdings Inc.	(68)	(1 181)	(945)	
Helios Technologies Inc.	(3)	(417)	(221)	
Hubbell Inc.	(1)	(342)	(318)	
Huntington Ingalls Industries Inc.	(3)	(956)	(938)	
Hyllion Holdings Corp.	(1 623)	(7 206)	(5 146)	
Hyster-Yale Materials Handling Inc.	(6)	(709)	(206)	
Hyzon Motors Inc.	(161)	(357)	(338)	
Ideanomics Inc.	(5 551)	(13 417)	(1 234)	
INNOVATE Corp.	(543)	(926)	(1 361)	
Innovative Solutions and Support Inc.	(100)	(1 201)	(1 114)	
Interface Inc.	(90)	(1 640)	(1 204)	
KAR Auction Services Inc.	(254)	(4 598)	(4 491)	
Kirby Corp.	(60)	(5 430)	(5 231)	
Leidos Holdings Inc.	(7)	(1 029)	(998)	
Lindsay Corp.	(2)	(384)	(441)	
MasTec Inc.	(9)	(1 045)	(1 041)	
Matson Inc.	(38)	(3 486)	(3 219)	
MYR Group Inc.	(2)	(301)	(250)	
Orion Group Holdings Inc.	(96)	(611)	(310)	
Otis Worldwide Corp.	(10)	(896)	(1 061)	
Owens Corning	(3)	(385)	(347)	
PACCAR Inc.	(22)	(2 974)	(2 950)	
Park Aerospace Corp.	(75)	(1 158)	(1 363)	
Parsons Corp.	(12)	(559)	(752)	
Performant Financial Corp.	(111)	(360)	(543)	
Plug Power Inc.	(729)	(14 260)	(12 219)	
Proterra Inc.	(581)	(4 208)	(2 968)	
Ryder System Inc.	(3)	(377)	(340)	
Shoals Technologies Group Inc.	(367)	(12 757)	(12 268)	
Shyft Group Inc.	(7)	(370)	(236)	
Snap-on Inc.	(7)	(2 188)	(2 167)	
Standex International Corp.	(5)	(652)	(694)	
Steelcase Inc.	(23)	(354)	(220)	
Stem Inc.	(813)	(13 958)	(9 848)	
Sunrun Inc.	(38)	(1 387)	(1 237)	
Tennant Co.	(8)	(667)	(667)	
Titan International Inc.	(294)	(4 214)	(6 103)	
TuSimple Holdings Inc.	(628)	(1 656)	(1 396)	
Twin Disc Inc.	(33)	(633)	(435)	
Uber Technologies Inc.	(87)	(3 051)	(2 915)	
Univar Solutions Inc.	(9)	(386)	(388)	
Universal Logistics Holdings Inc.	(7)	(360)	(317)	
Watts Water Technologies Inc.	(4)	(705)	(793)	
Willdan Group Inc.	(415)	(15 157)	(10 037)	
XPO Inc.	(19)	(907)	(857)	
		(247 069)	(192 492)	(0,93)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -0,87 %)				
Abercrombie & Fitch Co.	(29)	(936)	(900)	
Acushnet Holdings Corp.	(30)	(1 591)	(1 726)	
American Eagle Outfitters Inc.	(120)	(2 408)	(2 270)	
AMMO Inc.	(1 300)	(10 501)	(3 047)	
AutoNation Inc.	(12)	(1 874)	(1 745)	
Bassett Furniture Industries Inc.	(151)	(3 571)	(3 556)	
Best Buy Co Inc.	(4)	(466)	(435)	
Boot Barn Holdings Inc.	(6)	(535)	(508)	
Brinker International Inc.	(96)	(4 413)	(4 151)	
Caleres Inc.	(119)	(3 813)	(3 592)	
Canoo Inc.	(2 033)	(6 548)	(3 388)	
Carter's Inc.	(5)	(507)	(505)	
Carvana Co.	(1 031)	(11 650)	(6 622)	
Chewy Inc.	(73)	(3 719)	(3 668)	
Chico's FAS Inc.	(1 517)	(9 969)	(10 113)	
Columbia Sportswear Co.	(19)	(1 962)	(2 255)	
Conn's Inc.	(138)	(1 812)	(1 286)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
ContextLogic Inc.	(2 099)	(1 801)	(1 387)	
Crocs Inc.	(157)	(11 257)	(23 066)	
Deckers Outdoor Corp.	(52)	(27 051)	(28 124)	
Designer Brands Inc.	(27)	(400)	(358)	
Domino's Pizza Inc.	(1)	(457)	(469)	
Duluth Holdings Inc.	(357)	(2 978)	(2 989)	
Escalade Inc.	(200)	(2 860)	(2 759)	
Ethan Allen Interiors Inc.	(219)	(6 846)	(7 840)	
Faraday Future Intelligent Electric Inc.	(1 907)	(705)	(750)	
Fiesta Restaurant Group Inc.	(30)	(366)	(299)	
Flexsteel Industries Inc.	(26)	(745)	(543)	
Floor & Decor Holdings Inc.	(3)	(310)	(283)	
Full House Resorts Inc.	(113)	(1 106)	(1 151)	
Funko Inc.	(449)	(11 840)	(6 637)	
Genesco Inc.	(10)	(815)	(624)	
Gentherm Inc.	(9)	(794)	(796)	
G-III Apparel Group Ltd.	(264)	(4 909)	(4 904)	
Graham Holdings Co.	(1)	(737)	(819)	
Groupon Inc.	(32)	(361)	(372)	
GrowGeneration Corp.	(638)	(11 307)	(3 389)	
Hamilton Beach Brands Holding Co., cat. A	(119)	(2 305)	(1 998)	
Haverty Furniture Cos Inc.	(239)	(8 670)	(9 683)	
Hooker Furnishings Corp.	(100)	(2 129)	(2 534)	
Inspired Entertainment Inc.	(54)	(814)	(927)	
Kontoor Brands Inc.	(66)	(3 730)	(3 576)	
Lakeland Industries Inc.	(21)	(366)	(378)	
Lands' End Inc.	(35)	(350)	(360)	
Laureate Education Inc.	(26)	(354)	(339)	
Lazydays Holdings Inc.	(50)	(854)	(809)	
Lear Corp.	(2)	(435)	(336)	
Lifetime Brands Inc.	(19)	(437)	(195)	
Light & Wonder Inc.	(8)	(696)	(635)	
Lordstown Motors Corp.	(1 096)	(2 628)	(1 693)	
Lovesac Co.	(156)	(9 819)	(4 652)	
Lululemon Athletica Inc.	(1)	(516)	(434)	
Luminar Technologies Inc.	(604)	(6 640)	(4 051)	
Macy's Inc.	(94)	(2 976)	(2 630)	
MDC Holdings Inc.	(5)	(316)	(214)	
MercadoLibre Inc.	(42)	(52 534)	(48 158)	
Meritage Homes Corp.	(10)	(1 230)	(1 249)	
Mohawk Industries Inc.	(7)	(923)	(970)	
Motorcar Parts of America Inc.	(878)	(21 026)	(14 109)	
Mullen Automotive Inc.	(12 003)	(4 132)	(4 651)	
National Vision Holdings Inc.	(19)	(1 025)	(998)	
Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc.	(5)	(330)	(317)	
ONE Group Hospitality Inc.	(173)	(1 539)	(1 477)	
Overstock.com Inc.	(13)	(360)	(341)	
Oxford Industries Inc.	(6)	(901)	(758)	
Peloton Interactive Inc.	(1 000)	(14 463)	(10 758)	
Planet Fitness Inc.	(3)	(317)	(320)	
PLBY Group Inc.	(83)	(349)	(309)	
PLBY Group Inc., droits, éch. le 17 janvier 2023	(83)	–	–	
Pool Corp.	(2)	(878)	(819)	
Purple Innovation Inc.	(1 260)	(35 507)	(8 178)	
PVH Corp.	(55)	(5 369)	(5 261)	
Quotient Technology Inc.	(511)	(2 131)	(2 375)	
RealReal Inc.	(205)	(421)	(347)	
RH	(12)	(4 278)	(4 344)	
Six Flags Entertainment Corp.	(101)	(3 173)	(3 182)	
Smith & Wesson Brands Inc.	(236)	(3 329)	(2 776)	
Sonos Inc.	(211)	(4 976)	(4 832)	
Spruce Power Holding Corp.	(1 925)	(15 926)	(2 397)	
Steven Madden Ltd.	(14)	(612)	(606)	
Stoneridge Inc.	(63)	(1 645)	(1 840)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Strattec Security Corp.	(24)	(1 108)	(668)	
Superior Group of Cos Inc.	(25)	(359)	(341)	
Tapestry Inc.	(57)	(2 902)	(2 941)	
Target Hospitality Corp.	(430)	(7 252)	(8 821)	
Tempur Sealy International Inc.	(64)	(2 952)	(2 977)	
Topgolf Callaway Brands Corp.	(357)	(10 238)	(9 553)	
Tupperware Brands Corp.	(242)	(1 500)	(1 358)	
Under Armour Inc., cat. A	(956)	(12 712)	(13 161)	
Unifi Inc.	(110)	(1 712)	(1 283)	
Universal Electronics Inc.	(127)	(3 956)	(3 581)	
Vail Resorts Inc.	(2)	(678)	(646)	
Vera Bradley Inc.	(87)	(372)	(534)	
Victoria's Secret & Co.	(33)	(1 933)	(1 600)	
Vinco Ventures Inc.	(697)	(690)	(438)	
Vista Outdoor Inc.	(13)	(486)	(429)	
Visteon Corp.	(26)	(3 696)	(4 609)	
Vroom Inc.	(2 039)	(3 372)	(2 818)	
Vuzix Corp.	(809)	(6 761)	(3 990)	
Weyco Group Inc.	(9)	(337)	(258)	
Winnebago Industries Inc.	(6)	(408)	(428)	
Workhorse Group Inc.	(792)	(2 856)	(1 631)	
XPEL Inc.	(56)	(4 130)	(4 557)	
		(445 739)	(360 764)	(1,74)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -0,45 %)				
22nd Century Group Inc.	(121)	(347)	(151)	
Alico Inc.	(83)	(3 529)	(2 684)	
Beauty Health Co.	(261)	(3 654)	(3 218)	
BellRing Brands Inc.	(14)	(481)	(486)	
Boston Beer Co Inc.	(1)	(445)	(446)	
Calavo Growers Inc.	(59)	(3 052)	(2 350)	
Cal-Maine Foods Inc.	(14)	(1 056)	(1 033)	
Embotelladora Andina SA	(23)	(351)	(452)	
Freshpet Inc.	(277)	(21 023)	(19 806)	
Hain Celestial Group Inc.	(108)	(2 705)	(2 368)	
Honest Co Inc.	(520)	(1 928)	(2 121)	
John B Sanfilippo & Son Inc.	(3)	(338)	(331)	
Lifecore Biomedical Inc.	(100)	(965)	(878)	
LifeMD Inc.	(404)	(2 213)	(1 062)	
Nu Skin Enterprises Inc.	(10)	(554)	(571)	
Rite Aid Corp.	(749)	(5 373)	(3 390)	
SpartanNash Co.	(23)	(1 003)	(942)	
United Natural Foods Inc.	(42)	(2 273)	(2 203)	
Vector Group Ltd.	(19)	(364)	(305)	
WD-40 Co.	(9)	(2 220)	(1 966)	
Whole Earth Brands Inc.	(305)	(2 947)	(1 682)	
		(56 821)	(48 445)	(0,23)
Soins de santé (31 décembre 2021 : -1,82 %)				
2seventy bio Inc.	(34)	(717)	(432)	
Accolade Inc.	(56)	(623)	(591)	
Accuray Inc.	(131)	(356)	(371)	
Agenus Inc.	(445)	(1 513)	(1 447)	
Alaunos Therapeutics Inc.	(2 209)	(8 598)	(1 943)	
Align Technology Inc.	(12)	(3 238)	(3 429)	
Alignment Healthcare Inc.	(439)	(7 134)	(6 995)	
Allakos Inc.	(213)	(2 075)	(2 430)	
Allogene Therapeutics Inc.	(468)	(5 653)	(3 989)	
Allovir Inc.	(127)	(1 215)	(883)	
Alphatec Holdings Inc.	(965)	(12 750)	(16 148)	
Anavex Life Sciences Corp.	(46)	(542)	(577)	
ANI Pharmaceuticals Inc.	(23)	(1 073)	(1 254)	
Apollo Medical Holdings Inc.	(45)	(1 797)	(1 804)	
Arcturus Therapeutics Holdings Inc.	(220)	(5 119)	(5 056)	
Arcus Biosciences Inc.	(48)	(2 139)	(1 345)	
Artivion Inc.	(14)	(356)	(230)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Asensus Surgical Inc.	(1 965)	(2 663)	(924)	
Atara Biotherapeutics Inc.	(73)	(419)	(324)	
Avid Bioservices Inc.	(88)	(1 673)	(1 642)	
Avidity Biosciences Inc.	(92)	(2 388)	(2 766)	
Beam Therapeutics Inc.	(7)	(412)	(371)	
Becton Dickinson and Co.	(6)	(2 058)	(2 067)	
BioLife Solutions Inc.	(553)	(16 061)	(13 637)	
Bionano Genomics Inc.	(6 003)	(22 917)	(11 875)	
Bio-Techne Corp.	(50)	(5 720)	(5 615)	
Bluebird Bio Inc.	(987)	(8 748)	(9 254)	
Boston Scientific Corp.	(6)	(378)	(376)	
Butterfly Network Inc.	(786)	(3 104)	(2 620)	
Cano Health Inc.	(1 472)	(2 454)	(2 732)	
Cara Therapeutics Inc.	(401)	(6 246)	(5 835)	
Cardiff Oncology Inc.	(739)	(3 986)	(1 402)	
CareMax Inc.	(317)	(1 636)	(1 568)	
Caribou Biosciences Inc.	(134)	(1 443)	(1 140)	
Cassava Sciences Inc.	(98)	(4 622)	(3 922)	
Catalent Inc.	(797)	(50 217)	(48 606)	
Celcuity Inc.	(208)	(2 669)	(3 948)	
Celularity Inc.	(307)	(686)	(537)	
Charles River Laboratories International Inc.	(4)	(1 219)	(1 181)	
Checkpoint Therapeutics Inc.	(102)	(3 068)	(706)	
ChromaDex Corp.	(176)	(347)	(401)	
ClearPoint Neuro Inc.	(133)	(1 593)	(1 526)	
Clearside Biomedical Inc.	(54)	(376)	(82)	
Computer Programs and Systems Inc.	(37)	(1 393)	(1 365)	
CorMedix Inc.	(367)	(1 741)	(2 098)	
CTI BioPharma Corp.	(666)	(4 846)	(5 423)	
Cue Biopharma Inc.	(85)	(391)	(328)	
CytoSorbents Corp.	(59)	(345)	(124)	
DarioHealth Corp.	(586)	(3 735)	(3 398)	
Deciphera Pharmaceuticals Inc.	(76)	(1 710)	(1 688)	
DocGo Inc.	(661)	(6 040)	(6 332)	
Dynavax Technologies Corp.	(300)	(4 963)	(4 325)	
Dyne Therapeutics Inc.	(50)	(715)	(785)	
Editas Medicine Inc.	(456)	(6 013)	(5 480)	
Emergent BioSolutions Inc.	(35)	(549)	(560)	
Ensign Group Inc.	(5)	(658)	(641)	
Enzo Biochem Inc.	(123)	(378)	(238)	
Evelo Biosciences Inc.	(114)	(399)	(249)	
Fulcrum Therapeutics Inc.	(162)	(1 249)	(1 598)	
Fulgent Genetics Inc.	(761)	(37 795)	(30 707)	
G1 Therapeutics Inc.	(160)	(1 336)	(1 177)	
Geron Corp.	(226)	(697)	(741)	
Ginkgo Bioworks Holdings Inc.	(123)	(344)	(282)	
Globus Medical Inc.	(4)	(399)	(403)	
Harvard Bioscience Inc.	(627)	(2 324)	(2 353)	
Heska Corp.	(93)	(8 335)	(7 833)	
Hologic Inc.	(58)	(5 905)	(5 879)	
ImmunityBio Inc.	(754)	(4 217)	(5 180)	
Immune Bio Inc.	(38)	(357)	(326)	
Inotiv Inc.	(325)	(2 976)	(2 175)	
Inovio Pharmaceuticals Inc.	(2 661)	(7 706)	(5 625)	
Integer Holdings Corp.	(3)	(321)	(278)	
Integra LifeSciences Holdings Corp.	(4)	(359)	(304)	
Intellia Therapeutics Inc.	(27)	(1 333)	(1 276)	
Invitae Corp.	(1 889)	(15 497)	(4 761)	
iTeos Therapeutics Inc.	(21)	(589)	(556)	
Joint Corp.	(50)	(997)	(947)	
KemPharm Inc.	(100)	(610)	(622)	
Lantheus Holdings Inc.	(22)	(1 571)	(1 519)	
Marinus Pharmaceuticals Inc.	(557)	(4 806)	(3 004)	
Masimo Corp.	(4)	(788)	(802)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
MiMedx Group Inc.	(470)	(2 952)	(1 770)	
Moderna Inc.	(132)	(29 555)	(32 126)	
Multiplan Corp.	(105)	(342)	(164)	
Natera Inc.	(291)	(15 647)	(15 839)	
Neogen Corp.	(318)	(6 645)	(6 562)	
Neuronetics Inc.	(67)	(359)	(624)	
Novavax Inc.	(357)	(9 131)	(4 973)	
Oak Street Health Inc.	(27)	(796)	(787)	
Ocugen Inc.	(320)	(663)	(564)	
Ocular Therapeutix Inc.	(183)	(897)	(697)	
Omeros Corp.	(176)	(622)	(539)	
Oramed Pharmaceuticals Inc.	(234)	(1 366)	(3 814)	
Organon & Co.	(23)	(870)	(870)	
Outlook Therapeutics Inc.	(2 338)	(4 345)	(3 421)	
Pacific Biosciences of California Inc.	(1 069)	(14 741)	(11 848)	
PAVmed Inc.	(1 002)	(2 709)	(652)	
Pennant Group Inc.	(40)	(1 240)	(595)	
Penumbra Inc.	(33)	(9 292)	(9 947)	
Phreesia Inc.	(100)	(4 715)	(4 385)	
Praxis Precision Medicines Inc.	(270)	(774)	(871)	
Premier Inc.	(49)	(2 211)	(2 322)	
Progyny Inc.	(188)	(8 212)	(7 935)	
Provention Bio Inc.	(553)	(6 843)	(7 920)	
QuidelOrtho Corp.	(139)	(15 253)	(16 135)	
R1 RCM Inc.	(2 425)	(27 182)	(35 979)	
RAPT Therapeutics Inc.	(48)	(1 157)	(1 288)	
Reata Pharmaceuticals Inc.	(36)	(1 756)	(1 853)	
Relay Therapeutics Inc.	(25)	(511)	(506)	
REVOLUTION Medicines Inc.	(107)	(3 164)	(3 453)	
Rhythm Pharmaceuticals Inc.	(210)	(6 234)	(8 286)	
Rigel Pharmaceuticals Inc.	(258)	(804)	(524)	
Rocket Pharmaceuticals Inc.	(126)	(3 429)	(3 341)	
Sana Biotechnology Inc.	(111)	(641)	(594)	
Schrodinger Inc.	(22)	(614)	(557)	
SCYNEXIS Inc.	(547)	(2 874)	(1 156)	
Seagen Inc.	(2)	(456)	(348)	
Seelos Therapeutics Inc.	(991)	(1 335)	(912)	
Senseonics Holdings Inc.	(1 452)	(2 827)	(2 026)	
Sesen Bio Inc.	(275)	(315)	(227)	
SIGA Technologies Inc.	(100)	(1 051)	(997)	
Simulations Plus Inc.	(100)	(5 538)	(4 955)	
Societal CDMO Inc.	(160)	(328)	(323)	
Solid Biosciences Inc.	(1)	(343)	(7)	
Sonida Senior Living Inc.	(21)	(418)	(357)	
Sorrento Therapeutics Inc.	(1 107)	(1 768)	(1 329)	
Spectrum Pharmaceuticals Inc.	(1 000)	(1 552)	(499)	
Stereotaxis Inc.	(318)	(921)	(892)	
Surgery Partners Inc.	(49)	(1 781)	(1 850)	
Surmodics Inc.	(25)	(1 122)	(1 156)	
TG Therapeutics Inc.	(774)	(6 637)	(12 407)	
Tilray Brands Inc., NASD	(4 391)	(22 503)	(16 004)	
TransMedics Group Inc.	(8)	(595)	(669)	
Twist Bioscience Corp.	(19)	(625)	(613)	
Universal Health Services Inc., cat. B	(33)	(6 169)	(6 300)	
Varex Imaging Corp.	(12)	(364)	(330)	
Vaxart Inc.	(205)	(386)	(267)	
Vaxcyte Inc.	(12)	(748)	(780)	
Veradigm Inc.	(439)	(11 026)	(10 493)	
Verrica Pharmaceuticals Inc.	(35)	(350)	(130)	
Verve Therapeutics Inc.	(213)	(6 340)	(5 585)	
Viracta Therapeutics Inc.	(115)	(663)	(228)	
VolitionRX Ltd.	(164)	(707)	(540)	
West Pharmaceutical Services Inc.	(1)	(544)	(319)	
Xeris Biopharma Holdings Inc.	(1 647)	(2 889)	(2 968)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
XOMA Corp.	(67)	(1 473)	(1 670)	
Zimmer Biomet Holdings Inc.	(2)	(342)	(346)	
Zoetis Inc.	(2)	(393)	(397)	
		(607 443)	(554 184)	(2,67)
Services financiers (31 décembre 2021 : -0,17 %)				
Acacia Research Corp.	(73)	(359)	(416)	
ACNB Corp.	(50)	(2 204)	(2 697)	
AG Mortgage Investment Trust Inc.	(99)	(986)	(712)	
AGNC Investment Corp.	(131)	(1 596)	(1 837)	
Ambac Financial Group Inc.	(1 024)	(10 517)	(24 198)	
Ameriprise Financial Inc.	(1)	(441)	(422)	
Ames National Corp.	(47)	(1 479)	(1 504)	
Arlington Asset Investment Corp.	(447)	(1 956)	(1 775)	
Associated Banc-Corp	(601)	(19 733)	(18 803)	
Atlantius Holdings Corp.	(100)	(3 778)	(3 550)	
Bank First Corp.	(35)	(4 534)	(4 402)	
Bank of Hawaii Corp.	(17)	(1 812)	(1 787)	
BankFinancial Corp.	(28)	(365)	(400)	
BankUnited Inc.	(7)	(340)	(322)	
BayCom Corp.	(100)	(2 566)	(2 572)	
Berkshire Hills Bancorp Inc.	(19)	(760)	(770)	
BOK Financial Corp.	(6)	(816)	(844)	
BrightSpire Capital Inc.	(206)	(2 109)	(1 739)	
Business First Bancshares Inc.	(13)	(369)	(390)	
C&F Financial Corp.	(28)	(2 140)	(2 211)	
Capital City Bank Group Inc.	(100)	(3 382)	(4 404)	
Cherry Hill Mortgage Investment Corp.	(796)	(5 900)	(6 256)	
Citizens & Northern Corp.	(100)	(3 268)	(3 097)	
Codorus Valley Bancorp Inc.	(14)	(362)	(451)	
Colony Bancorp Inc.	(308)	(5 661)	(5 296)	
Columbia Financial Inc.	(89)	(2 219)	(2 607)	
Curo Group Holdings Corp.	(398)	(1 866)	(1 914)	
CVB Financial Corp.	(24)	(742)	(837)	
Dynex Capital Inc.	(27)	(451)	(465)	
Eagle Bancorp Montana Inc.	(49)	(1 258)	(1 073)	
Ellington Residential Mortgage REIT	(97)	(890)	(902)	
Encore Capital Group Inc.	(141)	(9 079)	(9 159)	
Enterprise Financial Services Corp.	(100)	(6 453)	(6 634)	
First American Financial Corp.	(60)	(4 241)	(4 255)	
First Bancorp/Southern Pines NC	(6)	(360)	(348)	
First Community Bankshares Inc.	(10)	(351)	(459)	
First Guaranty Bancshares Inc.	(100)	(3 169)	(3 177)	
First Internet Bancorp	(100)	(4 961)	(3 290)	
First Northwest Bancorp	(200)	(4 295)	(4 162)	
First Republic Bank	(8)	(1 322)	(1 321)	
First Savings Financial Group Inc.	(100)	(3 058)	(2 710)	
First Western Financial Inc.	(200)	(7 615)	(7 628)	
Flywire Corp.	(14)	(391)	(464)	
Franklin BSP Realty Trust Inc.	(568)	(11 097)	(9 928)	
FS Bancorp Inc.	(10)	(374)	(453)	
FVCBankcorp Inc.	(19)	(493)	(491)	
Great Southern Bancorp Inc.	(50)	(4 177)	(4 030)	
Greene County Bancorp Inc.	(50)	(3 180)	(3 890)	
Hanmi Financial Corp.	(65)	(2 356)	(2 180)	
HCI Group Inc.	(31)	(1 831)	(1 663)	
Heartland Financial USA Inc.	(100)	(6 107)	(6 317)	
Heritage Financial Corp.	(171)	(6 981)	(7 099)	
Hingham Institution For Savings The	(1)	(407)	(374)	
Investar Holding Corp.	(114)	(3 325)	(3 326)	
Jefferies Financial Group Inc.	(7)	(356)	(325)	
KKR Real Estate Finance Trust Inc.	(15)	(345)	(284)	
Lakeland Financial Corp.	(4)	(336)	(395)	
LendingClub Corp.	(44)	(606)	(525)	
Lument Finance Trust Inc.	(101)	(364)	(260)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Malvern Bancorp Inc.	(100)	(1 947)	(2 405)	
MBIA Inc.	(263)	(4 031)	(4 579)	
Moelis & Co.	(50)	(2 951)	(2 599)	
MVB Financial Corp.	(50)	(1 651)	(1 492)	
National Bank Holdings Corp.	(162)	(9 480)	(9 235)	
New York Community Bancorp Inc.	(987)	(11 970)	(11 501)	
Nicolet Bankshares Inc.	(2)	(196)	(216)	
Northeast Bank	(69)	(3 712)	(3 936)	
Northfield Bancorp Inc.	(68)	(1 454)	(1 449)	
Old Republic International Corp.	(40)	(1 315)	(1 309)	
Orchid Island Capital Inc.	(328)	(5 700)	(4 666)	
Penns Woods Bancorp Inc.	(100)	(3 635)	(3 607)	
Perella Weinberg Partners	(393)	(5 197)	(5 218)	
Preferred Bank	(35)	(3 547)	(3 539)	
Provident Financial Holdings Inc.	(18)	(349)	(336)	
RBB Bancorp	(50)	(1 332)	(1 413)	
Republic First Bancorp Inc.	(1 079)	(4 544)	(3 143)	
Simmons First National Corp.	(5)	(123)	(146)	
South Plains Financial Inc.	(31)	(1 305)	(1 156)	
Sterling Bancorp Inc.	(100)	(850)	(825)	
TriCo Bancshares	(44)	(2 556)	(3 040)	
Two Harbors Investment Corp.	(17)	(322)	(363)	
United Bankshares Inc.	(96)	(5 231)	(5 267)	
Universal Insurance Holdings Inc.	(54)	(779)	(775)	
Valley National Bancorp	(45)	(726)	(690)	
Velocity Financial Inc.	(34)	(463)	(445)	
Washington Federal Inc.	(7)	(352)	(318)	
Washington Trust Bancorp Inc.	(79)	(5 152)	(5 050)	
Waterstone Financial Inc.	(17)	(354)	(397)	
West Bancorp Inc.	(61)	(2 032)	(2 112)	
Western Alliance Bancorp	(44)	(3 725)	(3 551)	
WisdomTree Inc.	(365)	(2 648)	(2 695)	
World Acceptance Corp.	(9)	(2 615)	(804)	
		(264 733)	(272 077)	(1,31)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -0,70 %)				
8x8 Inc.	(252)	(1 490)	(1 468)	
ACV Auctions Inc.	(36)	(433)	(400)	
Advanced Micro Devices Inc.	(392)	(38 111)	(34 402)	
Akoustis Technologies Inc.	(773)	(5 406)	(2 954)	
Alkami Technology Inc.	(321)	(5 123)	(6 346)	
Amkor Technology Inc.	(47)	(1 128)	(1 527)	
Arlo Technologies Inc.	(31)	(346)	(147)	
Atomera Inc.	(580)	(9 849)	(4 888)	
Avaya Holdings Corp.	(316)	(600)	(84)	
Avnet Inc.	(7)	(351)	(394)	
Bill.com Holdings Inc.	(229)	(35 569)	(33 809)	
Block Inc.	(16)	(1 549)	(1 362)	
Broadridge Financial Solutions Inc.	(8)	(1 561)	(1 454)	
C3.ai Inc.	(727)	(12 605)	(11 023)	
Cleantech Inc.	(366)	(6 181)	(1 012)	
Clearfield Inc.	(3)	(432)	(383)	
Cloudflare Inc.	(32)	(2 081)	(1 960)	
Corning Inc.	(79)	(3 611)	(3 419)	
CTS Corp.	(21)	(959)	(1 122)	
Dell Technologies Inc.	(6)	(362)	(327)	
Digimarc Corp.	(83)	(2 637)	(2 079)	
Digital Turbine Inc.	(932)	(43 890)	(19 245)	
DXC Technology Co.	(41)	(1 477)	(1 472)	
E2open Parent Holdings Inc.	(200)	(1 504)	(1 591)	
Eastman Kodak Co.	(585)	(3 080)	(2 418)	
Ebix Inc.	(8)	(382)	(216)	
Edgio Inc.	(530)	(1 000)	(811)	
EPAM Systems Inc.	(6)	(2 898)	(2 664)	
Fabrinet	(4)	(651)	(695)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Fair Isaac Corp.	(4)	(3 264)	(3 244)	
FARO Technologies Inc.	(5)	(357)	(199)	
Fastly Inc.	(158)	(1 921)	(1 753)	
Five9 Inc.	(4)	(370)	(368)	
Gen Digital Inc.	(32)	(1 009)	(929)	
Grid Dynamics Holdings Inc.	(140)	(3 574)	(2 128)	
Identiv Inc.	(46)	(1 406)	(451)	
International Business Machines Corp.	(17)	(3 232)	(3 245)	
Intevac Inc.	(115)	(704)	(1 008)	
IonQ Inc.	(895)	(5 781)	(4 184)	
IPG Photonics Corp.	(3)	(392)	(385)	
Iteris Inc.	(634)	(2 510)	(2 672)	
Jack Henry & Associates Inc.	(1)	(247)	(238)	
Kimball Electronics Inc.	(100)	(3 314)	(3 061)	
Kopin Corp.	(214)	(349)	(360)	
Kyndryl Holdings Inc.	(57)	(842)	(859)	
Lam Research Corp.	(1)	(605)	(569)	
LivePerson Inc.	(527)	(7 661)	(7 241)	
MACOM Technology Solutions Holdings Inc.	(4)	(331)	(341)	
Magic Software Enterprises Ltd.	(48)	(1 123)	(1 031)	
Marathon Digital Holdings Inc.	(1 409)	(17 531)	(6 529)	
Marqeta Inc.	(62)	(525)	(513)	
Matterport Inc.	(356)	(1 492)	(1 351)	
Meta Materials Inc.	(2 313)	(5 948)	(3 729)	
MicroVision Inc.	(1 504)	(6 864)	(4 789)	
MICT Inc.	(1 466)	(2 115)	(1 649)	
MKS Instruments Inc.	(22)	(2 500)	(2 526)	
Napco Security Technologies Inc.	(254)	(4 941)	(9 458)	
Navitas Semiconductor Corp.	(515)	(2 816)	(2 449)	
NCR Corp.	(34)	(1 069)	(1 078)	
ON24 Inc.	(83)	(940)	(971)	
OSI Systems Inc.	(3)	(357)	(323)	
PAR Technology Corp.	(146)	(6 547)	(5 157)	
Paylocity Holding Corp.	(1)	(339)	(263)	
PDF Solutions Inc.	(176)	(4 528)	(6 801)	
PFSweb Inc.	(47)	(727)	(392)	
Plexus Corp.	(3)	(362)	(418)	
Powerfleet Inc.	(510)	(1 951)	(1 859)	
QUALCOMM Inc.	(5)	(736)	(745)	
QuickLogic Corp.	(191)	(1 654)	(1 330)	
Rackspace Technology Inc.	(140)	(916)	(560)	
Repay Holdings Corp.	(538)	(11 283)	(5 868)	
Riot Platforms Inc.	(1 132)	(23 932)	(5 200)	
Shift4 Payments Inc.	(65)	(3 969)	(4 926)	
ShotSpotter Inc.	(217)	(11 926)	(9 947)	
SiTime Corp.	(44)	(9 070)	(6 058)	
Smith Micro Software Inc.	(1 255)	(4 848)	(3 571)	
Snowflake Inc.	(59)	(11 466)	(11 475)	
Sprout Social Inc.	(131)	(10 267)	(10 022)	
Sumo Logic Inc.	(264)	(2 765)	(2 897)	
Synaptics Inc.	(3)	(378)	(387)	
Telos Corp.	(172)	(930)	(1 186)	
Turtle Beach Corp.	(118)	(4 699)	(1 146)	
Twilio Inc.	(121)	(7 798)	(8 027)	
Universal Display Corp.	(5)	(790)	(732)	
Velodyne Lidar Inc.	(2 766)	(24 402)	(2 769)	
Veritone Inc.	(54)	(461)	(388)	
Vertex Inc.	(100)	(2 166)	(1 966)	
Viasat Inc.	(33)	(1 412)	(1 415)	
Wrap Technologies Inc.	(246)	(785)	(563)	
Xerox Holdings Corp.	(92)	(2 007)	(1 820)	
Yext Inc.	(129)	(901)	(1 141)	
Zebra Technologies Corp.	(1)	(342)	(347)	
		(425 713)	(308 679)	(1,49)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Services de communication (31 décembre 2021 : -0,19 %)				
AMC Entertainment Holdings Inc.	(238)	(3 577)	(1 312)	
AMC Entertainment Holdings Inc., actions priv.	(125)	(1 133)	(239)	
ATN International Inc.	(139)	(7 792)	(8 534)	
Cardlytics Inc.	(326)	(10 171)	(2 553)	
Cars.com Inc.	(271)	(4 697)	(5 056)	
Cinedigm Corp.	(2 984)	(5 930)	(1 568)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	(756)	(2 914)	(1 076)	
ComScore Inc.	(1 091)	(2 338)	(1 715)	
Cumulus Media Inc.	(453)	(4 315)	(3 812)	
CuriosityStream Inc.	(483)	(1 716)	(746)	
Emerald Holding Inc.	(172)	(829)	(825)	
Entravision Communications Corp.	(218)	(1 361)	(1 418)	
EverQuote Inc.	(180)	(2 048)	(3 595)	
EW Scripps Co.	(373)	(6 986)	(6 666)	
FuboTV Inc.	(1 669)	(6 355)	(3 935)	
Globalstar Inc.	(1 789)	(3 010)	(3 224)	
iHeartMedia Inc.	(165)	(1 727)	(1 370)	
Interpublic Group of Cos Inc.	(80)	(3 626)	(3 611)	
Liberty Broadband Corp.	(178)	(17 345)	(18 395)	
Loyalty Ventures Inc.	(122)	(355)	(398)	
Magnite Inc.	(421)	(6 007)	(6 041)	
Marchex Inc., cat. B	(112)	(369)	(238)	
Marcus Corp.	(24)	(526)	(468)	
MediaAlpha Inc.	(94)	(1 518)	(1 267)	
Reading International Inc.	(168)	(882)	(631)	
Saga Communications Inc.	(100)	(3 319)	(3 198)	
Skillz Inc.	(274)	(361)	(188)	
TechTarget Inc.	(7)	(627)	(418)	
Townsquare Media Inc.	(116)	(1 142)	(1 140)	
Trade Desk Inc.	(121)	(8 254)	(7 350)	
Travelzoo	(150)	(1 527)	(904)	
Ziff Davis Inc.	(13)	(1 490)	(1 393)	
		(114 247)	(93 284)	(0,45)
Services publics (31 décembre 2021 : -0,03 %)				
American Electric Power Co Inc.	(7)	(941)	(901)	
American States Water Co.	(3)	(342)	(376)	
Array Technologies Inc.	(18)	(465)	(471)	
Avista Corp.	(6)	(334)	(360)	
Cadiz Inc.	(342)	(2 515)	(1 158)	
Chesapeake Utilities Corp.	(5)	(810)	(801)	
Consolidated Edison Inc.	(17)	(2 211)	(2 195)	
Essential Utilities Inc.	(41)	(2 623)	(2 652)	
IDACORP Inc.	(3)	(442)	(438)	
National Fuel Gas Co.	(4)	(353)	(343)	
Public Service Enterprise Group Inc.	(60)	(4 949)	(4 981)	
SJW Group	(32)	(3 471)	(3 520)	
Spire Inc.	(31)	(2 980)	(2 892)	
Unitil Corp.	(5)	(352)	(348)	
		(22 788)	(21 436)	(0,10)
Immobilier (31 décembre 2021 : -0,18 %)				
Agree Realty Corp.	(23)	(2 224)	(2 210)	
Alexander & Baldwin Inc.	(14)	(379)	(355)	
Anywhere Real Estate Inc.	(570)	(4 942)	(4 935)	
Apartment Investment and Management Co.	(129)	(964)	(1 245)	
Armada Hoffer Properties Inc.	(46)	(831)	(717)	
CareTrust REIT Inc.	(31)	(755)	(780)	
Clipper Realty Inc.	(140)	(1 462)	(1 214)	
Community Healthcare Trust Inc.	(121)	(5 812)	(5 869)	
Compass Inc.	(290)	(1 070)	(916)	
Douglas Elliman Inc.	(9)	(115)	(50)	
Easterly Government Properties Inc.	(35)	(726)	(677)	
Equinix Inc.	(3)	(2 727)	(2 663)	
Equity Commonwealth	(38)	(1 277)	(1 286)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Essential Properties Realty Trust Inc.	(39)	(1 239)	(1 240)	
Essex Property Trust Inc.	(3)	(855)	(861)	
eXp World Holdings Inc.	(1 022)	(40 710)	(15 343)	
Farmland Partners Inc.	(351)	(6 120)	(5 926)	
Five Point Holdings LLC	(499)	(2 313)	(1 575)	
Forestar Group Inc.	(100)	(1 578)	(2 088)	
Franklin Street Properties Corp.	(299)	(1 147)	(1 106)	
Gladstone Land Corp.	(17)	(446)	(423)	
Healthcare Realty Trust Inc.	(50)	(1 275)	(1 306)	
Healthpeak Properties Inc.	(16)	(564)	(544)	
Howard Hughes Corp.	(91)	(8 554)	(9 423)	
iStar Inc.	(234)	(2 876)	(2 419)	
JBG SMITH Properties	(45)	(1 222)	(1 157)	
Jones Lang LaSalle Inc.	(2)	(427)	(432)	
LXP Industrial Trust	(500)	(7 283)	(6 788)	
Macerich Co.	(5)	(111)	(76)	
Maui Land & Pineapple Co Inc.	(33)	(480)	(421)	
Mid-America Apartment Communities Inc.	(4)	(849)	(851)	
National Health Investors Inc.	(8)	(610)	(566)	
NETSTREIT Corp.	(489)	(12 747)	(12 145)	
Opendoor Technologies Inc.	(2 282)	(5 306)	(3 587)	
Paramount Group Inc.	(43)	(369)	(346)	
Postal Realty Trust Inc.	(205)	(4 324)	(4 036)	
Realty Income Corp.	(17)	(1 491)	(1 461)	
Redfin Corp.	(263)	(1 487)	(1 511)	
RPT Realty	(77)	(812)	(1 047)	
Safehold Inc.	(17)	(608)	(659)	
STAG Industrial Inc.	(8)	(364)	(350)	
Stratus Properties Inc.	(17)	(918)	(444)	
Sunstone Hotel Investors Inc.	(161)	(2 256)	(2 107)	
Tejon Ranch Co.	(117)	(3 005)	(2 987)	
Terreno Realty Corp.	(5)	(393)	(385)	
Urban Edge Properties	(61)	(1 219)	(1 165)	
Urstadt Biddle Properties Inc.	(15)	(356)	(385)	
Veris Residential Inc.	(67)	(1 186)	(1 446)	
Zillow Group Inc.	(28)	(1 215)	(1 222)	
		<u>(139 999)</u>	<u>(110 745)</u>	(0,53)
Total des actions américaines – position vendeur		(2 711 828)	(2 323 589)	(11,19)
Actions étrangères – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2021 : 1,91 %)				
Adaro Energy Indonesia Tbk PT	12 300	1 684	4 122	
Aker Solutions ASA	4 484	11 905	23 067	
Ampol Ltd.	63	1 509	1 637	
Borr Drilling Ltd.	716	2 221	5 254	
Boss Energy Ltd.	5 500	11 377	10 764	
BP Castrol KK	200	2 013	1 848	
BP PLC	331	15 663	15 666	
BW Energy Ltd.	497	1 778	1 719	
BW LPG Ltd.	285	1 716	2 971	
BW Offshore Ltd.	307	1 399	1 050	
Capricorn Energy PLC	153	534	653	
Carnarvon Energy Ltd.	4 147	767	572	
Channel Infrastructure NZ Ltd.	2 520	2 392	3 088	
Core Laboratories NV	33	939	906	
DHT Holdings Inc.	310	3 131	3 730	
DNO ASA	878	1 587	1 426	
Dorian LPG Ltd.	363	6 486	9 321	
Ecopetrol SA	740	9 688	10 498	
ENEOS Holdings Inc.	100	458	460	
EnQuest PLC	3 647	1 829	1 272	
Equinor ASA, CAAE	275	13 591	13 343	
Établissements Maurel et Prom SA	560	3 051	3 251	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
FLEX LNG Ltd.	211	5 695	9 310	
Frontline Ltd., NYSE	1 075	15 270	17 683	
Hafnia Ltd.	64	371	444	
Harbour Energy PLC	3 169	21 508	15 723	
Harum Energy Tbk PT	45 500	888	6 416	
Idemitsu Kosan Co., Ltd.	100	3 182	3 153	
Indo Tambangraya Megah Tbk PT	300	398	1 019	
International Seaways Inc.	179	4 064	8 979	
Ithaca Energy PLC	411	1 576	1 225	
Japan Petroleum Exploration Co., Ltd.	600	13 075	23 691	
Nabors Industries Ltd.	60	10 881	12 591	
Nabors Industries Ltd., bons de souscription, éch. le 11 juin 2026	32	–	1 427	
Neste Oyj	115	7 401	7 154	
New Hope Corp. Ltd.	84	424	491	
Nippon Coke & Engineering Co., Ltd.	1 900	1 667	1 658	
Nordic American Tankers Ltd.	2 902	9 867	12 032	
Oil Refineries Ltd.	4 824	2 516	2 280	
Panoro Energy ASA	94	289	363	
Petroleo Brasileiro SA, NYSE	602	11 046	8 687	
PGS ASA	1 562	1 409	1 506	
Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	43	862	853	
Saipem SpA	9 013	13 323	14 695	
Santos Ltd.	4 902	33 000	32 161	
Saras SpA	9 547	9 760	15 863	
Schlumberger Ltd.	387	27 653	28 033	
Scorpio Tankers Inc.	80	5 738	5 829	
Semirara Mining & Power Corp.	6 800	5 930	5 704	
SFL Corp. Ltd.	1 133	10 833	14 154	
Shell PLC, CAAE	37	2 746	2 855	
Subsea 7 SA	106	1 605	1 648	
Teekay Corp.	553	2 325	3 402	
Teekay Tankers Ltd.	25	832	1 044	
Tethys Oil AB	207	1 642	1 629	
TORM PLC	71	979	2 739	
Transocean Ltd.	3 103	13 512	19 172	
Valaris Ltd.	17	1 521	1 558	
Vallourec SA	701	10 088	12 438	
Whitehaven Coal Ltd.	1 909	12 678	16 524	
YPF SA	3 915	23 337	48 750	
		385 609	481 501	2,32
Matières premières (31 décembre 2021 : 3,59 %)				
Air Liquide SA	30	5 396	5 744	
Allkem Ltd.	1 273	15 696	13 148	
Alpek SAB de CV	2 500	4 753	4 796	
Aluminum Corp. of China Ltd.	8 000	4 052	4 611	
AMG Advanced Metallurgical Group NV	24	1 184	1 194	
Angang Steel Co., Ltd.	2 000	1 141	740	
Anglo American PLC	39	2 488	2 057	
AngloGold Ashanti Ltd.	58	1 546	1 526	
Antofagasta PLC	65	1 682	1 637	
APERAM SA	13	982	554	
Arafura Rare Earths Ltd.	1 397	388	597	
ArcelorMittal SA, NYSE	52	1 874	1 847	
Asia Pile Holdings Corp.	100	470	557	
Aurelia Metals Ltd.	925	729	106	
BASF SE	12	819	805	
BHP Group Ltd.	370	31 577	31 108	
Billerud AB	145	3 417	2 397	
BlueScope Steel Ltd.	137	2 116	2 120	
Borregaard ASA	534	10 433	11 164	
Brickworks Ltd.	33	623	672	
Cementir Holding NV	37	352	329	
Centamin PLC	1 863	3 263	3 428	
China Hongqiao Group Ltd.	2 499	4 066	3 197	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ciech SA	193	2 252	2 472	
Constellium SE	36	542	577	
Core Lithium Ltd.	3 725	4 051	3 508	
CRH PLC	1 384	67 672	74 617	
D&L Industries Inc.	3 300	519	634	
Dai Nippon Toryo Co., Ltd.	700	5 150	5 398	
Dongyue Group Ltd.	1	2	1	
Evolution Mining Ltd.	3 049	8 183	8 349	
Evonik Industries AG	55	1 411	1 426	
Ferroglobe PLC	38	398	198	
Firefinch Ltd.	2 091	2 355	384	
Fortescue Metals Group Ltd.	723	12 309	13 626	
Fufeng Group Ltd.	1 000	490	825	
Fujikura Kasei Co., Ltd.	300	2 182	1 248	
Geostr Corp.	100	427	300	
Gerdau SA	1 658	12 912	12 446	
Gun-Ei Chemical Industry Co., Ltd.	200	4 717	4 853	
Hexpol AB	22	355	318	
Hokkan Holdings Ltd.	100	1 198	1 410	
Hokko Chemical Industry Co., Ltd.	100	915	835	
Holcim AG	1 153	68 917	80 848	
IGO Ltd.	343	4 569	4 242	
Incitec Pivot Ltd.	157	541	542	
Ishihara Chemical Co., Ltd.	100	1 227	1 261	
Israel Corp. Ltd.	22	13 312	10 476	
Jastrzebska Spolka Weglowa SA	22	392	395	
Johnson Matthey PLC	354	10 761	12 272	
JSP Corp.	100	1 348	1 521	
Kansai Paint Co., Ltd.	200	3 601	3 325	
KGHM Polska Miedz SA	40	1 036	1 566	
Krakatau Steel Persero Tbk PT	142 700	4 035	4 049	
Kumimine Industries Co., Ltd.	100	1 144	842	
Kyoei Steel Ltd.	400	5 547	5 159	
Leo Lithium Ltd.	1 493	950	665	
Linde PLC	257	106 119	113 584	
Liontown Resources Ltd.	4 831	7 591	5 860	
Macmahon Holdings Ltd.	2 589	354	345	
Mineral Resources Ltd.	481	37 683	34 120	
Mount Gibson Iron Ltd.	3 475	2 092	1 549	
Neometals Ltd.	1 504	1 348	1 106	
Neturen Co., Ltd.	100	642	676	
New Century Resources Ltd.	383	771	299	
Newcrest Mining Ltd., ASX	903	15 143	17 126	
Newcrest Mining Ltd., TSE	300	5 714	5 682	
Nickel Asia Corp.	5 100	801	724	
Nickel Industries Ltd.	2 953	3 937	2 632	
Nihon Parkerizing Co., Ltd.	100	1 173	963	
Nippon Kayaku Co., Ltd.	400	4 192	4 683	
Nippon Sanso Holdings Corp.	100	2 331	1 968	
Nissan Chemical Corp.	400	28 473	23 742	
Norsk Hydro ASA	1 715	17 651	17 295	
Norske Skog ASA	489	3 871	4 523	
Northern Star Resources Ltd.	839	8 485	8 411	
Novozymes A/S	56	3 886	3 832	
Orica Ltd.	128	1 838	1 771	
Orora Ltd.	2 274	6 443	6 039	
Osaka Steel Co., Ltd.	150	1 704	1 791	
Outokumpu Oyj	1 605	9 801	10 981	
Pact Group Holdings Ltd.	1 258	1 260	1 173	
Perseus Mining Ltd.	557	988	1 080	
Pilbara Minerals Ltd.	3 016	12 554	10 392	
POSCO Holdings Inc.	252	18 540	18 599	
Ramelius Resources Ltd.	488	379	417	
Red 5 Ltd.	2 035	409	383	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Regis Resources Ltd.	371	522	702	
Riken Technos Corp.	50	240	247	
Rio Tinto PLC	419	39 320	40 422	
Salzgitter AG	8	398	330	
Sandfire Resources Ltd.	2 669	13 023	13 341	
Sasol Ltd., CAAE	135	3 498	2 874	
Seiko PMC Corp.	500	2 647	2 732	
SGL Carbon SE	1 092	10 755	10 943	
Shikoku Chemicals Corp.	100	1 174	1 338	
Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	100	19 349	16 662	
Shin-Etsu Polymer Co., Ltd.	50	617	581	
Sibanye Stillwater Ltd.	1 062	14 490	15 339	
Sinopec Shanghai Petrochemical Co., Ltd.	2 000	378	458	
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	193	23 611	20 879	
Soken Chemical & Engineering Co., Ltd.	100	1 835	1 770	
South Manganese Investment Ltd.	7 000	1 295	778	
South32 Ltd.	1 721	6 323	6 325	
Sumitomo Chemical Co., Ltd.	400	1 896	1 947	
Suzano SA	209	2 813	2 617	
Takasago International Corp.	100	3 144	2 613	
Tayca Corp.	100	1 204	1 205	
Thyssenkrupp AG	150	1 250	1 236	
Tokuyama Corp.	300	6 111	5 533	
Tokyo Rope Manufacturing Co., Ltd.	100	856	875	
Toyo Seikan Group Holdings Ltd.	700	10 578	11 660	
Trinseo PLC	18	559	554	
Tsaker New Energy Tech Co., Ltd.	1 500	340	336	
Umicore SA	349	18 133	17 321	
Vale SA	3 851	83 169	88 549	
Venator Materials PLC	322	720	236	
Vetropack Holding AG	100	5 096	5 287	
Voestalpine AG	33	1 295	1 183	
Westgold Resources Ltd.	493	341	396	
Yodogawa Steel Works Ltd.	100	2 323	2 608	
Zeon Corp.	1 000	18 784	13 720	
Zhaojin Mining Industry Co., Ltd.	500	740	753	
Zijin Mining Group Co., Ltd., HKG	4 000	5 371	7 347	
		954 838	958 365	4,61
Industries (31 décembre 2021 : 10,39 %)				
2020 Bulkcarriers Ltd.	23	364	293	
Aalberts NV	404	26 029	21 166	
ABB Ltd.	430	17 731	17 747	
AddTech AB	700	6 490	13 536	
Ajis Co., Ltd.	100	1 976	2 254	
Alconix Corp.	400	5 083	5 439	
Alfa Laval AB	449	19 721	17 581	
Alstom SA	106	2 965	3 498	
Amadeus Fire AG	1	277	167	
ANDRITZ AG	115	6 379	8 905	
Aspo Oyj	300	3 954	3 557	
Assa Abloy AB	274	8 583	7 971	
Atlas Arteria Ltd.	1 541	10 783	9 360	
Atlas Copco AB	1 171	20 264	18 745	
Atlas Corp.	595	12 132	12 367	
Aurizon Holdings Ltd.	519	1 745	1 779	
Avon Protection PLC	11	411	193	
Babcock International Group PLC	4 624	24 971	21 268	
Balfour Beatty PLC	572	2 659	3 147	
Bando Chemical Industries Ltd.	700	8 067	6 872	
Befesa SA	102	9 032	6 646	
Beijer Alma AB	78	1 951	1 657	
Bodycote PLC	142	2 193	1 316	
Bossard Holding AG	7	3 044	2 048	
Brambles Ltd.	378	3 777	4 192	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Brenntag SE	39	3 653	3 368	
Burckhardt Compression Holding AG	5	3 725	4 035	
Burkhalter Holding AG	98	11 461	10 994	
Cargotec Oyj	110	5 881	6 573	
Cebu Air Inc.	400	423	372	
Ceres Power Holdings PLC	297	3 550	1 698	
Cewe Stiftung & Co KGAA	4	695	513	
China Merchants Port Holdings Co., Ltd.	2 000	4 405	3 972	
CITIC Ltd.	2 000	2 729	2 861	
CITIC Resources Holdings Ltd.	15 984	1 237	1 152	
Clarivate PLC	87	1 085	983	
CNH Industrial NV	577	9 836	12 487	
Corp America Airports SA	1 454	6 482	17 199	
CTT-Correios de Portugal SA	112	360	499	
D/S Norden A/S	146	7 119	11 867	
Daetwyler Holding AG	2	1 060	539	
Dai Nippon Printing Co., Ltd.	100	2 764	2 721	
Daihatsu Diesel Manufacturing Co., Ltd.	100	576	524	
Dassault Aviation SA	31	6 014	7 092	
Derichebourg SA	1 214	14 865	9 691	
Deutsche Lufthansa AG	1 501	14 071	16 855	
Deutsche Post AG	1 073	57 769	54 587	
Deutz AG	384	3 881	2 247	
Diploma PLC	56	2 992	2 534	
DiscoverIE Group PLC	17	351	203	
Downer EDI Ltd.	125	553	426	
Duerr AG	540	24 908	24 614	
Eaton Corp. PLC	107	23 105	22 755	
Elanders AB	83	2 028	1 619	
Elbit Systems Ltd.	32	8 412	7 034	
Embraer SA	1 871	24 264	27 709	
Emeco Holdings Ltd.	1 445	993	1 022	
En Japan Inc.	100	3 871	2 489	
Enka Insaat ve Sanayi AS	-	-	-	
Fagerhult AB	50	380	263	
Ferguson PLC, LSE	4	742	681	
Ferguson PLC, NYSE	26	4 472	4 473	
Firstgroup PLC	757	1 229	1 246	
FLSmidth & Co A/S	197	6 901	9 642	
Flughafen Zurich AG	98	20 948	20 538	
FNM SpA	1 955	1 367	1 200	
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	230	16 877	12 655	
Frencken Group Ltd.	2 000	1 284	1 909	
Fugro NV	498	6 449	8 066	
FULLCAST Holdings Co., Ltd.	100	1 996	2 900	
GEA Group AG	43	2 337	2 375	
Gecoss Corp.	200	1 524	1 719	
Georg Fischer AG	12	798	995	
Getlink SE	435	9 276	9 420	
GMexico Transportes SAB de CV	200	483	527	
Golden Ocean Group Ltd., NASD	211	2 620	2 484	
Grab Holdings Ltd.	371	1 620	1 619	
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV, CAAE	2	427	390	
GT Capital Holdings Inc.	50	738	529	
H+H International A/S	7	355	140	
Heidelberger Druckmaschinen AG	2 695	7 085	5 752	
Hexagon Purus ASA	100	364	285	
Hexatronic Group AB	635	6 148	11 689	
Hitachi Ltd.	300	21 465	20 613	
HOCHTIEF AG	23	1 814	1 752	
Hokuriku Electrical Construction Co., Ltd.	100	634	679	
IMI PLC	29	722	609	
Inaba Denki Sangyo Co., Ltd.	200	5 818	5 568	
Inabata & Co., Ltd.	100	2 247	2 451	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
International Container Terminal Services Inc.	450	1 690	2 188	
Intrum AB	56	1 666	919	
Investment AB Latour	8	360	205	
ISS A/S	657	15 521	18 819	
ITOCHU Corp.	300	11 218	12 773	
Iwaki Co., Ltd.	100	1 042	1 263	
Japan Airlines Co., Ltd.	400	10 425	11 070	
Japan Transcity Corp.	100	748	525	
JGC Holdings Corp.	1 400	23 687	24 124	
Johnson Controls International PLC	210	18 347	18 211	
Kamei Corp.	100	1 306	1 254	
Kamigumi Co., Ltd.	100	2 400	2 759	
Keppel Corp. Ltd.	400	2 750	2 934	
KION Group AG	76	2 471	2 942	
Kloeckner & Co SE	612	7 864	8 173	
Knorr-Bremse AG	20	1 577	1 476	
Kondotec Inc.	100	989	1 019	
Konecranes Oyj	26	1 094	1 081	
Kongsberg Gruppen ASA	306	15 343	17 492	
Koninklijke BAM Groep NV	2 993	12 189	9 392	
Krones AG	6	725	911	
Kubota Corp.	300	6 103	5 598	
Legrand SA	49	5 165	5 302	
Leonardo SpA	1 269	15 663	14 791	
Lifco AB	1 524	25 584	34 513	
Lindab International AB	127	4 745	2 104	
Lixil Corp.	100	2 037	2 055	
Lonking Holdings Ltd.	12 000	5 458	2 854	
LT Group Inc.	3 000	892	671	
Maezawa Kyuso Industries Co., Ltd.	300	3 213	2 819	
Marlowe PLC	26	357	199	
Matsuda Sangyo Co., Ltd.	100	2 633	2 360	
Meier Tobler Group AG	111	3 191	6 665	
Metso Outotec Oyj	2 079	23 796	28 898	
MINEBEA MITSUMI Inc.	100	1 999	2 024	
Mirai Industry Co., Ltd.	100	1 469	1 486	
Mitie Group PLC	1 698	1 979	2 065	
Mitsubishi Corp.	300	13 355	13 195	
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	100	5 499	5 375	
Mitsubishi Kakoki Kaisha Ltd.	100	1 962	2 108	
Mitsui E&S Holdings Co., Ltd.	400	2 174	1 577	
Mitsui OSK Lines Ltd.	1 600	42 983	54 057	
Mitsui-Soko Holdings Co., Ltd.	200	5 533	7 383	
Monadelphous Group Ltd.	126	1 588	1 547	
Munters Group AB	100	761	1 338	
Nexans SA	17	1 985	2 076	
NGK Insulators Ltd.	100	1 706	1 723	
Nibe Industrier AB	3 720	56 628	46 972	
Nichiden Corp.	100	1 659	1 767	
Nidec Corp.	300	24 809	21 069	
Nihon M&A Center Holdings Inc.	200	4 145	3 346	
Nippon Concept Corp.	100	1 387	1 499	
Nippon Hume Corp.	400	2 315	2 649	
Nippon Rietec Co., Ltd.	100	916	867	
Nissin Corp.	100	1 840	2 159	
Nissin Electric Co., Ltd.	100	1 397	1 293	
Nisso Corp.	200	1 070	1 185	
Nitta Corp.	49	1 779	1 408	
Nitto Kogyo Corp.	600	15 077	14 516	
Nitto Kohki Co., Ltd.	100	1 485	1 534	
Nitto Seiko Co., Ltd.	100	612	506	
Nordex SE	1 237	22 203	23 612	
Noritake Co., Ltd.	100	4 671	4 128	
Norma Group SE	68	1 725	1 672	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
NRW Holdings Ltd.	813	1 280	2 099	
Ohba Co., Ltd.	200	1 257	1 343	
Okabe Co., Ltd.	100	612	714	
Onoken Co., Ltd.	400	5 321	5 977	
Pacific Basin Shipping Ltd.	1 996	1 252	915	
Pasco Corp.	100	1 296	1 396	
Pegasus Sewing Machine Manufacturing Co., Ltd.	300	1 586	2 388	
Pentair PLC	47	2 897	2 864	
PeopleN Ltd.	1 039	3 061	3 036	
Per Aarsleff Holding A/S, cat. B	50	2 108	2 547	
Pfeiffer Vacuum Technology AG	1	246	248	
Phoenix Mecano AG	1	655	482	
PostNL NV	867	3 952	2 132	
Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	65	751	721	
Prysmian SpA	304	11 126	15 237	
Punch Industry Co., Ltd.	100	578	396	
Qantas Airways Ltd.	2 962	14 377	16 357	
Qinhuangdao Port Co., Ltd.	6 500	1 150	1 230	
Ras Al Khaimah Ceramics	20 353	11 581	21 250	
Rational AG	1	970	803	
Recruit Holdings Co., Ltd.	200	8 455	8 579	
RELX PLC, CAAE	517	19 070	19 418	
RELX PLC, AMS	13	437	486	
Renewi PLC	92	1 251	897	
Rheinmetall AG	4	931	1 076	
Ryobi Ltd.	100	1 559	1 178	
Safe Bulkers Inc.	1 270	2 152	5 008	
Salcef Group SpA	70	1 533	1 763	
Sandvik AB	175	4 337	4 287	
Sanyo Trading Co., Ltd.	200	2 357	2 311	
Sato Shoji Corp.	100	1 089	1 249	
Schneider Electric SE	57	9 957	10 775	
Scope Metals Group Ltd.	30	1 594	1 510	
Secom Co., Ltd.	100	7 703	7 746	
Securitas AB	986	10 722	11 150	
Sembcorp Marine Ltd.	22 100	2 993	3 081	
Senior PLC	264	710	539	
Sensata Technologies Holding PLC	77	4 460	4 213	
Seven Group Holdings Ltd.	238	4 680	4 586	
Siemens AG	223	31 686	41 806	
Siemens Energy AG	676	16 321	17 181	
SIG PLC	441	358	213	
Singapore Airlines Ltd.	200	1 018	1 117	
Sinotrans Ltd., HKG	14 000	4 020	6 173	
Sinotruk Hong Kong Ltd.	3 499	12 724	6 609	
SKF AB	753	15 736	15 584	
SmartGroup Corp. Ltd.	346	3 539	1 621	
Soda Nikka Co., Ltd.	365	2 066	2 680	
Solar A/S	115	10 484	13 865	
Space Co., Ltd.	200	1 717	1 801	
Speedy Hire PLC	317	380	205	
SThree PLC	45	374	296	
Stolt-Nielsen Ltd.	53	724	1 965	
Sugimoto & Co., Ltd.	100	1 723	2 019	
Thoresen Thai Agencies PCL	5	1	2	
Tianjin Port Development Holdings Ltd.	3 987	413	395	
TOKAI Holdings Corp.	100	832	882	
Tokyo Sangyo Co., Ltd.	400	2 847	3 089	
Toli Corp.	600	1 726	1 405	
TOMRA Systems ASA	376	11 090	8 564	
TOPPAN Inc.	100	2 098	2 007	
Tourism Holdings Ltd.	610	1 263	1 809	
Toyo Engineering Corp.	300	2 871	1 731	
Toyota Tsusho Corp.	100	5 044	5 016	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Transurban Group	843	10 794	10 054	
Travis Perkins PLC	39	870	565	
Tsukishima Kikai Co., Ltd.	100	812	986	
Turk Hava Yollari AO	158	452	1 611	
Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS	390	620	1 212	
Valmet Oyj	21	725	764	
Vinci SA	19	2 391	2 563	
Volex PLC	63	416	257	
Volution Group PLC	50	356	297	
Wacker Neuson SE	70	1 579	1 654	
Wallenius Wilhelmsen ASA	2 017	15 405	26 924	
Wartsila OYJ Abp	4 125	66 027	46 934	
Webuild SpA, bons de souscription, éch. le 2 août 2030	19	–	38	
Weir Group PLC	101	2 702	2 747	
Wienerberger AG	571	19 728	18 628	
Will Group Inc.	100	1 505	1 230	
YAMABIKO Corp.	300	4 791	3 386	
Yasuda Logistics Corp.	400	3 595	3 800	
Yurtec Corp.	100	859	755	
Zehnder Group AG	53	4 217	4 331	
ZTO Express Cayman Inc.	116	3 665	4 223	
Zumtobel Group AG	128	1 170	1 261	
		1 469 559	1 506 844	7,25
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 9,12 %)				
888 Holdings PLC	80	368	113	
ABC-Mart Inc.	200	13 746	15 342	
Abu Dhabi National Oil Co for Distribution PJSC	7 169	10 152	11 664	
Adidas AG	45	7 815	8 294	
Alibaba Group Holding Ltd.	3 596	59 836	53 844	
ANTA Sports Products Ltd.	400	6 477	7 104	
Arcos Dorados Holdings Inc.	1 709	12 196	19 359	
Aristocrat Leisure Ltd.	906	27 853	25 408	
Asahi Co., Ltd.	300	3 614	4 227	
BAIC Motor Corp. Ltd.	1 500	1 140	539	
Bandai Namco Holdings Inc.	100	8 832	8 538	
BasicNet SpA	100	670	768	
Bellway PLC	105	5 729	3 264	
Beneteau SA	52	1 083	1 063	
Bertrandt AG	6	453	347	
Betsson AB	860	6 846	9 480	
Bijou Brigitte AG	100	4 622	6 160	
Bloomberry Resorts Corp.	73 200	11 988	13 615	
Burberry Group PLC	285	8 117	9 430	
BYD Co., Ltd., HKG	679	21 073	22 703	
Calida Holding AG	100	3 945	6 920	
Card Factory PLC	4 775	4 986	6 086	
Carnival Corp.	1 366	15 116	14 918	
CECONOMY AG	806	3 757	2 164	
Central Automotive Products Ltd.	100	3 250	2 523	
Chaowei Power Holdings Ltd.	5 004	2 018	1 468	
China Dongxiang Group Co., Ltd.	12 981	846	699	
China Travel International Investment Hong Kong Ltd.	2 000	484	615	
China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd.	21 999	23 254	22 151	
China ZhengTong Auto Services Holdings Ltd.	8 500	828	1 048	
CIR SpA-Compagnie Industriali	735	459	462	
Cleanup Corp.	100	535	663	
Collins Foods Ltd.	539	4 869	3 561	
Compass Group PLC	1 896	54 440	59 256	
Continental AG	566	47 566	45 819	
Crystal International Group Ltd.	1 000	279	422	
Currys PLC	374	842	327	
Delek Automotive Systems Ltd.	100	1 972	1 582	
Delivery Hero SE	78	4 594	5 051	
D'ieteren Group	231	22 254	59 861	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Dor Alon Energy in Israel 1988 Ltd.	85	4 032	3 031	
Dynam Japan Holdings Co., Ltd.	4 000	5 369	4 111	
Electrolux AB	211	3 804	3 863	
Elica SpA	100	420	429	
Elior Group SA	152	713	725	
Erawan Group PCL	4 400	681	771	
Evolution AB	213	24 075	28 125	
Farfetch Ltd.	360	2 168	2 307	
Faurecia SE, PAR	126	3 098	2 575	
Fiskars OYJ Abp	150	3 252	3 336	
Fiverr International Ltd.	89	4 456	3 514	
Fleetwood Ltd.	306	507	399	
Fox Wixel Ltd.	4	868	495	
Gajah Tunggal Tbk PT	1 700	69	83	
Galaxy Entertainment Group Ltd.	1 000	8 431	8 958	
Games Workshop Group PLC	7	835	977	
Geely Automobile Holdings Ltd.	21 000	44 804	41 560	
Genting Singapore Ltd.	1 700	1 509	1 640	
Gestamp Automocion SA	90	556	470	
Giordano International Ltd.	4 000	958	1 201	
Global Digital Niaga Tbk PT	156 546	6 197	6 404	
GLOBERIDE Inc.	100	3 371	2 625	
Greggs PLC	9	339	344	
Guangzhou Automobile Group Co., Ltd.	2 000	2 090	1 826	
H & M Hennes & Mauritz AB	3 693	57 819	53 902	
H World Group Ltd.	50	2 509	2 874	
Haichang Ocean Park Holdings Ltd.	6 000	1 634	1 667	
Haier Smart Home Co., Ltd., HKG	400	1 835	1 847	
Hermès International	1	2 091	2 090	
Hisense Home Appliances Group Co., Ltd.	4 000	4 935	5 979	
Honda Motor Co., Ltd.	455	15 217	14 093	
Hornbach Baumarkt AG	44	2 321	3 423	
Hornbach Holding AG & Co KGaA	2	362	223	
Hour Glass Ltd.	1 300	2 662	2 679	
I K K Holdings Inc.	400	2 334	2 826	
Ichikoh Industries Ltd.	500	1 812	1 864	
IDP Education Ltd.	60	1 577	1 498	
IJT Co., Ltd.	200	1 154	1 029	
Inchcape PLC	663	7 679	8 861	
Ingdan Inc.	3 000	826	927	
InterContinental Hotels Group PLC	478	39 028	36 960	
InvoCare Ltd.	350	3 537	3 547	
Izumi Co., Ltd.	100	3 380	3 068	
JANOME Corp.	200	1 339	1 183	
JB Hi-Fi Ltd.	107	4 319	4 124	
JD Health International Inc.	100	1 279	1 239	
JD.com Inc.	209	6 797	7 989	
JD.com Inc., CAAE	87	7 314	6 617	
JNBY Design Ltd.	500	610	810	
Joban Kosan Co., Ltd.	100	1 227	1 246	
Jollibee Foods Corp.	130	775	727	
JVCKenwood Corp.	400	842	1 516	
Kawai Musical Instruments Manufacturing Co., Ltd.	100	2 632	2 671	
Kindred Group PLC	228	2 972	3 220	
Komatsu Matere Co., Ltd.	100	929	795	
Laox Holdings Co., Ltd.	500	810	1 135	
MC Group PCL	1 000	381	411	
McDonald's Holdings Co Japan Ltd.	200	9 431	10 259	
Meituan	1 100	32 543	33 361	
Melia Hotels International SA	46	377	305	
Mercari Inc.	100	2 758	2 772	
Mikuni Corp.	400	1 389	1 319	
MIPS AB	8	787	447	
Moncler SpA	54	3 586	3 865	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Myer Holdings Ltd.	1 503	955	939	
Nafco Co., Ltd.	300	4 590	4 794	
New Oriental Education & Technology Group Inc.	40	4 982	1 887	
New Wave Group AB	34	362	913	
Nexteer Automotive Group Ltd.	3 000	2 341	2 661	
Nick Scali Ltd.	7	58	68	
Nissan Motor Co., Ltd.	1 400	6 243	6 011	
Nissan Tokyo Sales Holdings Co., Ltd.	300	1 096	903	
Niu Technologies	856	22 215	6 066	
Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	1 286	27 632	21 328	
Oriental Land Co., Ltd.	200	37 437	39 351	
Oriental Watch Holdings	2 000	662	1 417	
Padini Holdings Bhd	1 100	1 086	1 133	
Pan Pacific International Holdings Corp.	100	2 342	2 519	
Panasonic Holdings Corp.	700	8 574	7 983	
Pandora A/S	534	60 697	50 685	
Pinduoduo Inc.	139	14 988	15 359	
Playtech PLC	1 661	17 936	13 780	
Porsche Automobil Holding SE, actions priv.	473	37 781	35 048	
Press Kogyo Co., Ltd.	300	1 531	1 300	
Prosus NV	624	44 437	58 157	
Puma SE	33	2 361	2 706	
Rakuten Group Inc.	2 351	16 440	14 389	
Royal Caribbean Cruises Ltd.	469	33 160	31 412	
Ryohin Keikaku Co., Ltd.	100	1 261	1 608	
Sabaf SpA	9	355	217	
Salvatore Ferragamo SpA	58	1 536	1 383	
Sankyo Seiko Co., Ltd.	300	1 581	1 466	
Sanlorenzo SpA	8	397	427	
Sanyo Electric Railway Co., Ltd.	100	2 036	2 184	
Scandic Hotels Group AB	1 555	8 944	6 515	
Sekisui Chemical Co., Ltd.	200	3 982	3 789	
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	900	10 663	13 718	
Signet Jewelers Ltd.	37	3 558	3 409	
SISB PCL	4 800	2 922	3 605	
SkiStar AB	23	517	332	
Skyworth Group Ltd.	10 000	3 629	5 816	
SMCP SA	3	32	28	
Sogefi SpA	494	584	664	
SSP Group PLC	419	2 092	1 564	
Stella International Holdings Ltd.	16 000	34 564	20 416	
Subaru Corp.	200	4 479	4 164	
Super Retail Group Ltd.	599	5 906	5 895	
Suzuki Motor Corp.	100	5 587	4 386	
Tachikawa Corp.	100	1 034	1 160	
TAL Education Group	117	475	1 118	
Texwinca Holdings Ltd.	1 994	463	433	
Thule Group AB	76	3 159	2 152	
Topsports International Holdings Ltd.	1 000	1 024	1 075	
Trip.com Group Ltd.	149	5 322	6 945	
UMW Holdings Bhd	500	481	534	
Unieuro SpA	305	5 610	5 421	
USS Co., Ltd.	100	2 225	2 151	
Valeo	2 333	83 039	56 341	
Vipshop Holdings Ltd.	115	1 312	2 125	
WATAMI Co., Ltd.	200	1 743	2 017	
Watches of Switzerland Group PLC	647	14 437	8 652	
Webjet Ltd.	2 616	13 810	14 855	
Weiqiao Textile Co.	1 504	369	418	
Wesfarmers Ltd.	312	13 973	13 162	
WH Smith PLC	59	1 449	1 428	
Xingda International Holdings Ltd.	6 000	1 639	1 635	
Yachiyo Industry Co., Ltd.	200	1 387	2 873	
Yamada Holdings Co., Ltd.	200	929	959	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Zalando SE	561	17 342	26 861	
		1 383 068	1 366 705	6,58
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 2,35 %)				
A2 Milk Co., Ltd.	1 225	5 215	7 747	
Agthia Group PJSC	6 189	12 820	9 088	
Ambev SA	1 341	5 087	4 942	
Anheuser-Busch InBev SA, CAAE	412	29 564	33 517	
Artnature Inc.	100	777	775	
Aryzta AG	9 435	14 117	15 213	
Asahi Group Holdings Ltd.	100	4 114	4 230	
Australian Agricultural Co., Ltd.	800	1 317	1 286	
Barry Callebaut AG	6	16 547	16 071	
Bell Food Group AG	2	755	697	
BRF SA, CAAE	2 294	4 630	4 911	
British American Tobacco PLC	583	30 957	31 582	
Bunge Ltd.	91	12 556	12 302	
Carlsberg AS	26	4 389	4 668	
China Mengniu Dairy Co., Ltd.	1 000	4 395	6 146	
Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG	1	14 095	13 810	
Cia Cervecerias Unidas SA	20	357	356	
Coca-Cola Femsa SAB de CV, NYSE	15	1 376	1 380	
Coca-Cola Icecek AS	459	3 517	6 791	
Danone SA	212	14 769	15 093	
Davide Campari-Milano NV	629	8 352	8 627	
Diageo PLC, CAAE	89	21 795	21 488	
Dino Polska SA	30	2 710	3 478	
Emperador Inc.	2 200	594	1 102	
Essity AB	174	5 488	6 184	
Fancl Corp.	600	14 634	16 562	
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	54	5 757	5 716	
Glanbia PLC	256	5 026	4 413	
Grieg Seafood ASA	21	392	227	
Honworld Group Ltd.	1 000	475	-	
Jeronimo Martins SGPS SA	792	22 546	23 112	
Kao Corp.	100	5 414	5 396	
Karmarts PCL	2 200	363	684	
Kesko Oyj	230	6 984	6 858	
Khon Kaen Sugar Industry PCL	2 500	344	362	
Koninklijke Ahold Delhaize NV	1 011	36 097	39 240	
Kose Corp.	100	14 184	14 808	
Lucas Bols NV	100	1 395	1 489	
Mitsubishi Shokuhin Co., Ltd.	100	3 113	3 204	
Nakamura Co., Ltd.	100	2 965	3 163	
Nestlé SA	724	114 053	113 600	
Nippon Beet Sugar Manufacturing Co., Ltd.	100	1 594	1 710	
Nisshin Seifun Group Inc.	100	1 576	1 697	
Nongfu Spring Co., Ltd.	200	1 513	1 531	
NVC International Holdings Ltd.	2 000	376	33	
Orkla ASA	214	1 934	2 088	
PPB Group Bhd	100	532	536	
QL Resources Bhd	300	513	508	
Rami Levy Chain Stores Hashikma Marketing 2006 Ltd.	4	399	378	
Riken Vitamin Co., Ltd.	100	1 617	1 969	
San Miguel Food and Beverage Inc.	410	744	386	
Sappe PCL	1 500	2 252	2 597	
Scandinavian Tobacco Group A/S	17	470	404	
Torigoe Co., Ltd.	500	3 106	3 050	
Toyo Suisan Kaisha Ltd.	100	5 203	5 237	
Unilever PLC	5	344	341	
Uni-President China Holdings Ltd.	1 000	1 130	1 356	
Weilong Delicious Global Holdings Ltd.	88	164	161	
Yokorei Co., Ltd.	300	2 446	3 299	
		479 948	497 599	2,39

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Soins de santé (31 décembre 2021 : 5,50 %)				
3SBio Inc.	500	694	720	
Alcon Inc., NYSE	138	12 950	12 818	
Alkermes PLC	676	21 865	23 934	
Ambea AB	649	3 691	3 715	
Ambu A/S	246	3 749	4 257	
Argenx SE, CAAE	42	20 236	21 559	
Arjo AB	512	2 945	2 593	
Asahi Intecc Co., Ltd.	300	7 492	6 667	
Astellas Pharma Inc.	1 102	21 702	22 707	
AstraZeneca PLC, CAAE	854	76 827	78 454	
Attendo AB	200	560	630	
Austar Lifesciences Ltd.	6	3	2	
BeiGene Ltd.	30	7 554	8 940	
Biotage AB	51	1 189	1 230	
Bumrungrad Hospital PCL	500	3 179	4 147	
Carl Zeiss Meditec AG	242	41 803	41 260	
Chemometec A/S	55	8 116	7 385	
China Evergrande New Energy Vehicle Group Ltd.	3 000	1 558	1 667	
China Shineway Pharmaceutical Group Ltd.	10 000	12 698	13 176	
Chularat Hospital PCL, CAE sans droit de vote	6 900	962	993	
Cochlear Ltd.	19	3 660	3 564	
Consun Pharmaceutical Group Ltd.	3 000	1 740	2 109	
CSL Ltd.	123	32 538	32 523	
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	4 000	6 059	5 694	
CVS Group PLC	70	2 625	2 209	
Daiichi Sankyo Co., Ltd.	500	14 344	21 822	
EBOS Group Ltd.	556	18 708	20 917	
Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	156	11 161	10 467	
Eisai Co., Ltd.	725	75 458	64 802	
El.En. SpA	277	4 636	5 708	
Elekta AB	1 268	11 142	10 355	
Evotec SE	572	20 654	12 623	
Fagron	21	446	403	
Galenica AG	77	7 907	8 519	
Genmab A/S	18	11 266	10 294	
Getinge AB	81	2 022	2 278	
GSK PLC	25	1 229	1 190	
H Lundbeck A/S, cat. B	5 416	32 791	27 436	
Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc.	200	8 882	8 061	
Horizon Therapeutics PLC	63	7 844	9 714	
Hoya Corp.	200	40 811	26 094	
Humana AB	65	541	325	
HUTCHMED China Ltd., NASD	64	1 048	1 282	
Indivior PLC	619	8 377	18 685	
Inmode Ltd.	60	2 906	2 902	
Innovent Biologics Inc.	500	2 416	2 908	
Irom Group Co., Ltd.	100	2 586	2 653	
Jazz Pharmaceuticals PLC	210	40 837	45 330	
Jeol Ltd.	300	25 406	11 060	
Koninklijke Philips NV	672	15 503	13 609	
Koninklijke Philips NV, NYSE	1 395	44 459	28 334	
Kyowa Kirin Co., Ltd.	100	3 112	3 101	
Mediclinic International PLC	74	366	601	
Medtronic PLC	364	44 811	38 332	
Metall Zug AG	2	4 026	5 638	
Mettler-Toledo International Inc.	6	11 151	11 751	
Microport Scientific Corp.	200	724	714	
Modern Dental Group Ltd.	4 000	1 008	1 674	
Nano-X Imaging Ltd.	42	405	420	
Neuren Pharmaceuticals Ltd.	806	3 981	5 888	
Novartis AG	207	21 587	25 340	
Novartis AG, CAAE	403	43 119	49 538	
Novo Nordisk A/S	442	59 657	80 622	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Novo Nordisk A/S, CAAE	410	47 667	75 186	
Novocure Ltd.	27	3 689	2 683	
Oceania Healthcare Ltd.	585	388	381	
Otsuka Holdings Co., Ltd.	200	9 034	8 842	
Pharming Group NV	2 066	2 172	3 239	
Pro Medicus Ltd.	57	2 704	2 894	
PW Medtech Group Ltd.	12 000	2 850	1 312	
Ramsay Health Care Ltd.	52	3 098	3 091	
RaySearch Laboratories AB	77	764	681	
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	45	2 499	2 522	
Regis Healthcare Ltd.	337	589	584	
Richter Gedeon Nyrt	40	1 183	1 199	
Roche Holding AG	153	67 388	65 092	
Royalty Pharma PLC	93	4 884	4 980	
Sanofi	24	1 511	1 575	
Sartorius AG	7	3 660	3 739	
Seikagaku Corp.	250	2 042	2 308	
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co., Ltd.	500	2 425	2 170	
Shanghai Kindly Medical Instruments Co., Ltd.	200	992	998	
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd., HKG	200	490	451	
Siemens Healthineers AG	242	17 196	16 353	
Sino Biopharmaceutical Ltd.	3 000	2 388	2 380	
Smith & Nephew PLC	140	5 289	5 101	
Solasto Corp.	200	1 234	1 487	
Sonic Healthcare Ltd.	130	3 641	3 580	
Sonova Holding AG	39	12 534	12 525	
Spire Healthcare Group PLC	59	230	219	
St-Care Holding Corp.	100	826	869	
STERIS PLC	34	8 604	8 508	
Sumitomo Pharma Co., Ltd.	500	5 193	5 129	
Swedish Orphan Biovitrum AB	48	1 308	1 346	
Tecan Group AG	39	25 007	23 554	
Terumo Corp.	200	8 071	7 694	
UCB SA	91	9 794	9 680	
Uniphar PLC	74	345	332	
Valneva SE	942	15 696	8 478	
WIN-Partners Co., Ltd.	200	1 890	2 189	
WuXi AppTec Co., Ltd., HKG	700	8 489	10 019	
Wuxi Biologics Cayman Inc.	1 000	6 414	10 390	
Zai Lab Ltd.	365	47 057	15 183	
		1 244 957	1 223 286	5,89
Services financiers (31 décembre 2021 : 4,05 %)				
ABG Sundal Collier Holding ASA	2 464	2 207	1 908	
ABN AMRO Bank NV	180	2 998	3 364	
Admiral Group PLC	9	389	313	
AIA Group Ltd.	3 200	45 776	48 220	
AIB Group PLC	3 789	12 590	19 813	
Alior Bank SA	194	2 889	2 054	
Allianz SE	117	32 644	33 991	
Aon PLC	58	21 174	23 587	
Ashmore Group PLC	128	495	499	
Assicurazioni Generali SpA	1 902	48 299	45 699	
ASX Ltd.	53	3 305	3 313	
AUB Group Ltd.	93	1 974	1 925	
Avanza Bank Holding AB	1 060	30 126	30 822	
AXA SA	1 622	63 348	61 114	
B2Holding ASA	3 178	3 535	3 436	
Banca Generali SpA	244	10 858	11 312	
Banca IFIS SpA	250	4 807	4 812	
Banca Mediolanum SpA	370	4 248	4 172	
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, CAAE	1 671	13 213	13 607	
Banco de Sabadell SA	276	368	352	
Banco del Bajío SA	1 700	7 280	7 275	
Banco Santander SA, CAAE	275	1 015	1 099	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Bank Leumi Le-Israel BM	39	361	439	
Bank Millennium SA	715	1 240	1 012	
Bank of Georgia Group PLC	30	704	1 274	
Bank Polska Kasa Opieki SA	496	16 034	13 254	
Banque Cantonale Vaudoise	94	11 224	12 218	
BAWAG Group AG	222	14 293	15 987	
Beazley PLC	2 069	16 907	22 914	
Berner Kantonalbank AG	40	12 007	13 034	
BFF Bank SpA	999	8 960	10 705	
BOC Hong Kong Holdings Ltd.	500	2 495	2 309	
BPER Banca	9 849	28 021	27 324	
Chiba Kogyo Bank Ltd.	200	737	934	
China Life Insurance Co., Ltd. -HKG	1 000	1 771	2 326	
China Merchants Bank Co., Ltd.	3 000	22 903	22 733	
China Merchants Securities Co., Ltd.	400	583	531	
China Pacific Insurance Group Co., Ltd., HKG	2 200	7 071	6 638	
China Taiping Insurance Holdings Co., Ltd.	400	640	675	
Chubb Ltd.	167	36 061	49 917	
CMC Markets PLC	121	555	442	
Coface SA	33	417	579	
Commerzbank AG	299	3 140	3 821	
Commonwealth Bank of Australia	5	457	471	
Credicorp Ltd.	24	4 573	4 412	
Credit Suisse Group AG	2 927	13 221	12 057	
Credito Emiliano SpA	1 921	15 929	18 418	
CSC Financial Co., Ltd.	1 000	1 213	1 186	
Dah Sing Banking Group Ltd.	8 000	7 288	7 777	
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	2 400	7 687	7 533	
Daiwa Securities Group Inc.	400	2 328	2 395	
DBS Group Holdings Ltd.	500	17 044	17 134	
Deutsche Bank AG	781	10 627	11 958	
Deutsche Boerse AG	60	14 117	14 004	
DNB Bank ASA	721	19 067	19 284	
Enstar Group Ltd.	2	538	626	
Entrust Inc.	100	660	840	
Erste Group Bank AG	31	1 116	1 340	
Everest Re Group Ltd.	17	6 339	7 631	
Far East Horizon Ltd.	2 000	1 862	2 118	
FIBI Holdings Ltd.	82	4 526	4 616	
FinecoBank Banca Fineco SpA	363	6 002	8 147	
First Bank of Toyama Ltd.	100	381	601	
First International Bank Of Israel Ltd.	222	11 271	11 850	
FlatexDEGIRO AG	604	19 613	5 525	
Fukui Bank Ltd.	200	2 597	3 091	
Futu Holdings Ltd.	53	3 665	2 919	
Gjensidige Forsikring ASA	57	1 536	1 507	
Grupo Financiero Banorte SAB de CV	100	1 063	973	
Grupo Financiero Inbursa SAB de CV	400	956	913	
Hannover Rueck SE	17	4 249	4 560	
Hargreaves Lansdown PLC	83	1 841	1 158	
Helvetia Holding AG	54	7 801	8 525	
Hiscox Ltd.	88	1 345	1 563	
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	200	8 196	11 708	
Hong Leong Finance Ltd.	1 200	2 724	2 897	
Huatai Securities Co., Ltd.	400	633	620	
HUB24 Ltd.	33	822	806	
Impax Asset Management Group PLC	6	123	71	
ING Groep NV	1 388	22 566	22 858	
Insurance Australia Group Ltd.	703	2 933	3 068	
International Personal Finance PLC	745	1 984	888	
Intesa Sanpaolo SpA	28 794	71 382	86 525	
Invesco Ltd.	97	2 506	2 364	
Investec PLC	3 220	21 126	26 839	
Israel Discount Bank Ltd.	339	2 532	2 406	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
ISX Financial EU Ltd.	185	—	—	
Itau Unibanco Holding SA	1 300	8 399	8 296	
J Trust Co., Ltd.	100	343	532	
Japan Exchange Group Inc.	100	1 939	1 949	
KB Financial Group Inc., CAAE	59	2 662	3 091	
KBC Ancora	10	668	609	
KBC Group NV	475	33 676	41 269	
Krung Thai Bank PCL	1 600	898	1 108	
Kyushu Leasing Service Co., Ltd.	300	1 653	2 243	
Lancashire Holdings Ltd.	242	1 910	2 564	
Liontrust Asset Management PLC	41	1 491	748	
MA Financial Group Ltd.	66	362	275	
Macquarie Group Ltd.	91	13 748	13 961	
mBank SA	37	4 851	3 383	
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	173	2 258	2 248	
Mitsubishi HC Capital Inc.	200	1 307	1 333	
Mizrahi Tefahot Bank Ltd.	44	2 184	1 924	
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	40	16 469	17 584	
MyState Ltd.	352	1 306	1 268	
National Australia Bank Ltd.	161	4 522	4 447	
New China Life Insurance Co., Ltd., HKG	200	696	663	
Ninety One PLC	442	1 629	1 339	
Nordea Bank Abp	921	13 022	13 376	
North Pacific Bank Ltd.	700	1 494	1 833	
Oita Bank Ltd.	100	1 773	2 097	
Omni Bridgeway Ltd.	93	364	309	
OSB Group PLC	40	379	313	
OTP Bank Nyrt	456	26 779	16 648	
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.	1 000	11 893	12 305	
Pacific Current Group Ltd.	100	723	673	
People's Insurance Co Group of China Ltd.	2 000	909	899	
PICC Property & Casualty Co., Ltd.	2 000	2 672	2 573	
Ping An Insurance Group Co of China Ltd.	4 000	30 606	35 866	
Polar Capital Holdings PLC	23	352	179	
Provident Financial PLC	142	855	443	
QBE Insurance Group Ltd.	1 265	15 000	15 611	
Raiffeisen Bank International AG	1 118	19 896	24 817	
RenaissanceRe Holdings Ltd.	6	1 520	1 498	
Santander Bank Polska SA	10	996	801	
Schroders PLC	153	1 327	1 087	
SCOR SE	392	15 874	12 182	
Shikoku Bank Ltd.	100	802	1 006	
Singapore Exchange Ltd.	155	1 357	1 401	
Skandinaviska Enskilda Banken AB	462	7 140	7 206	
Sparebank 1 Oestlandet	153	2 121	2 551	
Sparebanken Vest	1 079	12 696	13 713	
Steadfast Group Ltd.	309	1 381	1 553	
Suruga Bank Ltd.	700	3 457	3 041	
Swiss Life Holding AG	100	72 649	69 827	
Swissquote Group Holding SA	38	8 175	7 429	
Sydbank AS	23	1 083	1 309	
T&D Holdings Inc.	600	9 928	11 719	
Tamburi Investment Partners SpA	294	3 665	3 108	
TBC Bank Group PLC	324	9 231	11 987	
Thurgauer Kantonalbank	57	9 107	9 934	
Tisco Financial Group PCL, CAE sans droit de vote	100	342	388	
Tokio Marine Holdings Inc.	500	14 557	14 518	
Towa Bank Ltd.	100	492	577	
Tryg A/S	1 093	32 669	35 144	
Turkiye Garanti Bankasi AS	723	937	1 572	
Unicaja Banco SA	890	1 211	1 327	
UniCredit SpA	3 599	48 076	69 074	
United Overseas Bank Ltd.	300	7 626	9 304	
Van Lanschot Kempen NV	23	677	728	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Vaudoise Assurances Holding SA	3	1 606	1 858	
Vontobel Holding AG	122	10 224	10 952	
VZ Holding AG	27	2 898	2 839	
Woori Financial Group Inc., CAAE	50	2 055	1 865	
		1 343 668	1 428 209	6,87
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 9,09 %)				
A&D HOLON Holdings Co., Ltd.	300	3 668	3 133	
Accenture PLC	232	80 800	83 881	
Adesso SE	2	591	381	
Adyen NV	33	84 306	61 484	
Allgeier SE	4	345	164	
Ams-OSRAM AG	886	9 420	8 758	
ASE Technology Holding Co., Ltd.	455	3 137	3 865	
ASML Holding NV	8	6 430	5 828	
ASML Holding NV, NASD	5	4 147	3 702	
Asseco Poland SA	25	650	561	
AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	417	11 046	19 297	
Atoss Software AG	10	2 110	2 013	
Barco NV	92	2 761	3 071	
Capita PLC	1 740	1 434	688	
Check Point Software Technologies Ltd.	4	684	684	
Chinasoft International Ltd.	4 000	4 381	4 715	
Comet Holding AG	2	926	574	
Computershare Ltd.	832	18 226	20 030	
Crayon Group Holding ASA	21	435	289	
CyberArk Software Ltd.	263	52 836	46 201	
Econocom Group SA	98	350	404	
Elmos Semiconductor SE	4	343	310	
Esker SA	35	12 860	7 961	
FIT Hon Teng Ltd.	18 000	3 732	6 406	
Flex Ltd.	30	664	872	
Forth Smart Service PCL	4	1	2	
Future Corp.	200	4 101	3 383	
GFT Technologies SE	14	800	687	
GL Sciences Inc.	100	1 898	2 359	
Halma PLC	211	8 371	6 789	
Hi Sun Technology China Ltd.	6 000	1 374	885	
Hilan Ltd.	18	1 325	1 205	
Hochiki Corp.	100	1 579	1 439	
Infineon Technologies AG	363	14 859	14 924	
Infomedia Ltd.	1 251	1 582	1 374	
Itfor Inc.	600	4 309	5 157	
JBCC Holdings Inc.	200	3 745	3 765	
JFrog Ltd.	13	375	376	
JinkoSolar Holding Co., Ltd.	305	17 861	16 894	
Kaga Electronics Co., Ltd.	100	3 495	4 195	
Kainos Group PLC	179	4 544	4 502	
Keywords Studios PLC	39	1 971	1 732	
Kin & Carta PLC	372	1 646	1 298	
Kingboard Holdings Ltd.	2 500	9 760	10 785	
Kitron ASA	159	372	613	
Kudelski SA	100	668	347	
Kyocera Corp.	100	6 795	6 728	
Kyowa Electronic Instruments Co., Ltd.	400	1 896	1 429	
Lagercrantz Group AB	560	5 160	7 523	
Landis+Gyr Group AG	99	6 850	9 460	
LEM Holding SA	4	9 859	10 509	
Maxon Solar Technologies Ltd.	60	1 835	1 306	
Murata Manufacturing Co., Ltd.	100	7 025	6 765	
Nagarro SE	16	2 446	2 559	
NCC Group PLC	98	493	319	
NEC Corp.	100	4 833	4 760	
Nemetschek SE	273	29 421	18 827	
Nihon Denkei Co., Ltd.	100	1 363	1 521	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Nokia Oyj	5 184	32 188	32 437	
Nokia Oyj, CAAE	464	2 873	2 917	
Nomura Research Institute Ltd.	100	3 182	3 199	
Nordic Semiconductor ASA	389	6 753	8 769	
Nova Ltd.	167	10 551	18 315	
NTT Data Corp.	200	3 929	3 968	
NXP Semiconductors NV	210	47 126	44 966	
Omron Corp.	100	6 339	6 577	
Oporun Co., Ltd.	100	2 463	2 302	
Ordina NV	21	126	118	
Oxford Instruments PLC	9	270	332	
PAX Global Technology Ltd.	4 000	2 226	4 687	
Pole To Win Holdings Inc.	100	923	848	
Praemium Ltd.	704	535	518	
Proact IT Group AB	444	4 948	4 792	
Radware Ltd.	326	13 982	8 724	
Renesas Electronics Corp.	2 500	33 164	30 384	
Renishaw PLC	113	8 644	6 756	
Reply SpA	77	12 613	11 914	
SAP SE	33	4 811	4 600	
SAP SE, CAAE	773	95 258	108 079	
Seagate Technology Holdings PLC	54	4 082	3 849	
Sensirion Holding AG	111	11 311	15 931	
Shimadzu Corp.	100	4 084	3 846	
Siltronic AG	63	6 985	6 209	
SMA Solar Technology AG	380	24 255	36 735	
Software AG	7	376	245	
Southern Cross Payments Ltd.	1 850	1 362	909	
STMicroelectronics NV	149	6 413	7 109	
SUESS MicroTec SE	100	1 761	2 189	
SUMCO Corp.	1 800	36 739	32 477	
Sunny Optical Technology Group Co., Ltd.	100	1 580	1 612	
Suzuki Co., Ltd.	100	855	854	
Tachibana Eletech Co., Ltd.	50	741	906	
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	1 274	155 789	128 586	
TDK Corp.	100	4 611	4 452	
TE Connectivity Ltd.	91	16 229	14 155	
TeamViewer AG	93	1 253	1 620	
Technology One Ltd.	1 004	11 036	12 122	
TIS Inc.	100	3 698	3 574	
Tobii AB	1 295	6 846	2 816	
Tokyo Electron Ltd.	200	89 477	79 853	
TomTom NV	374	4 136	3 507	
Tongda Group Holdings Ltd.	50 000	4 257	1 120	
Trend Micro Inc.	200	13 605	12 610	
Truly International Holdings Ltd.	20 000	3 759	4 236	
Tsuzuki Denki Co., Ltd.	100	1 273	1 332	
TXT e-solutions SpA	30	550	557	
U-blox Holding AG	54	4 827	8 715	
Unisem M Bhd	2	2	2	
United Microelectronics Corp.	686	6 467	6 070	
Venture Corp. Ltd.	100	1 722	1 723	
Wasion Holdings Ltd.	12 000	6 005	5 416	
WiseTech Global Ltd.	40	1 923	1 865	
Wix.com Ltd.	308	34 089	32 063	
Xiaomi Corp.	200	347	380	
Xunlei Ltd.	165	349	407	
Yashima Denki Co., Ltd.	100	969	1 114	
Yokogawa Electric Corp.	650	15 685	14 051	
ZTE Corp.	999	2 722	2 983	
		1 253 968	1 203 091	5,79
Services de communication (31 décembre 2021 : 3,33 %)				
Airtel Africa PLC	2 609	6 622	4 754	
Alma Media Oyj	100	926	1 359	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
America Movil SAB de CV	89	2 233	2 195	
Amuse Inc.	100	1 932	1 797	
APT Satellite Holdings Ltd.	2 000	662	733	
Asahi Net Inc.	400	2 385	2 345	
Ascom Holding AG	23	363	250	
Auto Trader Group PLC	1 636	19 520	13 748	
Autohome Inc.	21	873	871	
Baidu Inc.	74	13 010	11 469	
Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd.	877	2 062	2 043	
Bushiroad Inc.	600	4 244	4 128	
Cairo Communication SpA	2 024	4 384	4 355	
Catena Media PLC	680	2 008	1 685	
Chunghwa Telecom Co., Ltd.	103	5 261	5 107	
CTS Eventim AG & Co KGaA	277	19 709	23 874	
Cyfrowy Polsat SA	37	360	201	
Deutsche Telekom AG	857	21 948	23 098	
Digital Bros SpA	10	609	324	
EVT Ltd.	389	4 838	4 550	
Freenet AG	13	356	384	
G5 Entertainment AB	11	315	301	
Hakuhodo DY Holdings Inc.	100	1 315	1 366	
Homeland Interactive Technology Ltd.	2 000	515	493	
Hutchison Telecommunications Hong Kong Holdings Ltd.	2 000	435	424	
IMAGICA Group Inc.	100	614	677	
Informa PLC	2 029	19 911	20 490	
IPSOS	10	495	846	
KDDI Corp.	400	16 505	16 357	
Kinepolis Group NV	10	752	561	
Kingsoft Corp. Ltd.	200	871	906	
Konami Group Corp.	100	7 187	6 131	
Koninklijke KPN NV	872	3 303	3 644	
Kuaishou Technology	100	924	1 233	
Liberty Global PLC, série A	127	3 661	3 257	
Liberty Global PLC, série C	1	27	26	
MarkLines Co., Ltd.	200	5 087	5 254	
NetEase Inc.	500	9 369	9 939	
Nexon Co., Ltd.	100	2 452	3 042	
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	300	11 114	11 590	
Paradox Interactive AB	3	67	83	
PLDT Inc.	25	1 217	772	
Proximus SADP	20	500	260	
Reach PLC	106	717	164	
Rovio Entertainment Oyj	34	370	299	
Sanoma Oyj	223	4 101	3 167	
Schibsted ASA	120	3 600	3 062	
Scout24 SE	152	10 524	10 315	
SK Telecom Co., Ltd.	1 091	47 115	30 437	
SKY Network Television Ltd.	543	1 352	1 070	
SoftBank Corp.	800	11 881	12 224	
SoftBank Group Corp.	300	18 714	17 388	
Sohu.com Ltd.	461	9 198	8 564	
Swisscom AG	11	7 922	8 161	
Technicolor Creative Studios SA	105	338	34	
Telefonica Brasil SA	143	1 867	1 385	
Telefonica Deutschland Holding AG	296	1 042	986	
Telefonica SA	69	383	334	
Telia Co AB	727	2 578	2 520	
Telkom Indonesia Persero Tbk PT, CAAE	1 873	68 840	60 527	
Tencent Holdings Ltd.	400	21 118	23 193	
Tencent Music Entertainment Group	178	1 072	1 997	
TX Group AG	53	9 180	11 487	
Zengame Technology Holding Ltd.	2 000	551	583	
		423 404	394 819	1,90

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Services publics (31 décembre 2021 : 2,30 %)				
ACEA SpA	14	374	262	
Beijing Enterprises Holdings Ltd.	500	2 423	2 170	
Brookfield Infrastructure Partners LP	200	9 562	8 388	
Centrais Eletricas Brasileiras SA, CAE sans droit de vote	34	368	365	
Chubu Electric Power Co Inc.	1 600	20 826	22 381	
Chugoku Electric Power Co Inc.	600	4 143	4 159	
Cia Energetica de Minas Gerais	1 659	3 940	4 563	
Cia Paranaense de Energia, CAAE	346	2 900	3 371	
CLP Holdings Ltd.	1 500	16 346	14 830	
Contact Energy Ltd.	657	4 379	4 341	
Drax Group PLC	2 038	22 716	23 352	
EDP - Energias de Portugal SA	742	4 319	4 996	
EDP Renovaveis SA	924	30 279	27 499	
Elia Group SA	70	13 306	13 443	
Encavis AG	409	10 016	10 933	
Enel Chile SA	161	439	491	
ENN Energy Holdings Ltd.	300	5 841	5 708	
EVN AG	237	6 740	5 792	
Hiroshima Gas Co., Ltd.	900	3 427	3 179	
Infratil Ltd.	5 982	40 972	44 347	
Kansai Electric Power Co Inc.	200	2 340	2 627	
Kenon Holdings Ltd.	735	25 749	32 910	
Korea Electric Power Corp.	146	1 489	1 709	
Kunlun Energy Co., Ltd.	32 000	31 472	30 943	
Mercury NZ Ltd.	197	950	939	
National Grid PLC	55	1 104	894	
National Grid PLC, CAAE	210	19 821	17 164	
Okinawa Electric Power Co Inc.	60	746	623	
Origin Energy Ltd.	2 393	16 468	16 975	
Orron Energy ab	579	1 766	1 691	
Osaka Gas Co., Ltd.	100	2 163	2 187	
PGE Polska Grupa Energetyczna SA	3 461	9 915	7 360	
Power Assets Holdings Ltd.	500	3 415	3 711	
Rubis SCA	936	41 423	33 297	
Shikoku Electric Power Co Inc.	400	3 016	3 142	
Snam SpA	576	4 021	3 771	
Tauron Polska Energia SA	2 487	1 999	1 628	
Telecom Plus PLC	14	346	501	
Terna - Rete Elettrica Nazionale	794	8 152	7 923	
Tohoku Electric Power Co Inc.	1 500	10 840	10 644	
Veolia Environnement SA	29	1 237	1 006	
YTL Power International Bhd	3 900	797	858	
		392 545	387 073	1,86
Immobilier (31 décembre 2021 : 1,80 %)				
Aeon Mall Co., Ltd.	200	3 060	3 502	
Agile Group Holdings Ltd.	8 000	13 647	3 208	
Airport City Ltd.	503	14 523	10 867	
Aroundtown SA	273	829	862	
Azrieli Group Ltd.	144	13 538	12 917	
China Overseas Land & Investment Ltd.	2 500	9 566	8 941	
China Resources Land Ltd.	2 000	11 261	12 413	
China Resources Mixe Lifestyle Services Ltd.	200	1 303	1 377	
China Vanke Co., Ltd., HKG	4 200	10 880	11 520	
Chip Eng Seng Corp. Ltd.	3 900	2 378	2 955	
Civitas Social Housing PLC	537	991	552	
CK Asset Holdings Ltd.	1 500	13 382	12 512	
Concentradora Fibra Danhos SA de CV	1 400	2 305	2 278	
Country Garden Holdings Co., Ltd.	9 000	6 028	4 172	
Cushman & Wakefield PLC	104	1 545	1 756	
Daiwa House Industry Co., Ltd.	200	6 176	6 242	
Daiwa House REIT Investment Corp.	1	2 985	3 013	
Fibra Uno Administracion SA de CV	900	1 344	1 437	
Goodman Property Trust	169	362	293	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
GPT Group	1 490	5 978	5 750	
Growthpoint Properties Australia Ltd.	100	390	274	
Hammerson PLC	9 813	6 297	3 807	
Hang Lung Properties Ltd.	1 000	2 595	2 649	
HKR International Ltd.	800	452	340	
Hong Fok Corp. Ltd.	3 100	3 143	2 975	
Hopson Development Holdings Ltd.	200	343	267	
Investis Holding SA	76	7 010	11 297	
Japan Excellent Inc.	9	12 343	12 107	
Japan Property Management Center Co., Ltd.	100	934	1 025	
Kenedix Office Investment Corp.	11	36 278	36 147	
Land & Houses PCL	4 900	1 731	1 898	
Lar Espana Real Estate Socimi SA	175	2 098	1 069	
Lendlease Corp. Ltd.	2 264	21 031	16 310	
Link REIT	600	5 571	5 968	
Logan Group Co., Ltd.	9 000	2 042	1 953	
Longfor Group Holdings Ltd.	1 000	3 519	4 219	
Lotus's Retail Growth Freehold And Leasehold Property Fund	3 800	1 875	1 888	
Mitsubishi Estate Co., Ltd.	400	7 046	7 028	
Mivne Real Estate KD Ltd.	–	–	1	
Nexity SA	13	723	490	
Nippon Prologis REIT Inc.	2	6 494	6 336	
Nisshin Group Holdings Co., Ltd.	200	1 125	883	
Nomura Real Estate Master Fund Inc.	1	1 660	1 674	
NP3 Fastigheter AB	281	6 597	7 257	
NSI NV	27	914	908	
Olav Thon Eiendomsselskap ASA	13	355	314	
Origin Property PCL	1 000	379	473	
Orix JREIT Inc.	2	3 674	3 830	
Peet Ltd.	88	90	91	
PSP Swiss Property AG	6	857	953	
Safestore Holdings PLC	700	14 956	10 782	
Sagax AB, cat. B	1 006	36 433	30 939	
Sankyo Frontier Co., Ltd.	100	4 081	3 225	
Savills PLC	34	803	457	
Selvaag Bolig ASA	597	3 260	2 632	
Shimao Group Holdings Ltd.	2 003	2 309	1 537	
Sirius Real Estate Ltd.	180	368	217	
Sunac China Holdings Ltd.	1 000	882	795	
Swire Pacific Ltd.	3 500	25 051	41 743	
Swire Properties Ltd.	400	1 212	1 378	
Swiss Prime Site AG	28	3 227	3 287	
Tokyo Rakutenchi Co., Ltd.	100	3 979	4 180	
Tonunlar Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS	5 606	7 347	7 831	
UOL Group Ltd.	200	1 283	1 358	
Varia US Properties AG	80	5 180	5 401	
VGP NV	48	9 151	5 400	
Wihlborgs Fastigheter AB	74	759	755	
YH Dimri Construction & Development Ltd.	3	367	252	
Total des actions étrangères – position acheteur		380 295	363 167	1,75
		9 711 859	9 810 659	47,21

Actions étrangères – position vendeur

Énergie (31 décembre 2021 : -0,86 %)

Akastor ASA	(225)	(360)	(285)
Beach Energy Ltd.	(470)	(516)	(689)
CropEnergies AG	(1 459)	(26 102)	(27 470)
Deutsche Rohstoff AG	(51)	(1 461)	(1 918)
Eni SpA, MIL	(1 940)	(33 605)	(37 273)
Eni SpA, NYSE	(26)	(1 016)	(1 010)
Equital Ltd.	(689)	(24 090)	(27 701)
Euronav NV	(9)	(124)	(204)
Fuji Oil Co., Ltd.	(1 000)	(2 677)	(2 629)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Reliance Industries Ltd., CIAE	(10)	(893)	(833)	
Sala Corp.	(100)	(639)	(751)	
Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	(74)	(4 368)	(6 228)	
TechnipFMC PLC	(601)	(9 749)	(9 927)	
Tenaris SA	(178)	(7 918)	(8 480)	
TGS ASA	(1 114)	(21 342)	(20 226)	
Transport de Gas del Sur S.A., CAAE	(400)	(4 232)	(6 395)	
VERBIO Vereinigte BioEnergie AG	(34)	(3 322)	(2 980)	
Woodside Energy Group Ltd., CAAE	(28)	(812)	(919)	
Worley Ltd.	(79)	(836)	(1 089)	
		(144 062)	(157 007)	(0,76)
Matières premières (31 décembre 2021 : -2,12 %)				
Air Water Inc.	(300)	(4 741)	(4 729)	
Akzo Nobel NV	(111)	(9 874)	(10 042)	
Aluflexpack AG	(189)	(5 365)	(4 888)	
Asahi Kasei Corp.	(100)	(957)	(967)	
Aurubis AG	(4)	(603)	(442)	
Bellevue Gold Ltd.	(1 048)	(734)	(1 088)	
Buzzi Unicem SpA	(95)	(2 298)	(2 473)	
Cemex SAB de CV	(6 732)	(45 176)	(36 942)	
Chr Hansen Holding A/S	(185)	(14 666)	(17 977)	
Cia de Minas Buenaventura SAA	(2 951)	(32 203)	(29 789)	
Cia Siderurgica Nacional SA	(2 402)	(10 054)	(8 983)	
Clariant AG	(63)	(1 678)	(1 352)	
Corbion NV	(15)	(756)	(691)	
CSR Ltd.	(778)	(3 526)	(3 367)	
Daiki Aluminium Industry Co., Ltd.	(100)	(1 278)	(1 274)	
Fuchs Petrolub SE, actions priv.	(6)	(387)	(381)	
GCC SAB de CV	(20)	(146)	(181)	
Gold Fields Ltd.	(66)	(924)	(926)	
ICL Group Ltd.	(63)	(789)	(616)	
Imdex Ltd.	(1 203)	(2 391)	(2 443)	
K+S AG	(473)	(14 837)	(12 569)	
Lenzing AG	(69)	(7 071)	(5 468)	
Loma Negra Cia Industrial Argentina SA	(274)	(2 218)	(2 543)	
Maeda Kosen Co., Ltd.	(100)	(3 088)	(3 199)	
Mitsubishi Chemical Group Corp.	(900)	(6 444)	(6 328)	
Mitsubishi Steel Manufacturing Co., Ltd.	(500)	(5 077)	(5 099)	
Nippon Denko Co., Ltd.	(100)	(378)	(361)	
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	(4 700)	(69 160)	(50 147)	
Nippon Pillar Packing Co., Ltd.	(200)	(5 803)	(5 615)	
Nippon Steel Corp.	(700)	(15 353)	(16 476)	
Nufarm Ltd.	(1 098)	(6 052)	(6 185)	
Oji Holdings Corp.	(300)	(1 859)	(1 636)	
Perenti Ltd.	(1 202)	(753)	(1 452)	
SIG Group AG	(11)	(352)	(325)	
SOL SpA	(62)	(1 468)	(1 587)	
Solvay SA	(33)	(4 170)	(4 508)	
SSAB AB, Series B	(2 908)	(20 183)	(20 496)	
Swiss Steel Holding AG	(1 859)	(712)	(564)	
Syrah Resources Ltd.	(5 089)	(6 144)	(9 633)	
Tenma Corp.	(100)	(2 107)	(2 112)	
Yara International ASA	(134)	(8 204)	(7 936)	
Zignago Vetro SpA	(100)	(1 425)	(2 039)	
		(321 404)	(295 829)	(1,42)
Industries (31 décembre 2021 : -2,61 %)				
Ackermans & van Haaren NV	(16)	(3 591)	(3 707)	
ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	(9)	(362)	(348)	
Adecco Group AG	(456)	(29 546)	(20 341)	
AerCap Holdings NV	(705)	(48 387)	(55 710)	
AF Gruppen ASA	(165)	(3 522)	(3 264)	
AFRY AB	(17)	(448)	(378)	
Air France-KLM	(193)	(341)	(344)	
Air New Zealand Ltd.	(1 093)	(789)	(698)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Aker Carbon Capture ASA	(88)	(56)	(140)	
Alliance Aviation Services Ltd.	(762)	(2 635)	(2 192)	
ALS Ltd.	(49)	(571)	(551)	
Amada Co., Ltd.	(400)	(4 420)	(4 247)	
AP Moller - Maersk A/S	(2)	(6 203)	(6 075)	
Auckland International Airport Ltd.	(52)	(343)	(348)	
Avio SpA	(50)	(764)	(692)	
Belimo Holding AG	(1)	(667)	(644)	
BeNext-Yumeshin Group Co.	(100)	(1 961)	(1 747)	
Besterra Co., Ltd.	(200)	(3 756)	(1 896)	
Bonheur ASA	(100)	(3 840)	(3 948)	
Bpost SA	(327)	(3 061)	(2 272)	
Br Holdings Corp.	(400)	(1 557)	(1 356)	
Carel Industries SpA	(32)	(1 086)	(1 087)	
Caverion Oyj	(804)	(6 517)	(8 057)	
Cleanaway Waste Management Ltd.	(128)	(361)	(309)	
Controladora Vuela Cia de Aviacion SAB de CV, NYSE	(767)	(14 813)	(8 688)	
Copa Holdings SA	(12)	(979)	(1 352)	
Daiseki Co., Ltd.	(100)	(4 519)	(4 662)	
Dfids A/S	(421)	(23 620)	(20 991)	
Dormakaba Holding AG	(15)	(10 319)	(7 436)	
DSV A/S	(79)	(13 944)	(16 845)	
EHang Holdings Ltd.	(90)	(992)	(1 046)	
Elco Ltd.	(100)	(7 277)	(6 912)	
Electro Optic Systems Holdings Ltd.	(390)	(1 999)	(174)	
Enav SpA	(1 399)	(7 154)	(8 011)	
Enento Group Oyj	(92)	(4 307)	(2 847)	
Energiekontor AG	(3)	(344)	(334)	
FDK Corp.	(100)	(956)	(943)	
Ferrovial SA	(1)	(35)	(35)	
Fila SpA	(371)	(4 686)	(3 734)	
Fletcher Building Ltd.	(135)	(886)	(546)	
Forum Engineering Inc.	(100)	(860)	(870)	
Freightways Ltd.	(252)	(2 681)	(2 086)	
Grafton Group PLC	(22)	(444)	(283)	
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV, CAAE	(2)	(560)	(631)	
GWA Group Ltd.	(809)	(1 677)	(1 524)	
Hamakyorex Co., Ltd.	(100)	(3 042)	(3 230)	
HeidelbergCement AG	(4)	(375)	(308)	
Hexagon Composites ASA	(532)	(2 025)	(2 005)	
Huber + Suhner AG	(5)	(609)	(632)	
Indus Holding AG	(100)	(3 797)	(3 174)	
Instalco AB	(272)	(2 163)	(1 402)	
Japan Foundation Engineering Co., Ltd.	(100)	(583)	(497)	
JET2 PLC	(75)	(1 531)	(1 172)	
Johns Lyng Group Ltd.	(5 879)	(38 044)	(33 438)	
JOST Werke AG	(45)	(3 021)	(3 423)	
Kelsian Group Ltd.	(5 313)	(28 138)	(28 071)	
King Jim Co., Ltd.	(400)	(3 847)	(3 652)	
Komatsu Wall Industry Co., Ltd.	(100)	(1 849)	(1 865)	
Komax Holding AG	(54)	(18 884)	(20 364)	
Kornit Digital Ltd.	(154)	(6 746)	(4 793)	
Kosaido Holdings Co., Ltd.	(200)	(1 814)	(4 354)	
Kuehne + Nagel International AG	(134)	(49 603)	(42 231)	
Link And Motivation Inc.	(200)	(1 107)	(1 325)	
LU-VE SpA	(100)	(2 806)	(4 071)	
Makino Milling Machine Co., Ltd.	(100)	(4 417)	(4 447)	
Makita Corp.	(200)	(9 761)	(6 326)	
Marubeni Corp.	(100)	(1 516)	(1 556)	
MBB SE	(2)	(351)	(266)	
Midac Holdings Co., Ltd.	(100)	(4 767)	(2 639)	
Mitsui & Co., Ltd.	(200)	(7 849)	(7 913)	
Mpac Group PLC	(72)	(675)	(329)	
MTU Aero Engines AG	(5)	(1 286)	(1 462)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
NCC AB	(361)	(7 858)	(4 565)	
NEL ASA	(4 361)	(9 258)	(8 311)	
NHOA	(30)	(622)	(412)	
Nichiban Co., Ltd.	(200)	(3 313)	(3 818)	
Nippon Aqua Co., Ltd.	(100)	(698)	(850)	
Nippon Thompson Co., Ltd.	(100)	(506)	(530)	
Nolato AB	(30)	(383)	(213)	
NSK Ltd.	(500)	(4 394)	(3 599)	
NTN Corp.	(500)	(1 308)	(1 356)	
OC Oerlikon Corp. AG	(50)	(619)	(444)	
Oesterreichische Post AG	(36)	(1 696)	(1 531)	
OHB SE	(418)	(20 968)	(19 494)	
OSG Corp.	(500)	(9 684)	(9 329)	
Park24 Co., Ltd.	(200)	(4 095)	(4 672)	
Peab AB	(265)	(2 229)	(2 037)	
Penta-Ocean Construction Co., Ltd.	(100)	(851)	(635)	
PNE AG	(841)	(9 755)	(25 965)	
Porr Ag	(21)	(356)	(357)	
Port of Tauranga Ltd.	(68)	(369)	(365)	
Qube Holdings Ltd.	(6 149)	(15 798)	(15 877)	
Reece Ltd.	(832)	(12 723)	(10 818)	
Reliance Worldwide Corp. Ltd.	(3 593)	(14 426)	(9 772)	
ReneSola Ltd.	(428)	(2 551)	(2 621)	
Rheon Automatic Machinery Co., Ltd.	(200)	(2 513)	(2 204)	
SATS Ltd.	(140)	(518)	(402)	
Schindler Holding AG	(2)	(683)	(509)	
Seikitokyu Kogyo Co., Ltd.	(100)	(968)	(811)	
Service Stream Ltd.	(11 664)	(7 263)	(7 342)	
Shikun & Binui Ltd.	(237)	(1 678)	(896)	
Shima Seiki Manufacturing Ltd.	(100)	(2 040)	(1 905)	
Shinmaywa Industries Ltd.	(300)	(3 176)	(3 247)	
SIF Holding NV	(100)	(1 289)	(1 677)	
SIGMAXYZ Holdings Inc.	(100)	(1 362)	(1 328)	
SMS Co., Ltd.	(200)	(10 107)	(6 891)	
Stabilus SE	(22)	(2 066)	(2 001)	
Star Micronics Co., Ltd.	(400)	(6 965)	(6 650)	
Tadano Ltd.	(100)	(1 074)	(942)	
Takamiya Co., Ltd.	(100)	(450)	(382)	
Talenom Oyj	(76)	(1 161)	(1 000)	
TClarke PLC	(303)	(734)	(593)	
Textainer Group Holdings Ltd.	(341)	(13 894)	(14 328)	
THK Co., Ltd.	(400)	(12 674)	(10 331)	
Tinexta SpA	(100)	(3 155)	(3 297)	
Tomoe Corp.	(100)	(459)	(416)	
Vossloh AG	(89)	(5 627)	(5 032)	
Vow ASA	(169)	(988)	(413)	
Yahagi Construction Co., Ltd.	(100)	(833)	(774)	
Yamashina Corp.	(400)	(331)	(263)	
		(634 910)	(596 451)	(2,87)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -3,36 %)				
AB Dynamics PLC	(11)	(347)	(287)	
Accent Group Ltd.	(1 617)	(2 110)	(2 496)	
Adairs Ltd.	(2 001)	(4 104)	(4 045)	
Aeon Fantasy Co., Ltd.	(100)	(2 579)	(2 778)	
Aisin Corp.	(200)	(9 292)	(7 250)	
Aoyama Trading Co., Ltd.	(200)	(1 728)	(1 885)	
ARB Corp. Ltd.	(334)	(13 107)	(7 878)	
ASKUL Corp.	(200)	(3 699)	(3 510)	
Atom Corp.	(100)	(715)	(796)	
Autoneum Holding AG	(2)	(454)	(299)	
Azorim-Investment Development & Construction Co., Ltd.	(881)	(4 126)	(3 819)	
Baby Bunting Group Ltd.	(213)	(463)	(530)	
Bapcor Ltd.	(1 679)	(10 588)	(9 966)	
Bayerische Motoren Werke AG	(191)	(21 887)	(23 030)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Benesse Holdings Inc.	(400)	(9 370)	(8 240)	
BHG Group AB	(382)	(5 672)	(922)	
Bic Camera Inc.	(300)	(3 381)	(3 950)	
Brembo SpA	(149)	(2 011)	(2 252)	
Brunello Cucinelli SpA	(6)	(362)	(600)	
Bulten AB	(100)	(823)	(774)	
Capri Holdings Ltd.	(180)	(13 865)	(13 980)	
Central Sports Co., Ltd.	(100)	(2 366)	(2 485)	
Chargeurs SA	(346)	(6 159)	(7 045)	
Cie Automotive SA	(10)	(347)	(348)	
Corporate Travel Management Ltd.	(18)	(349)	(244)	
Daido Metal Co., Ltd.	(100)	(473)	(490)	
Daimler Truck Holding AG	(227)	(9 998)	(9 502)	
De' Longhi SpA	(449)	(12 929)	(13 622)	
Demac-Can Co., Ltd.	(200)	(3 472)	(883)	
Despegar.com Corp.	(72)	(1 037)	(500)	
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	(10)	(769)	(609)	
Eagers Automotive Ltd.	(221)	(2 690)	(2 203)	
EDION Corp.	(100)	(1 275)	(1 321)	
ES-Con Japan Ltd.	(600)	(5 076)	(4 818)	
Eslead Corp.	(200)	(3 729)	(3 814)	
Fielmann AG	(21)	(1 445)	(1 124)	
Fuji Corp. Ltd.	(100)	(761)	(676)	
Furukawa Battery Co., Ltd.	(100)	(1 782)	(1 117)	
G8 Education Ltd.	(2 681)	(2 422)	(2 722)	
Geox SpA	(1 451)	(1 453)	(1 685)	
Gfoot Co., Ltd.	(300)	(1 368)	(906)	
GreenTree Hospitality Group Ltd.	(82)	(409)	(412)	
GSI Creos Corp.	(100)	(1 301)	(1 508)	
GUD Holdings Ltd.	(461)	(5 022)	(3 211)	
H2O Retailing Corp.	(700)	(8 156)	(9 273)	
Harvey Norman Holdings Ltd.	(119)	(644)	(452)	
Hella GmbH & Co KGaA	(224)	(18 020)	(24 634)	
Joshin Denki Co., Ltd.	(100)	(1 974)	(1 993)	
JTEKT Corp.	(500)	(5 758)	(4 770)	
Just Eat Takeaway.com NV	(99)	(4 902)	(2 827)	
Kambi Group PLC	(232)	(8 970)	(5 725)	
Kanzhun Ltd.	(743)	(18 058)	(20 507)	
Kendrion NV	(172)	(3 784)	(3 855)	
KMD Brands Ltd.	(6 122)	(5 812)	(5 404)	
Kojima Co., Ltd.	(1 100)	(8 316)	(6 687)	
Kongsberg Automotive ASA	(628)	(268)	(218)	
K's Holdings Corp.	(200)	(2 760)	(2 317)	
KYB Corp.	(100)	(3 337)	(3 497)	
Maytronics Ltd.	(107)	(2 638)	(1 438)	
MEKO AB	(420)	(7 783)	(6 150)	
Mercedes-Benz Group AG	(48)	(4 340)	(4 262)	
Mitsubishi Motors Corp.	(3 100)	(16 372)	(16 235)	
Musti Group Oyj	(53)	(1 795)	(1 196)	
Neinor Homes SA	(75)	(1 241)	(887)	
New Art Holdings Co., Ltd.	(100)	(1 373)	(1 595)	
NGK Spark Plug Co., Ltd.	(100)	(2 511)	(2 505)	
Nobia AB	(100)	(407)	(277)	
Nokian Renkaat Oyj	(391)	(8 216)	(5 417)	
Open Door Inc.	(200)	(4 419)	(3 641)	
Ozu Corp.	(200)	(3 605)	(3 163)	
Piaggio & C SpA	(100)	(412)	(405)	
POLYTEC Holding AG	(317)	(3 464)	(2 109)	
Raccoon Holdings Inc.	(200)	(2 455)	(2 220)	
Resorttrust Inc.	(100)	(2 399)	(2 412)	
Riso Kyoiku Co., Ltd.	(400)	(1 583)	(1 503)	
Royal Holdings Co., Ltd.	(200)	(4 269)	(4 765)	
Sanoh Industrial Co., Ltd.	(600)	(4 714)	(3 771)	
Senshukai Co., Ltd.	(100)	(409)	(396)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Sharp Corp.	(100)	(1 707)	(970)	
Shimajima Co., Ltd.	(100)	(1 216)	(958)	
SKYCITY Entertainment Group Ltd.	(201)	(579)	(408)	
Sprix Inc.	(100)	(1 577)	(929)	
Suminoe Textile Co., Ltd.	(100)	(1 710)	(1 888)	
Sumitomo Riko Co., Ltd.	(100)	(576)	(622)	
Taiho Kogyo Co., Ltd.	(200)	(1 707)	(1 259)	
Tata Motors Ltd.	(123)	(4 093)	(3 852)	
Tokmanni Group Corp.	(196)	(3 440)	(3 200)	
Tokyo Individualized Educational Institute Inc.	(100)	(582)	(542)	
Toyoda Gosei Co., Ltd.	(100)	(2 623)	(2 108)	
Toyota Motor Corp.	(100)	(1 971)	(1 861)	
Universal Entertainment Corp.	(100)	(2 815)	(2 442)	
Uxin Ltd.	(400)	(6 133)	(1 561)	
VT Holdings Co., Ltd.	(200)	(934)	(969)	
Warehouse Group Ltd.	(1 356)	(3 421)	(3 021)	
Westwing Group SE	(28)	(1 647)	(389)	
XXL ASA	(1 457)	(2 705)	(765)	
Yakiniku Sakai Holdings Inc.	(500)	(339)	(359)	
Zeal Network SE	(29)	(1 503)	(1 181)	
Zensho Holdings Co., Ltd.	(100)	(2 964)	(3 399)	
ZOZO Inc.	(100)	(4 427)	(3 348)	
		(391 148)	(353 069)	(1,70)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -1,42 %)				
Accrol Group Holdings PLC	(988)	(357)	(460)	
AG Barr PLC	(100)	(844)	(869)	
Agrana Beteiligungs AG	(102)	(2 613)	(2 205)	
Anora Group Oyj	(527)	(5 445)	(5 609)	
Bakkafrost P/F	(378)	(32 231)	(32 027)	
Bega Cheese Ltd.	(144)	(468)	(513)	
BrasilAgro - Co Brasileira de Propriedades Agricolas	(1 603)	(12 429)	(12 358)	
Cia Brasileira de Distribuicao	(868)	(4 538)	(3 646)	
Coca-Cola Europacific Partners PLC	(182)	(11 098)	(13 642)	
Cranswick PLC	(117)	(5 466)	(5 870)	
Établissements Franz Colruyt NV	(36)	(1 860)	(1 109)	
Fresh Del Monte Produce Inc.	(37)	(1 333)	(1 313)	
Haleon PLC	(11)	(107)	(119)	
Heineken NV	(8)	(906)	(1 017)	
HelloFresh SE	(564)	(20 117)	(16 744)	
Humble Group AB	(188)	(472)	(239)	
Imageya Co., Ltd.	(100)	(1 646)	(1 272)	
Italian Wine Brands SpA	(100)	(3 477)	(3 970)	
Kagome Co., Ltd.	(100)	(3 204)	(3 137)	
Kansai Food Market Ltd.	(200)	(2 274)	(2 633)	
Key Coffee Inc.	(100)	(2 025)	(2 117)	
Kirin Holdings Co., Ltd.	(700)	(14 858)	(14 456)	
Kotobuki Spirits Co., Ltd.	(200)	(12 935)	(15 876)	
KWS Saat SE & Co KGaA	(125)	(13 983)	(11 587)	
Kyokuyo Co., Ltd.	(100)	(3 575)	(3 902)	
MARR SpA	(100)	(1 388)	(1 649)	
McPherson's Ltd.	(470)	(367)	(289)	
Mowi ASA	(673)	(13 122)	(15 477)	
Natori Co., Ltd.	(100)	(2 232)	(2 111)	
Neto ME Holdings Ltd.	(100)	(4 182)	(3 809)	
Newlat Food SpA	(100)	(778)	(628)	
Nisshin Oillio Group Ltd.	(100)	(3 566)	(3 373)	
Nissui Corp.	(300)	(1 828)	(1 691)	
Okuwa Co., Ltd.	(300)	(3 874)	(2 733)	
Raisio Oyj	(1 316)	(4 765)	(4 739)	
Rohto Pharmaceutical Co., Ltd.	(400)	(7 895)	(9 530)	
Royal Unibrew A/S	(130)	(12 731)	(12 521)	
Salmar ASA	(449)	(20 239)	(23 764)	
Sanford Ltd.	(152)	(617)	(534)	
Savencia SA	(16)	(1 349)	(1 351)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Schouw & Co A/S	(109)	(10 981)	(11 107)	
Shoei Foods Corp.	(200)	(7 723)	(8 030)	
Shop Apotheke Europe NV	(10)	(645)	(638)	
Suominen Oyj	(123)	(821)	(533)	
Unicharm Corp.	(200)	(9 526)	(10 409)	
United Malt Grp Ltd.	(7 336)	(22 261)	(23 391)	
Uoriki Co., Ltd.	(100)	(2 115)	(2 189)	
Welcia Holdings Co., Ltd.	(300)	(12 120)	(9 473)	
Zur Rose Group AG	(36)	(8 184)	(1 348)	
		(311 570)	(308 007)	(1,48)
Soins de santé (31 décembre 2021 : -1,81 %)				
3-D Matrix Ltd.	(100)	(397)	(316)	
AddLife AB	(13)	(389)	(184)	
Amplifon SpA	(351)	(13 189)	(14 121)	
ArcticZymes Technologies ASA	(344)	(3 203)	(3 390)	
Atrys Health SA	(76)	(1 119)	(681)	
Australian Clinical Labs Ltd.	(1 468)	(4 330)	(4 020)	
Bactiguard Holding AB	(159)	(3 541)	(2 283)	
Basilea Pharmaceutica AG	(52)	(3 187)	(3 488)	
Bavarian Nordic A/S	(13)	(532)	(539)	
Bayer AG	(106)	(7 629)	(7 408)	
Bergenbio ASA	(1 253)	(1 885)	(1 287)	
Biocartis Group NV	(1 573)	(4 210)	(1 201)	
Cellectis SA	(742)	(2 285)	(2 132)	
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	(500)	(17 723)	(17 293)	
Clinuvel Pharmaceuticals Ltd.	(43)	(828)	(856)	
Coloplast A/S	(129)	(19 238)	(20 369)	
CompuGen Ltd.	(829)	(2 618)	(804)	
CompuGroup Medical SE & Co KGaA	(105)	(8 518)	(5 463)	
CRISPR Therapeutics AG	(44)	(2 681)	(2 423)	
Demant A/S	(16)	(554)	(599)	
DiaSorin SpA	(161)	(27 743)	(30 360)	
Eurobio Scientific SA	(50)	(1 391)	(1 472)	
Eurofins Scientific SE	(49)	(4 995)	(4 752)	
Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.	(38)	(698)	(736)	
Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	(10)	(546)	(442)	
Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, CAAE	(54)	(1 034)	(1 196)	
Fresenius SE & Co KGaA	(1 725)	(60 426)	(65 481)	
GN Store Nord AS	(89)	(2 807)	(2 765)	
Grifols SA	(53)	(512)	(610)	
JMDC Inc.	(100)	(6 359)	(3 882)	
KYORIN Holdings Inc.	(200)	(4 373)	(3 533)	
Legend Biotech Corp.	(146)	(10 194)	(9 875)	
M3 Inc.	(200)	(9 128)	(7 349)	
Medical Data Vision Co., Ltd.	(100)	(1 132)	(922)	
Medios AG	(171)	(8 782)	(4 327)	
Medius Holdings Co., Ltd.	(100)	(719)	(713)	
Molecular Partners AG	(49)	(964)	(442)	
MorphoSys AG	(84)	(3 952)	(1 605)	
Nexus AG	(59)	(5 105)	(4 761)	
Olympus Corp.	(700)	(15 976)	(16 907)	
OncoTherapy Science Inc.	(900)	(722)	(481)	
Orion Oyj	(91)	(4 990)	(6 743)	
Pharma Foods International Co., Ltd.	(400)	(13 224)	(5 430)	
PolyNovo Ltd.	(2 672)	(6 035)	(4 960)	
Prothena Corp. PLC	(4)	(319)	(327)	
QIAGEN NV	(167)	(10 155)	(11 353)	
Ryman Healthcare Ltd.	(1 071)	(6 131)	(4 901)	
Scancell Holdings PLC	(2 967)	(585)	(1 197)	
Ship Healthcare Holdings Inc.	(800)	(22 821)	(22 083)	
Starpharma Holdings Ltd.	(312)	(360)	(158)	
Summerset Group Holdings Ltd.	(42)	(425)	(319)	
Surgical Science Sweden AB	(187)	(3 360)	(4 005)	
SwedenCare AB	(141)	(1 421)	(564)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Tsumura & Co.	(200)	(7 486)	(5 952)	
UniQure NV	(31)	(843)	(952)	
UroGen Pharma Ltd.	(85)	(2 434)	(1 022)	
Vetoquinol SA	(73)	(7 640)	(9 247)	
WaVe Life Sciences Ltd.	(75)	(461)	(711)	
		(354 304)	(331 392)	(1,59)
Services financiers (31 décembre 2021 : -1,05 %)				
Aareal Bank AG	(36)	(1 362)	(1 721)	
ABC arbitrage	(112)	(1 218)	(1 045)	
Aegon NV, AMS	(4)	(17)	(27)	
Anima Holding SpA	(495)	(1 969)	(2 679)	
Australian Finance Group Ltd.	(1 205)	(1 634)	(1 611)	
Axactor ASA	(447)	(550)	(362)	
Baloise Holding AG	(94)	(19 026)	(19 644)	
Banca Popolare di Sondrio SpA	(3 928)	(20 245)	(21 471)	
Banco Bradesco SA	(456)	(1 733)	(1 779)	
Banco Macro SA	(499)	(8 825)	(11 102)	
Banco Santander Chile	(318)	(7 485)	(6 825)	
Bank of Queensland Ltd.	(346)	(2 486)	(2 194)	
Bendigo & Adelaide Bank Ltd.	(3)	(27)	(27)	
Challenger Ltd.	(2 174)	(12 416)	(15 222)	
Clal Insurance Enterprises Holdings Ltd.	(200)	(4 686)	(4 545)	
Collector Bank AB	(376)	(1 607)	(1 873)	
Concordia Financial Group Ltd.	(100)	(446)	(565)	
Credit Saison Co., Ltd.	(600)	(8 187)	(10 481)	
Dai-ichi Life Holdings Inc.	(100)	(3 030)	(3 075)	
Danske Bank A/S	(54)	(1 315)	(1 442)	
DeA Capital SpA	(1 236)	(1 699)	(2 649)	
Deutsche Pfandbriefbank AG	(89)	(1 343)	(936)	
DoValue SpA	(50)	(352)	(518)	
Eclixp Group Ltd.	(1 240)	(2 248)	(2 273)	
Fintech Global Inc.	(1 700)	(950)	(978)	
Flow Traders	(296)	(12 961)	(9 263)	
Fukuoka Financial Group Inc.	(200)	(5 158)	(6 172)	
Greenlight Capital Re Ltd.	(347)	(3 132)	(3 832)	
Grupo Financiero Galicia SA	(1 280)	(14 156)	(16 875)	
Grupo Supervielle SA	(1 724)	(3 936)	(5 046)	
Gruppo MutuiOnline SpA	(125)	(4 216)	(4 758)	
Harel Insurance Investments & Financial Services Ltd.	(260)	(3 052)	(3 096)	
HDFC Bank Ltd.	(54)	(4 383)	(5 005)	
Heartland Group Holdings Ltd.	(5 146)	(8 023)	(7 938)	
Hokkoku Financial Holdings Inc.	(100)	(4 274)	(4 662)	
HSBC Holdings PLC	(547)	(19 372)	(23 095)	
Humm Group Ltd.	(442)	(361)	(229)	
Hypoport SE	(4)	(2 064)	(563)	
Illimity Bank SpA	(386)	(6 779)	(3 852)	
Insignia Financial Ltd.	(118)	(374)	(363)	
Isracard Ltd.	(100)	(482)	(392)	
Lifenet Insurance Co.	(600)	(6 905)	(7 246)	
Migdal Insurance & Financial Holdings Ltd.	(936)	(1 124)	(1 441)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	(700)	(6 166)	(6 390)	
Monex Group Inc.	(500)	(3 685)	(2 141)	
Morningstar Japan KK	(400)	(2 646)	(1 865)	
Nomura Holdings Inc.	(100)	(572)	(502)	
Platinum Asset Management Ltd.	(509)	(839)	(837)	
Premium Group Co., Ltd.	(100)	(1 854)	(1 784)	
Prudential PLC, CAAE	(30)	(774)	(1 117)	
Qudian Inc.	(627)	(602)	(810)	
Resona Holdings Inc.	(300)	(2 215)	(2 228)	
Resurs Holding AB	(191)	(795)	(620)	
Ringkjøbing Landbobank A/S	(4)	(560)	(737)	
SBI Shinsei Bank Ltd.	(100)	(2 418)	(2 206)	
Shinhan Financial Group Co., Ltd.	(22)	(764)	(833)	
Shizuoka Financial Group Inc.	(100)	(947)	(1 083)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
SiriusPoint Ltd.	(414)	(3 248)	(3 310)	
SpareBank 1 Nord Norge	(29)	(360)	(383)	
SpareBank 1 SR-Bank ASA	(621)	(9 430)	(10 310)	
Sparx Group Co., Ltd.	(100)	(1 672)	(1 718)	
St Galler Kantonalbank AG	(1)	(592)	(704)	
St James's Place PLC	(36)	(605)	(643)	
Storebrand ASA	(3 162)	(37 269)	(37 142)	
Swiss Re AG	(3)	(400)	(380)	
Talanx AG	(7)	(339)	(449)	
Topdanmark AS	(145)	(10 163)	(10 303)	
Toyo Securities Co., Ltd.	(200)	(361)	(600)	
Unipol Gruppo SpA	(116)	(691)	(765)	
Westpac Banking Corp.	(25)	(538)	(536)	
Zip Co., Ltd.	(364)	(4 232)	(171)	
		(300 345)	(309 439)	(1,49)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -1,65 %)				
Access Co., Ltd.	(100)	(605)	(848)	
Ad-sol Nissin Corp.	(100)	(2 636)	(1 389)	
AIXTRON SE	(49)	(1 664)	(1 911)	
Alpha & Omega Semiconductor Ltd.	(22)	(935)	(852)	
Alpha Systems Inc.	(200)	(8 379)	(8 493)	
Appen Ltd.	(373)	(2 558)	(853)	
Argo Graphics Inc.	(100)	(3 906)	(3 820)	
Audinate Group Ltd.	(177)	(1 263)	(1 217)	
AudioCodes Ltd.	(233)	(6 574)	(5 560)	
Avant Group Corp.	(100)	(1 473)	(1 399)	
BE Semiconductor Industries NV	(63)	(6 561)	(5 153)	
Bechtle AG	(76)	(5 266)	(3 633)	
Bravura Solutions Ltd.	(1 626)	(4 305)	(1 307)	
CAICA DIGITAL Inc.	(300)	(569)	(262)	
Canaan Inc.	(168)	(573)	(469)	
Canon Inc.	(200)	(6 057)	(5 865)	
Canon Inc., CAAE	(822)	(25 746)	(24 147)	
Codan Ltd.	(1 055)	(5 187)	(3 975)	
Cube System Inc.	(100)	(922)	(1 069)	
Cybozu Inc.	(400)	(11 543)	(9 957)	
Digital Value SpA	(100)	(8 897)	(9 645)	
Elastic NV	(15)	(1 056)	(1 047)	
eSOL Co., Ltd.	(300)	(1 802)	(2 542)	
Ferrotec Holdings Corp.	(100)	(3 183)	(2 862)	
Fortnox AB	(398)	(2 066)	(2 448)	
GB Group PLC	(2 459)	(14 883)	(12 617)	
GMO internet group Inc.	(100)	(3 500)	(2 532)	
ITbook Holdings Co., Ltd.	(1 300)	(8 109)	(5 086)	
Ituran Location and Control Ltd.	(230)	(8 202)	(6 585)	
IVU Traffic Technologies AG	(288)	(6 983)	(6 697)	
Japan Cash Machine Co., Ltd.	(400)	(2 593)	(4 408)	
Japan Display Inc.	(1 000)	(372)	(390)	
Jenoptik AG	(143)	(5 200)	(5 286)	
Kapsch TrafficCom AG	(21)	(421)	(343)	
Konica Minolta Inc.	(1 200)	(6 526)	(6 494)	
Kyosan Electric Manufacturing Co., Ltd.	(200)	(947)	(826)	
Lime Technologies AB	(148)	(4 873)	(4 427)	
Link Administration Holdings Ltd.	(94)	(373)	(171)	
Manz AG	(100)	(6 540)	(3 044)	
Matrix IT Ltd.	(211)	(6 033)	(5 967)	
Meyer Burger Technology AG	(21 148)	(10 917)	(16 585)	
MIMAKI Engineering Co., Ltd.	(100)	(624)	(615)	
Netcompany Group A/S	(420)	(39 242)	(24 028)	
Nexi SpA	(6 316)	(87 227)	(67 277)	
NEXTDC Ltd.	(39)	(359)	(326)	
Nice Ltd., CAAE	(57)	(14 612)	(14 852)	
Nippon Chemi-Con Corp.	(200)	(3 391)	(3 198)	
Pexip Holding ASA	(1 043)	(5 255)	(1 836)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Pricer AB	(497)	(1 445)	(1 057)	
Pushpay Holdings Ltd.	(931)	(1 124)	(1 021)	
PVA TePla AG	(8)	(342)	(215)	
Rakus Co., Ltd.	(100)	(4 205)	(1 627)	
Restar Holdings Corp.	(100)	(2 101)	(2 113)	
RTX A/S	(154)	(5 492)	(3 528)	
SAES Getters SpA	(100)	(3 549)	(3 413)	
Sakura Internet Inc.	(500)	(4 460)	(2 557)	
Sapiens International Corp. NV, NASD	(339)	(8 000)	(8 488)	
SCSK Corp.	(100)	(2 084)	(2 055)	
Secunet Security Networks AG	(6)	(3 816)	(1 704)	
SEMITEC Corp.	(100)	(9 290)	(8 831)	
SHIFT Inc.	(100)	(19 968)	(23 968)	
SimCorp A/S	(481)	(57 174)	(44 728)	
Sinch AB	(1 682)	(25 252)	(8 362)	
Smart Eye AB	(12)	(325)	(72)	
SMART Global Holdings Inc.	(16)	(354)	(323)	
Softwareone Holding AG	(127)	(2 454)	(2 438)	
Systemsoft Corp.	(2 300)	(5 407)	(2 197)	
Tazmo Co., Ltd.	(100)	(1 715)	(1 603)	
TietoEVRY Oyj	(282)	(10 262)	(10 815)	
Tokyo Electron Device Ltd.	(100)	(6 838)	(6 850)	
Traffic Systems SE	(31)	(969)	(1 141)	
Tyro Payments Ltd.	(2 195)	(2 937)	(2 854)	
User Local Inc.	(100)	(1 659)	(1 314)	
Xero Ltd.	(106)	(6 929)	(6 844)	
		(539 059)	(444 431)	(2,14)
Services de communication (31 décembre 2021 : -1,54 %)				
1&1 AG	(429)	(8 173)	(7 196)	
Adevinta ASA	(2 058)	(24 545)	(18 569)	
Adways Inc.	(200)	(1 102)	(1 027)	
Bambuser AB	(279)	(532)	(134)	
Bittium Oyj	(136)	(1 291)	(782)	
Borussia Dortmund GmbH & Co KGaA	(730)	(3 896)	(3 910)	
Bredband2 i Skandinavien AB	(2 923)	(526)	(515)	
Chorus Ltd.	(224)	(1 295)	(1 566)	
COOKPAD Inc.	(100)	(285)	(201)	
CyberAgent Inc.	(500)	(8 362)	(5 997)	
Domain Holdings Australia Ltd.	(4 244)	(11 471)	(10 568)	
Drecom Co., Ltd.	(400)	(3 043)	(3 298)	
FAN Communications Inc.	(600)	(2 211)	(2 508)	
Gree Inc.	(1 200)	(12 572)	(8 577)	
Grupo Televisa SAB	(2 024)	(23 903)	(12 506)	
Gurunavi Inc.	(1 400)	(5 775)	(5 636)	
I-mobile Co., Ltd.	(100)	(1 200)	(1 196)	
Infrastrutture Wireless Italiane SpA	(959)	(12 143)	(13 055)	
Japan Communications Inc.	(200)	(375)	(450)	
J-Stream Inc.	(200)	(4 458)	(1 150)	
Kadokawa Corp.	(600)	(19 036)	(14 788)	
Kahoot! ASA	(2 060)	(10 564)	(5 507)	
KLab Inc.	(1 000)	(4 700)	(4 436)	
Link-U Inc.	(200)	(1 695)	(2 048)	
MFE-MediaForEurope NV, cat. A	(2 259)	(1 000)	(1 181)	
MFE-MediaForEurope NV, cat. B	(307)	(367)	(249)	
Mobile TeleSystems PJSC	(1 375)	(12 856)	-	
MTI Ltd.	(300)	(2 268)	(1 584)	
Nippon BS Broadcasting Corp.	(200)	(1 818)	(1 859)	
Nippon Television Holdings Inc.	(100)	(1 164)	(1 070)	
NOS SGPS SA	(2 682)	(13 504)	(14 676)	
Orange SA	(2 019)	(27 493)	(27 028)	
ProSiebenSat.1 Media SE	(976)	(11 983)	(11 785)	
ReWorld Media SA	(100)	(740)	(840)	
Rizzoli Corriere Della Sera Mediagroup SpA	(436)	(415)	(423)	
RPA Holdings Inc.	(1 100)	(4 558)	(3 027)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
RTL Group SA	(159)	(8 450)	(9 068)	
Sea Ltd.	(304)	(23 469)	(21 432)	
SEEK Ltd.	(469)	(13 303)	(9 028)	
Septeni Holdings Co., Ltd.	(200)	(1 164)	(707)	
Southern Cross Media Group Ltd.	(4 661)	(3 987)	(4 561)	
Spark New Zealand Ltd.	(602)	(2 452)	(2 786)	
Stillfront Group AB	(767)	(3 001)	(1 747)	
Storytel AB	(301)	(9 035)	(1 731)	
Stroeer SE & Co KGaA	(15)	(1 382)	(945)	
TBS Holdings Inc.	(300)	(4 688)	(4 720)	
Telecom Argentina SA	(1 574)	(8 796)	(11 623)	
Telenor ASA	(1 295)	(21 950)	(16 316)	
TIM SA	(97)	(1 554)	(1 532)	
Tow Co., Ltd.	(700)	(2 054)	(2 085)	
TV Asahi Holdings Corp.	(400)	(5 477)	(5 504)	
United Internet AG	(46)	(1 866)	(1 257)	
Vodafone Group PLC	(1 146)	(21 506)	(15 714)	
		(375 453)	(300 098)	(1,44)
Services publics (31 décembre 2021 : -0,61 %)				
APA Group	(16)	(138)	(158)	
Ascopiave SpA	(932)	(5 056)	(3 228)	
Central Puerto SA	(782)	(4 662)	(6 294)	
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	(57)	(828)	(823)	
E.ON SE	(3 656)	(41 310)	(49 348)	
Elmera Group ASA	(559)	(1 673)	(1 229)	
Enel SpA	(103)	(704)	(749)	
Fortum Oyj	(6)	(117)	(135)	
Genesis Energy Ltd.	(210)	(501)	(464)	
Grenergy Renovables SA	(8)	(339)	(321)	
Hera SpA	(3 914)	(13 972)	(14 258)	
Kyushu Electric Power Co Inc.	(200)	(1 815)	(1 528)	
Meridian Energy Ltd.	(111)	(486)	(498)	
Nippon Gas Co., Ltd.	(600)	(12 519)	(12 828)	
Orsted AS	(121)	(16 271)	(14 854)	
RENOVA Inc.	(100)	(4 041)	(2 422)	
RWE AG	(43)	(2 242)	(2 586)	
Scatec ASA	(767)	(16 005)	(8 292)	
Verbund AG	(3)	(406)	(341)	
West Holdings Corp.	(100)	(3 814)	(4 508)	
		(126 899)	(124 864)	(0,60)
Immobilier (31 décembre 2021 : -0,70 %)				
Abacus Property Group	(116)	(364)	(280)	
ADLER Group SA	(246)	(480)	(478)	
AFI Properties Ltd.	(47)	(4 021)	(1 877)	
Alony Hetz Properties & Investments Ltd.	(25)	(421)	(344)	
Altisource Portfolio Solutions SA	(122)	(1 652)	(1 564)	
Amot Investments Ltd.	(394)	(3 059)	(3 124)	
Argosy Property Ltd.	(726)	(902)	(725)	
Atenor	(158)	(13 076)	(11 059)	
Big Shopping Centers Ltd.	(89)	(14 645)	(12 303)	
Blue Square Real Estate Ltd.	(100)	(8 743)	(7 968)	
BWP Trust	(1 190)	(4 434)	(4 275)	
CA Immobilien Anlagen AG	(37)	(1 719)	(1 517)	
Castellum AB	(19)	(563)	(312)	
Centuria Office REIT	(1 683)	(2 450)	(2 366)	
Charter Hall Group	(1 710)	(18 062)	(18 824)	
Charter Hall Long Wale REIT	(1 119)	(5 398)	(4 555)	
Cofinimmo SA	(97)	(17 787)	(11 741)	
CRE Logistics REIT Inc.	(1)	(2 435)	(1 886)	
Cresud SACIF y A	(78)	(643)	(707)	
Cromwell Property Group	(3 063)	(2 693)	(1 886)	
Dear Life Co., Ltd.	(400)	(2 437)	(2 522)	
Deutsche Wohnen SE	(286)	(13 449)	(8 224)	
Dexus	(2 902)	(21 360)	(20 666)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Dexus Industria REIT	(1 064)	(2 468)	(2 835)	
Electra Real Estate Ltd.	(67)	(1 282)	(870)	
Goldcrest Co., Ltd.	(100)	(1 583)	(1 726)	
Goodman Group	(243)	(3 748)	(3 876)	
Grand City Properties SA	(17)	(382)	(226)	
Hamborner REIT AG	(434)	(5 231)	(4 224)	
Home Invest Belgium SA	(50)	(1 561)	(1 576)	
Hotel Property Investments Ltd.	(61)	(166)	(200)	
Ichigo Inc.	(100)	(305)	(293)	
Immobel SA	(233)	(24 574)	(15 162)	
Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA	(847)	(3 346)	(3 815)	
IMMOFINANZ AG	(534)	(8 849)	(8 973)	
Ingenia Communities Group	(827)	(3 545)	(3 397)	
IRSA Inversiones y Representaciones SA	(467)	(2 280)	(3 025)	
Isras Investment Co., Ltd.	(15)	(3 776)	(3 888)	
Japan Metropolitan Fund Invest	(7)	(7 359)	(7 526)	
JSB Co., Ltd.	(100)	(3 718)	(4 195)	
LEG Immobilien SE	(135)	(14 134)	(11 881)	
Lippo Malls Indonesia Retail Trust	(93)	(18)	(3)	
Mirvac Group	(13 034)	(32 883)	(25 516)	
Miyakoshi Holdings Inc.	(100)	(817)	(745)	
Mobimo Holding AG	(10)	(4 067)	(3 456)	
National Storage REIT	(6 239)	(7 558)	(13 300)	
Palace Capital PLC	(100)	(423)	(349)	
PEXA Group Ltd.	(12)	(133)	(132)	
Star Asia Investment Corp.	(4)	(2 632)	(2 267)	
Stendorren Fastigheter AB	(11)	(366)	(274)	
Stride Property Group	(203)	(357)	(247)	
TAG Immobilien AG	(205)	(5 953)	(1 792)	
Takara Leben Real Estate Investment Corp.	(1)	(1 294)	(1 021)	
Tosei Reit Investment Corp.	(2)	(3 187)	(2 738)	
Vital Healthcare Property Trust	(185)	(358)	(357)	
Wallenstam AB	(89)	(423)	(508)	
Warehouses De Pauw CVA	(16)	(793)	(618)	
		<u>(290 362)</u>	<u>(250 214)</u>	(1,21)
Total des actions étrangères – position vendeur		<u>(3 789 516)</u>	<u>(3 470 801)</u>	(16,70)
Commissions de courtage intégrées (note 3)		<u>(11 634)</u>		
Total des placements		<u>17 806 411</u>	<u>18 854 502</u>	90,73
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			26 488	0,12
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			(2 663)	(0,01)
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			335 931	1,62
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			(380 013)	(1,84)
Autres actifs, moins les passifs			<u>1 948 855</u>	9,38
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			<u>20 783 100</u>	100,00

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Contrats de change à terme (Annexe 1)

Au 31 décembre 2022

Contrepartie*	Code de devise	Montant vendu	Code de devise	Montant acheté	Date d'échéance	Plus-value (moins-value) latente \$
Banque Royale du Canada	SEK	(1 584 000)	USD	154 511	15 mars 2023	2 451
Banque Royale du Canada	USD	(109 986)	AUD	163 000	15 mars 2023	1 200
Banque Royale du Canada	USD	(415 302)	JPY	56 465 000	15 mars 2023	22 837
						26 488
Banque Royale du Canada	CAD	(473 000)	USD	347 739	15 mars 2023	(2 100)
Banque Royale du Canada	USD	(132 990)	GBP	110 000	15 mars 2023	(563)
						(2 663)
						23 825

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

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 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				
Swaps d'actions – position acheteur				
Dollar australien – taux de swap des acceptations bancaires (BBSW) à 1 mois				
5 207	31 juill. 2023	Agl Energy Ltd, swap sur rendement total	38 611	433
1 022	31 juill. 2023	Allkem Ltd, swap sur rendement total	10 555	(2 297)
837	31 juill. 2023	Ampol Ltd, swap sur rendement total	21 750	(397)
3 062	31 juill. 2023	Arafura Resources Ltd, swap sur rendement total	1 308	40
3 255	31 juill. 2023	Ardent Leisure Group Ltd, swap sur rendement total	1 809	26
160	31 juill. 2023	Arena Reit, swap sur rendement total	569	(5)
463	31 juill. 2023	Aristocrat Leisure Ltd, swap sur rendement total	12 984	(1 854)
1 081	31 juill. 2023	Atlas Arteria, swap sur rendement total	6 566	(434)
82	31 juill. 2023	Australian Unity Office Fund, swap sur rendement total	121	–
4 390	31 juill. 2023	Base Resources Ltd, swap sur rendement total	908	97
1 117	31 juill. 2023	Beacon Lighting Group Ltd, swap sur rendement total	2 186	200
2 403	31 juill. 2023	Boss Energy Ltd, swap sur rendement total	4 703	(704)
555	31 juill. 2023	Brickworks Ltd, swap sur rendement total	11 306	(154)
618	31 juill. 2023	Capricorn Metals Ltd, swap sur rendement total	2 612	147
4 693	31 juill. 2023	Chalice Mining Ltd, swap sur rendement total	27 167	3 125
1 365	31 juill. 2023	Computershare Ltd, swap sur rendement total	32 861	(2 126)
311	31 juill. 2023	De Grey Mining Ltd, swap sur rendement total	367	(4)
1 056	31 juill. 2023	Downer Edi Ltd, swap sur rendement total	3 600	(1 412)
49	31 juill. 2023	Elders Ltd, swap sur rendement total	457	(6)
8 254	31 juill. 2023	Elixir Energy Ltd, swap sur rendement total	1 138	(269)
183	31 juill. 2023	Eml Payments Ltd, swap sur rendement total	106	(2)
1 081	31 juill. 2023	Estia Health Ltd, swap sur rendement total	2 056	(43)
358	31 juill. 2023	Event Hospitality And Entert, swap sur rendement total	4 188	(310)
276	31 juill. 2023	Evolution Mining Ltd, swap sur rendement total	756	13
2 875	31 juill. 2023	Firefinch Ltd, swap sur rendement total	528	(1)
226	31 juill. 2023	Fleetwood Corp Ltd, swap sur rendement total	295	(24)
6 139	31 juill. 2023	Grange Resources Ltd, swap sur rendement total	4 767	469
3 328	31 juill. 2023	Horizon Oil Ltd, swap sur rendement total	398	(16)
425	31 juill. 2023	Infomedia Ltd, swap sur rendement total	467	34
350	31 juill. 2023	Invocare Ltd, swap sur rendement total	3 547	(59)
593	31 juill. 2023	Ive Group Ltd, swap sur rendement total	1 280	(35)
21	31 juill. 2023	Jb Hi-Fi Ltd, swap sur rendement total	809	(56)
127	31 juill. 2023	Jumbo Interactive Ltd, swap sur rendement total	1 631	(9)
890	31 juill. 2023	Karoon Energy Ltd, swap sur rendement total	1 791	(104)
1 014	31 juill. 2023	Lendlease Group, swap sur rendement total	7 305	200
12 519	31 juill. 2023	Liontown Resources Ltd, swap sur rendement total	15 184	(7 126)
348	31 juill. 2023	Lottery Corp Ltd The, swap sur rendement total	1 433	1 433
17	31 juill. 2023	Macquarie Group Ltd, swap sur rendement total	2 608	(140)
787	31 juill. 2023	Medibank Private Ltd, swap sur rendement total	2 133	9
187	31 juill. 2023	Mineral Resources Ltd, swap sur rendement total	13 265	(1 843)
16	31 juill. 2023	Monadelphous Group Ltd, swap sur rendement total	196	(5)
879	31 juill. 2023	Monash Ivf Group Ltd, swap sur rendement total	771	(38)
3 901	31 juill. 2023	Mount Gibson Iron Ltd, swap sur rendement total	1 738	72
213	31 juill. 2023	Nanosonics Ltd, swap sur rendement total	840	(89)
183	31 juill. 2023	Nearmap Ltd, swap sur rendement total	353	(1)
1 167	31 juill. 2023	Neometals Ltd, swap sur rendement total	858	(217)
552	31 juill. 2023	Neuren Pharmaceuticals Ltd, swap sur rendement total	4 032	(31)
743	31 juill. 2023	New Century Resources Ltd, swap sur rendement total	580	(128)
2 496	31 juill. 2023	New Hope Corp Ltd, swap sur rendement total	14 586	895
86	31 juill. 2023	Nib Holdings Ltd, swap sur rendement total	612	24
15 346	31 juill. 2023	Nickel Mines Ltd, swap sur rendement total	13 678	(111)
157	31 juill. 2023	Nitro Software Ltd, swap sur rendement total	320	14
6 273	31 juill. 2023	Origin Energy Ltd, swap sur rendement total	44 498	(468)
1 135	31 juill. 2023	Pantoro Ltd, swap sur rendement total	100	(17)
1 231	31 juill. 2023	Perseus Mining Ltd, swap sur rendement total	2 387	(144)
3 541	31 juill. 2023	Pinnacle Investment Manageme, swap sur rendement total	28 405	108
282	31 juill. 2023	Premier Investments Ltd, swap sur rendement total	6 436	(140)
101	31 juill. 2023	Pro Medicus Ltd, swap sur rendement total	5 128	(395)
3 888	31 juill. 2023	Qantas Airways Ltd, swap sur rendement total	21 471	(880)
4 226	31 juill. 2023	Red 5 Ltd, swap sur rendement total	796	173
1 683	31 juill. 2023	Regis Healthcare Ltd, swap sur rendement total	2 915	(108)
625	31 juill. 2023	Ridley Corp Ltd, swap sur rendement total	1 137	28
834	31 juill. 2023	Rural Funds Group, swap sur rendement total	1 870	(214)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
1 893	31 juill. 2023	Sandfire Resources NI, swap sur rendement total	9 462	412
6 341	31 juill. 2023	Santos Ltd, swap sur rendement total	41 601	(1 603)
15 879	31 juill. 2023	Seven West Media Ltd, swap sur rendement total	5 763	(235)
1 832	31 juill. 2023	Sg Fleet Group Ltd, swap sur rendement total	3 081	101
860	31 juill. 2023	Smartgroup Corp Ltd, swap sur rendement total	4 030	220
5 155	31 juill. 2023	Srg Global Ltd, swap sur rendement total	3 268	(7)
167	31 juill. 2023	Steadfast Group Ltd, swap sur rendement total	839	20
967	31 juill. 2023	Tabcorp Holdings Ltd, swap sur rendement total	955	11
466	31 juill. 2023	Ten Sixty Four Ltd, swap sur rendement total	274	36
7 965	31 juill. 2023	Warrego Energy Ltd, swap sur rendement total	2 269	398
139	31 juill. 2023	Webjet Ltd, swap sur rendement total	789	(26)
1 208	31 juill. 2023	Westgold Resources Ltd, swap sur rendement total	971	101
3 054	31 juill. 2023	Whitehaven Coal Ltd, swap sur rendement total	26 434	(1 879)
				<u>(17 327)</u>
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
617	31 juill. 2023	Abrdn Plc, swap sur rendement total	1 903	(26)
2 696	31 juill. 2023	Airtel Africa Plc, swap sur rendement total	4 913	(518)
615	31 juill. 2023	Alfa Financial Software Hold, swap sur rendement total	1 664	41
1 103	31 juill. 2023	Anglo American Plc, swap sur rendement total	58 184	(3 203)
923	31 juill. 2023	Antofagasta Plc, swap sur rendement total	23 250	2 000
427	31 juill. 2023	Ashtead Group Plc, swap sur rendement total	32 849	(1 333)
46	31 juill. 2023	Asos Plc, swap sur rendement total	383	(92)
102	31 juill. 2023	Associated British Foods Plc, swap sur rendement total	2 670	(11)
3 690	31 juill. 2023	Auto Trader Group Plc, swap sur rendement total	31 009	(2 981)
808	31 juill. 2023	Aviva Plc, swap sur rendement total	5 831	(74)
857	31 juill. 2023	Bakkavor Group Plc, swap sur rendement total	1 342	57
256	31 juill. 2023	Bank Of Georgia Group Plc, swap sur rendement total	10 869	288
502	31 juill. 2023	Barratt Developments Plc, swap sur rendement total	3 247	(73)
104	31 juill. 2023	Beazley Plc, swap sur rendement total	1 152	47
603	31 juill. 2023	Bhp Group Ltd-Di, swap sur rendement total	25 258	(161)
196	31 juill. 2023	Bodycote Plc, swap sur rendement total	1 816	(72)
124	31 juill. 2023	Britvic Plc, swap sur rendement total	1 613	(18)
846	31 juill. 2023	Brown (N) Group Plc, swap sur rendement total	345	13
1 044	31 juill. 2023	Burberry Group Plc, swap sur rendement total	34 823	(1 745)
2 075	31 juill. 2023	Burford Capital Ltd, swap sur rendement total	22 558	(2 886)
789	31 juill. 2023	Centamin Plc, swap sur rendement total	1 452	74
717	31 juill. 2023	Ceres Power Holdings Plc, swap sur rendement total	4 098	(403)
804	31 juill. 2023	Compass Group Plc, swap sur rendement total	25 127	528
253	31 juill. 2023	Convatec Group Plc, swap sur rendement total	959	9
50	31 juill. 2023	Craneware Plc, swap sur rendement total	1 479	(277)
29	31 juill. 2023	Cvs Group Plc, swap sur rendement total	915	(43)
34	31 juill. 2023	Derwent London Plc, swap sur rendement total	1 312	14
912	31 juill. 2023	Devro Plc, swap sur rendement total	4 621	58
52	31 juill. 2023	Diageo Plc, swap sur rendement total	3 093	(98)
181	31 juill. 2023	Diploma Plc, swap sur rendement total	8 189	(93)
244	31 juill. 2023	Drax Group Plc, swap sur rendement total	2 796	374
787	31 juill. 2023	Entain Plc, swap sur rendement total	16 951	(1 036)
598	31 juill. 2023	Equals Group Plc, swap sur rendement total	872	(17)
252	31 juill. 2023	Experian Plc, swap sur rendement total	11 554	(154)
174	31 juill. 2023	Fdm Group Holdings Plc, swap sur rendement total	2 124	34
445	31 juill. 2023	Ferguson Plc, swap sur rendement total	75 726	7 562
908	31 juill. 2023	Finsbury Food Group Plc, swap sur rendement total	1 362	60
2 462	31 juill. 2023	Firstgroup Plc, swap sur rendement total	4 053	(54)
2 667	31 juill. 2023	Glencore Plc, swap sur rendement total	24 012	(402)
64	31 juill. 2023	Greggs Plc, swap sur rendement total	2 447	19
1 505	31 juill. 2023	Halfords Group Plc, swap sur rendement total	5 200	410
215	31 juill. 2023	Halma Plc, swap sur rendement total	6 945	(668)
13 832	31 juill. 2023	Hammerson Plc, swap sur rendement total	5 366	(76)
3 204	31 juill. 2023	Harbour Energy Plc, swap sur rendement total	15 896	(764)
1 128	31 juill. 2023	Hargreaves Lansdown Plc, swap sur rendement total	15 741	192
427	31 juill. 2023	Hiscox Ltd, swap sur rendement total	7 582	592
496	31 juill. 2023	Hostelworld Group Plc, swap sur rendement total	931	99
245	31 juill. 2023	Hunting Plc, swap sur rendement total	1 330	224
434	31 juill. 2023	Ig Group Holdings Plc, swap sur rendement total	5 532	(271)
247	31 juill. 2023	Imperial Brands Plc, swap sur rendement total	8 337	(39)
64	31 juill. 2023	Inchcape Plc, swap sur rendement total	855	(13)
679	31 juill. 2023	Indivior Plc, swap sur rendement total	20 496	1 454
4 317	31 juill. 2023	Informa Plc, swap sur rendement total	43 596	281

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
280	31 juill. 2023	Intercontinental Hotels Grou, swap sur rendement total	21 650	(305)
57	31 juill. 2023	Intertek Group Plc, swap sur rendement total	3 748	34
1 773	31 juill. 2023	Investec Plc, swap sur rendement total	15 168	318
1 603	31 juill. 2023	Iqe Plc, swap sur rendement total	1 297	(56)
2 221	31 juill. 2023	Iwg Plc, swap sur rendement total	6 009	229
62	31 juill. 2023	Johnson Matthey Plc, swap sur rendement total	2 172	56
18 402	31 juill. 2023	Just Group Plc, swap sur rendement total	24 474	2 220
1 188	31 juill. 2023	Kainos Group Plc, swap sur rendement total	29 877	(1 111)
567	31 juill. 2023	Keller Group Plc, swap sur rendement total	7 393	602
79	31 juill. 2023	Keywords Studios Plc, swap sur rendement total	3 507	(301)
574	31 juill. 2023	Kingfisher Plc, swap sur rendement total	2 209	(78)
67	31 juill. 2023	Land Securities Group Plc, swap sur rendement total	688	16
2 409	31 juill. 2023	Learning Technologies Group, swap sur rendement total	4 531	(633)
14	31 juill. 2023	Liontrust Asset Management, swap sur rendement total	261	7
41	31 juill. 2023	London Stock Exchange Group, swap sur rendement total	4 769	(863)
415	31 juill. 2023	Londonmetric Property Plc, swap sur rendement total	1 181	(24)
853	31 juill. 2023	Lookers Plc, swap sur rendement total	1 059	(33)
376	31 juill. 2023	Man Group Plc/Jersey, swap sur rendement total	1 310	25
264	31 juill. 2023	Marston'S Plc, swap sur rendement total	170	8
1 193	31 juill. 2023	Mitchells & Butlers Plc, swap sur rendement total	2 683	(24)
1 579	31 juill. 2023	Moneysupermarket.Com, swap sur rendement total	4 952	41
1 662	31 juill. 2023	Morgan Advanced Materials Pl, swap sur rendement total	8 519	316
560	31 juill. 2023	Morgan Sindall Group Plc, swap sur rendement total	13 965	(806)
1 308	31 juill. 2023	National Grid Plc, swap sur rendement total	21 644	261
183	31 juill. 2023	Natwest Group Plc, swap sur rendement total	791	6
504	31 juill. 2023	Ncc Group Plc, swap sur rendement total	1 643	(104)
442	31 juill. 2023	Ninety One Plc, swap sur rendement total	1 339	(98)
1 529	31 juill. 2023	Onesavings Bank Plc, swap sur rendement total	11 957	55
428	31 juill. 2023	Oxford Instruments Plc, swap sur rendement total	15 797	693
2 936	31 juill. 2023	Pan African Resources Plc, swap sur rendement total	791	(58)
786	31 juill. 2023	Pearson Plc, swap sur rendement total	12 032	(713)
3 527	31 juill. 2023	Pendragon Plc, swap sur rendement total	1 104	(447)
124	31 juill. 2023	Persimmon Plc, swap sur rendement total	2 460	(91)
5 801	31 juill. 2023	Premier Foods Plc, swap sur rendement total	10 268	373
2 437	31 juill. 2023	Primary Health Properties, swap sur rendement total	4 401	(34)
530	31 juill. 2023	Provident Financial Plc, swap sur rendement total	1 652	(57)
606	31 juill. 2023	Puretech Health Plc, swap sur rendement total	2 632	(155)
1 770	31 juill. 2023	Rank Group Plc, swap sur rendement total	2 363	(255)
58	31 juill. 2023	Reach Plc, swap sur rendement total	90	(14)
12	31 juill. 2023	Reckitt Benckiser Group Plc, swap sur rendement total	1 125	(51)
132	31 juill. 2023	Renewi Plc, swap sur rendement total	1 287	94
52	31 juill. 2023	Renishaw Plc, swap sur rendement total	3 109	(25)
18 556	31 juill. 2023	Rolls-Royce Holdings Plc, swap sur rendement total	28 187	782
3 154	31 juill. 2023	Royal Mail Plc, swap sur rendement total	10 949	(721)
44	31 juill. 2023	Safestore Holdings Plc, swap sur rendement total	678	25
5 569	31 juill. 2023	Schroders Plc, swap sur rendement total	39 575	(699)
1 172	31 juill. 2023	Segro Plc, swap sur rendement total	14 586	(507)
2 204	31 juill. 2023	Serco Group Plc, swap sur rendement total	5 582	(562)
71	31 juill. 2023	Severn Trent Plc, swap sur rendement total	3 117	(42)
293	31 juill. 2023	Sirius Real Estate Ltd, swap sur rendement total	354	(35)
104	31 juill. 2023	Smiths Group Plc, swap sur rendement total	2 710	(412)
2 745	31 juill. 2023	Solgold Plc, swap sur rendement total	716	(70)
763	31 juill. 2023	Somero Enterprises Inc, actions ord., swap sur rendement total	4 663	(8)
21	31 juill. 2023	Spirax-Sarco Engineering Plc, swap sur rendement total	3 633	(165)
2 121	31 juill. 2023	Spire Healthcare Group Plc, swap sur rendement total	7 882	(87)
3 443	31 juill. 2023	Spirent Communications Plc, swap sur rendement total	14 601	(1 208)
1 207	31 juill. 2023	Sse Plc, swap sur rendement total	33 679	(12)
1 241	31 juill. 2023	Ssp Group Plc, swap sur rendement total	4 632	295
1 017	31 juill. 2023	Taylor Wimpey Plc, swap sur rendement total	1 685	(5)
8 919	31 juill. 2023	Tesco Plc, swap sur rendement total	32 592	(445)
127	31 juill. 2023	Tp Icap Plc, swap sur rendement total	361	(2)
6 607	31 juill. 2023	Tullow Oil Plc, swap sur rendement total	3 976	(753)
438	31 juill. 2023	Tyman Plc, swap sur rendement total	1 610	17
641	31 juill. 2023	Unite Group Plc/The, swap sur rendement total	9 507	(181)
194	31 juill. 2023	United Utilities Group Plc, swap sur rendement total	3 183	(82)
1 571	31 juill. 2023	Vertu Motors Plc, swap sur rendement total	1 401	170
190	31 juill. 2023	Vistry Group Plc, swap sur rendement total	1 937	32
108	31 juill. 2023	Weir Group Plc/The, swap sur rendement total	2 938	(169)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
498	31 juill. 2023	Wh Smith Plc, swap sur rendement total	12 049	544
292	31 juill. 2023	Wincanton Plc, swap sur rendement total	1 604	(167)
43	31 juill. 2023	Wizz Air Holdings Plc, swap sur rendement total	1 335	(289)
312	31 juill. 2023	Wpp Plc, swap sur rendement total	4 171	(98)
230	31 juill. 2023	Xp Power Ltd, swap sur rendement total	7 707	362
				<u>(8 645)</u>
Euro – taux à court terme (ESTR)				
37	31 juill. 2023	Aalberts Nv, swap sur rendement total	1 938	(76)
2	31 juill. 2023	Adidas Ag, swap sur rendement total	369	18
1 730	31 juill. 2023	Aib Group Plc, swap sur rendement total	9 046	1 187
333	31 juill. 2023	Air Liquide Sa, swap sur rendement total	63 756	(2 895)
614	31 juill. 2023	Airbus Se, swap sur rendement total	98 573	706
1 843	31 juill. 2023	Alstom, swap sur rendement total	60 818	(4 755)
57	31 juill. 2023	Argenx Se, swap sur rendement total	28 709	(3 299)
25	31 juill. 2023	Aubay, swap sur rendement total	1 762	(43)
490	31 juill. 2023	Axa Sa, swap sur rendement total	18 462	(678)
293	31 juill. 2023	Bank Of Ireland Group Plc, swap sur rendement total	3 771	(31)
1	31 juill. 2023	Bawag Group Ag, swap sur rendement total	72	1
207	31 juill. 2023	Beneteau, swap sur rendement total	4 233	949
66	31 juill. 2023	Bouygues Sa, swap sur rendement total	2 676	(119)
9	31 juill. 2023	Brenntag Ag, swap sur rendement total	777	21
960	31 juill. 2023	Bureau Veritas Sa, swap sur rendement total	34 164	(597)
3 331	31 juill. 2023	Caixabank Sa, swap sur rendement total	17 688	709
53	31 juill. 2023	Cappgemini Se, swap sur rendement total	11 952	(124)
9	31 juill. 2023	Cargotec Oyj, actions, B, swap sur rendement total	538	23
31	31 juill. 2023	Commerzbank Ag, swap sur rendement total	396	36
511	31 juill. 2023	Compagnie De Saint Gobain, swap sur rendement total	33 733	1 147
100	31 juill. 2023	Compagnie Des Alpes, swap sur rendement total	2 079	52
612	31 juill. 2023	Danone, swap sur rendement total	43 568	(757)
16	31 juill. 2023	Dassault Aviation Sa, swap sur rendement total	3 660	158
247	31 juill. 2023	Derichebourg, swap sur rendement total	1 972	144
57	31 juill. 2023	Deutsche Bank Ag, actions nominatives, swap sur rendement total	873	38
77	31 juill. 2023	Deutsche Lufthansa, actions ord., swap sur rendement total	865	11
56	31 juill. 2023	Deutsche Post Ag, actions ord., swap sur rendement total	2 849	(148)
32	31 juill. 2023	Deutsche Telekom Ag, actions ord., swap sur rendement total	862	(53)
29	31 juill. 2023	Duerr Ag, swap sur rendement total	1 322	(32)
64	31 juill. 2023	Eckert & Ziegler Strahlen Un, swap sur rendement total	4 294	(620)
71	31 juill. 2023	Enagas Sa, swap sur rendement total	1 594	(177)
138	31 juill. 2023	Erste Group Bank Ag, swap sur rendement total	5 967	118
23	31 juill. 2023	Esker Sa, swap sur rendement total	5 232	206
30	31 juill. 2023	Essilorluxottica, swap sur rendement total	7 340	(408)
60	31 juill. 2023	Esso Sté Anonyme Française, swap sur rendement total	4 095	(424)
671	31 juill. 2023	Faurecia, swap sur rendement total	13 711	(1 599)
92	31 juill. 2023	Flatex Ag, swap sur rendement total	842	(504)
606	31 juill. 2023	F-Secure Corp, swap sur rendement total	2 480	(187)
360	31 juill. 2023	Getlink Se, swap sur rendement total	7 796	(470)
378	31 juill. 2023	Glanbia Plc, swap sur rendement total	6 516	172
43	31 juill. 2023	Groupe Crit, swap sur rendement total	3 793	(67)
5	31 juill. 2023	Groupe Ldlc, swap sur rendement total	150	(6)
34	31 juill. 2023	Guerbet, swap sur rendement total	834	19
29	31 juill. 2023	Hermès International, swap sur rendement total	60 598	(4 197)
32	31 juill. 2023	Iberdrola Sa, swap sur rendement total	506	6
24	31 juill. 2023	Id Logistics Group, swap sur rendement total	9 301	106
113	31 juill. 2023	Indra Sistemas Sa, swap sur rendement total	1 740	132
312	31 juill. 2023	Industria De Diseno Textil, swap sur rendement total	11 212	(18)
26	31 juill. 2023	Infineon Technologies Ag, swap sur rendement total	1 069	(115)
232	31 juill. 2023	Ing Groep Nv, swap sur rendement total	3 821	(30)
28	31 juill. 2023	Ipsen, swap sur rendement total	4 069	(159)
100	31 juill. 2023	Jacquet Metal Service Sa, swap sur rendement total	2 418	81
266	31 juill. 2023	Kbc Group Nv, swap sur rendement total	23 110	2 689
72	31 juill. 2023	Kering, swap sur rendement total	49 508	(4 044)
4	31 juill. 2023	Kinopolis, swap sur rendement total	224	(1)
5	31 juill. 2023	Kion Group Ag, swap sur rendement total	194	(3)
62	31 juill. 2023	Klepierre, swap sur rendement total	1 930	(30)
511	31 juill. 2023	Koninklijke Ahold Delhaize N, swap sur rendement total	19 833	(740)
71	31 juill. 2023	Koninklijke Kpn Nv, swap sur rendement total	297	(51)
1 554	31 juill. 2023	Koninklijke Philips Nv, swap sur rendement total	31 470	(231)
24	31 juill. 2023	Legrand Sa, swap sur rendement total	2 597	(168)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
64	31 juill. 2023	L'Oréal, swap sur rendement total	30 874	(400)
16	31 juill. 2023	Lvmh Moet Hennessy Louis Vui, swap sur rendement total	15 731	(1 199)
169	31 juill. 2023	Maurel Et Prom, swap sur rendement total	981	(28)
25	31 juill. 2023	Mersen, swap sur rendement total	1 365	32
50	31 juill. 2023	Mlp Se, swap sur rendement total	372	(12)
10	31 juill. 2023	Naturgy Energy Group Sa, swap sur rendement total	352	(37)
166	31 juill. 2023	Neoen Sa, swap sur rendement total	9 028	(135)
188	31 juill. 2023	Nexans Sa, swap sur rendement total	22 959	61
13	31 juill. 2023	Nokia Oyj, swap sur rendement total	81	(6)
38	31 juill. 2023	Nordex Se, swap sur rendement total	725	64
137	31 juill. 2023	Norma Group Se, swap sur rendement total	3 368	18
30	31 juill. 2023	Oci Nv, swap sur rendement total	1 450	(315)
22	31 juill. 2023	Olvi Oyj, actions, A, swap sur rendement total	1 055	24
217	31 juill. 2023	Ordina Nv, swap sur rendement total	1 216	(30)
292	31 juill. 2023	Origin Enterprises Plc, swap sur rendement total	1 820	163
1	31 juill. 2023	Porsche Automobil Hldg, actions priv., swap sur rendement total	74	(10)
558	31 juill. 2023	Postnl Nv, swap sur rendement total	1 372	(56)
100	31 juill. 2023	Prodways Group Sa, swap sur rendement total	479	(60)
257	31 juill. 2023	Prosus Nv, swap sur rendement total	23 952	701
378	31 juill. 2023	Raiffeisen Bank Internationa, swap sur rendement total	8 391	165
116	31 juill. 2023	Red Electrica Corporacion Sa, swap sur rendement total	2 728	(93)
530	31 juill. 2023	Redes Energeticas Nacionais, swap sur rendement total	1 931	(11)
8	31 juill. 2023	Rheinmetall Ag, swap sur rendement total	2 152	(163)
9	31 juill. 2023	Rothschild & Co, swap sur rendement total	486	(3)
176	31 juill. 2023	Schneider Electric Se, swap sur rendement total	33 269	(760)
383	31 juill. 2023	Scor Se, swap sur rendement total	11 902	1 763
49	31 juill. 2023	Siemens Ag, actions ord., swap sur rendement total	9 186	(121)
106	31 juill. 2023	Siemens Healthineers Ag, swap sur rendement total	7 163	(448)
2	31 juill. 2023	Sixt Se, swap sur rendement total	249	(23)
541	31 juill. 2023	Smpc Sa, swap sur rendement total	5 077	(229)
231	31 juill. 2023	Société Générale Sa, swap sur rendement total	7 843	236
25	31 juill. 2023	Sodexo Sa, swap sur rendement total	3 235	(93)
14	31 juill. 2023	Solaria Energia Y Medio Ambi, swap sur rendement total	347	1
2	31 juill. 2023	Stef, swap sur rendement total	262	17
762	31 juill. 2023	Stmicroelectronics Nv, swap sur rendement total	36 357	(3 449)
16	31 juill. 2023	Suess Microtec Se, swap sur rendement total	350	-
12	31 juill. 2023	Synergie Sa, swap sur rendement total	521	(15)
35	31 juill. 2023	Teleperformance, swap sur rendement total	11 271	105
32	31 juill. 2023	Tomtom, swap sur rendement total	300	(54)
214	31 juill. 2023	Tubacex Sa, swap sur rendement total	618	(9)
475	31 juill. 2023	Ubisoft Entertainment, swap sur rendement total	18 141	(229)
70	31 juill. 2023	Valeo Sa, swap sur rendement total	1 690	(109)
401	31 juill. 2023	Vallourec Sa, swap sur rendement total	7 115	669
50	31 juill. 2023	Valneva Se, swap sur rendement total	450	(4)
1 589	31 juill. 2023	Veolia Environnement, swap sur rendement total	55 147	(1 507)
52	31 juill. 2023	Vgp, swap sur rendement total	5 850	74
675	31 juill. 2023	Vinci Sa, swap sur rendement total	91 060	(3 217)
13	31 juill. 2023	Wacker Neuson Se, swap sur rendement total	307	(12)
177	31 juill. 2023	Wartsila Oyj Abp, swap sur rendement total	2 014	(97)
120	31 juill. 2023	Withsecure Oyj, swap sur rendement total	238	(4)
1	31 juill. 2023	Zalando Se, swap sur rendement total	48	5
				(27 967)
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
6 000	31 juill. 2023	Agile Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 406	(272)
600	31 juill. 2023	Aia Group Ltd, swap sur rendement total	9 041	485
4 000	31 juill. 2023	Ajisen China Holdings Ltd, swap sur rendement total	576	130
500	31 juill. 2023	Alibaba Group Holding Ltd, swap sur rendement total	7 487	522
3 200	31 juill. 2023	Anta Sports Products Ltd, swap sur rendement total	56 830	6 151
994	31 juill. 2023	Austar Lifesciences Ltd, swap sur rendement total	349	9
20 000	31 juill. 2023	Baic Motor Corp Ltd, H, swap sur rendement total	7 187	(236)
3 000	31 juill. 2023	Boe Varitronix Ltd, swap sur rendement total	7 729	370
321	31 juill. 2023	Byd Co Ltd, H, swap sur rendement total	10 733	(12)
5 996	31 juill. 2023	Chaowei Power Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 759	21
1 000	31 juill. 2023	China Aoyuan Group Ltd, swap sur rendement total	205	3
19	31 juill. 2023	China Dongxiang Group Co, swap sur rendement total	1	-
10 000	31 juill. 2023	China Electronics Huada Tech, swap sur rendement total	2 378	1 075
11 000	31 juill. 2023	China Evergrande New Energy, swap sur rendement total	6 111	(21)
4 012	31 juill. 2023	China Hongqiao Group Ltd, swap sur rendement total	5 133	81

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
1 000	31 juill. 2023	China Life Insurance Co, H, swap sur rendement total	2 326	163
3 000	31 juill. 2023	China Mengniu Dairy Co, swap sur rendement total	18 436	249
500	31 juill. 2023	China Merchants Bank, H, swap sur rendement total	3 789	281
1 000	31 juill. 2023	China Modern Dairy Holdings, swap sur rendement total	172	(1)
1 000	31 juill. 2023	China Overseas Land & Invest, swap sur rendement total	3 576	(100)
8 000	31 juill. 2023	China Resources Beer Holding, swap sur rendement total	75 759	1 036
1 800	31 juill. 2023	China Vanke Co Ltd, H, swap sur rendement total	4 937	(106)
1 501	31 juill. 2023	China Yongda Automobiles Ser, swap sur rendement total	1 511	246
4 000	31 juill. 2023	China Youzan Ltd, swap sur rendement total	136	15
4 000	31 juill. 2023	Chinasoft International Ltd, swap sur rendement total	4 715	81
1 000	31 juill. 2023	Chongqing Rural Commercial, H, swap sur rendement total	464	9
1 000	31 juill. 2023	Chow Sang Sang Hldg, swap sur rendement total	1 795	178
7 000	31 juill. 2023	Citic Dameng Holdings Ltd, swap sur rendement total	778	(27)
16	31 juill. 2023	Citic Resources Holdings Ltd, swap sur rendement total	1	–
1 500	31 juill. 2023	Clp Holdings Ltd, swap sur rendement total	14 830	41
2 000	31 juill. 2023	Cogobuy Group, swap sur rendement total	618	67
2 000	31 juill. 2023	Consun Pharmaceutical Group, swap sur rendement total	1 406	210
2 000	31 juill. 2023	Cosco Shipping Ports Ltd, swap sur rendement total	2 153	88
3 000	31 juill. 2023	Crystal International Group, swap sur rendement total	1 266	95
2 000	31 juill. 2023	Dah Sing Banking Group Ltd, swap sur rendement total	1 944	53
800	31 juill. 2023	Dfzq-H, swap sur rendement total	519	–
20 000	31 juill. 2023	Dongfeng Motor Grp Co Ltd, H, swap sur rendement total	15 555	313
9 999	31 juill. 2023	Dongyue Group, swap sur rendement total	14 911	(57)
2 400	31 juill. 2023	Dynam Japan Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	3 508	1 360
14 000	31 juill. 2023	Fit Hon Teng Ltd, swap sur rendement total	4 982	772
2 000	31 juill. 2023	Fufeng Group Ltd, swap sur rendement total	1 649	(75)
9 000	31 juill. 2023	Geely Automobile Holdings Lt, swap sur rendement total	17 811	(148)
6 000	31 juill. 2023	Genscript Biotech Corp, swap sur rendement total	25 884	5 222
7 000	31 juill. 2023	Grand Baoxin Auto Group Ltd, swap sur rendement total	541	16
4 000	31 juill. 2023	Haichang Ocean Park Holdings, swap sur rendement total	1 111	(1 140)
2 000	31 juill. 2023	Harbin Electric Co Ltd, H, swap sur rendement total	1 087	(56)
1 000	31 juill. 2023	Hisense Home Appliances Gr, H, swap sur rendement total	1 495	92
300	31 juill. 2023	Hong Kong Exchanges & Clear, swap sur rendement total	17 561	1 569
5 000	31 juill. 2023	Inke Ltd, swap sur rendement total	842	110
1 000	31 juill. 2023	Innocare Pharma Ltd, swap sur rendement total	2 368	518
1 500	31 juill. 2023	Innovent Biologics Inc, swap sur rendement total	8 723	930
214	31 juill. 2023	Jd.Com Inc, cat. A, swap sur rendement total	8 181	23
2 500	31 juill. 2023	Kingboard Holdings Ltd, swap sur rendement total	10 915	(235)
425	31 juill. 2023	Kingdee International Sftwr, swap sur rendement total	1 235	281
18 000	31 juill. 2023	Kunlun Energy Co Ltd, swap sur rendement total	17 405	(1 410)
18 000	31 juill. 2023	Lenovo Group Ltd, swap sur rendement total	20 030	(605)
6 500	31 juill. 2023	Li Ning Co Ltd, swap sur rendement total	76 450	7 083
100	31 juill. 2023	Meituan Dianping, cat. B, swap sur rendement total	3 033	175
3 000	31 juill. 2023	Modern Dental Group Ltd, swap sur rendement total	1 255	276
4 810	31 juill. 2023	Nvc Lighting Holdings Ltd, swap sur rendement total	79	(20)
2 000	31 juill. 2023	Oriental Watch Holdings, swap sur rendement total	1 444	(47)
4	31 juill. 2023	Pacific Basin Shipping Ltd, swap sur rendement total	2	–
7 000	31 juill. 2023	Perfect Shape Medical Ltd, swap sur rendement total	4 982	456
500	31 juill. 2023	Ping An Insurance Group Co, H, swap sur rendement total	4 483	323
13 000	31 juill. 2023	Postal Savings Bank Of Chi, H, swap sur rendement total	10 946	346
4	31 juill. 2023	Powerlong Real Estate Holdin, swap sur rendement total	1	–
4 000	31 juill. 2023	Pw Medtech Group Ltd, swap sur rendement total	437	(9)
9 600	31 juill. 2023	Samsonite International Sa, swap sur rendement total	34 248	(538)
1 600	31 juill. 2023	Shandong Molong Petroleum, H, swap sur rendement total	764	22
4 000	31 juill. 2023	Shanghai Fosun Pharmaceuti, H, swap sur rendement total	17 360	(618)
100	31 juill. 2023	Shenzhen International Group, swap sur rendement total	1 524	310
4 997	31 juill. 2023	Shimao Property Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 834	3 066
6 000	31 juill. 2023	Sinofert Holdings Ltd, swap sur rendement total	990	7
1 000	31 juill. 2023	Sino-Ocean Group Holding Ltd, swap sur rendement total	189	17
2 001	31 juill. 2023	Sinotruk Hong Kong Ltd, swap sur rendement total	3 779	251
2 800	31 juill. 2023	Sisram Medical Ltd, swap sur rendement total	4 336	439
1 000	31 juill. 2023	Site International Holdings, swap sur rendement total	3 014	30
2 000	31 juill. 2023	Skyworth Group Ltd, swap sur rendement total	1 163	135
500	31 juill. 2023	Stella International, swap sur rendement total	638	5
2 000	31 juill. 2023	Sun Art Retail Group Ltd, swap sur rendement total	889	157
11 000	31 juill. 2023	Sunac China Holdings Ltd, swap sur rendement total	8 746	4 090
100	31 juill. 2023	Sunny Optical Tech, swap sur rendement total	1 612	21
2 500	31 juill. 2023	Swire Pacific Ltd, cat. A, swap sur rendement total	29 816	3 228

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
9	31 juill. 2023	Tencent Holdings Ltd, swap sur rendement total	522	200
1 000	31 juill. 2023	Texhong Textile Group Ltd, swap sur rendement total	1 085	(27)
6	31 juill. 2023	Texwinca Holdings Ltd, swap sur rendement total	1	–
4 000	31 juill. 2023	Tianjin Development Hldgs Lt, swap sur rendement total	1 042	10
10 013	31 juill. 2023	Tianjin Port Dvlp Hlds Ltd, swap sur rendement total	991	30
30 000	31 juill. 2023	Tongda Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	672	13
1 000	31 juill. 2023	Towngas China Co Ltd, swap sur rendement total	681	60
2 000	31 juill. 2023	Truly International Holdings, swap sur rendement total	424	(50)
8 000	31 juill. 2023	Viva China Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 555	133
4 996	31 juill. 2023	Weiqiao Textile Co Ltd, H, swap sur rendement total	1 388	265
100	31 juill. 2023	Wuxi Apptec Co Ltd-H, swap sur rendement total	1 431	93
500	31 juill. 2023	Wuxi Biologics Cayman Inc, swap sur rendement total	5 195	822
16 000	31 juill. 2023	Xinyi Glass Holdings Ltd, swap sur rendement total	40 387	(1 314)
8 000	31 juill. 2023	Yadea Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	18 138	(2 334)
1 000	31 juill. 2023	Yuzhou Properties Co, swap sur rendement total	77	17
4 000	31 juill. 2023	Zhongsheng Group Holdings, swap sur rendement total	27 880	142
12 000	31 juill. 2023	Zijin Mining Group Co Ltd, H, swap sur rendement total	22 040	819
9 601	31 juill. 2023	Zte Corp-H, swap sur rendement total	28 668	332
				36 780
Yen japonais – taux moyen du financement à un jour offert à Tokyo (TONAR)				
100	31 juill. 2023	Aichi Tokei Denki Co Ltd, swap sur rendement total	1 371	(33)
100	31 juill. 2023	Aiming Inc, swap sur rendement total	414	4
200	31 juill. 2023	Airport Facilities Co Ltd, swap sur rendement total	1 068	(36)
500	31 juill. 2023	Aisan Industry Co Ltd, swap sur rendement total	3 548	(56)
300	31 juill. 2023	Allied Telesis Holdings Kk, swap sur rendement total	327	18
100	31 juill. 2023	Amano Corp, swap sur rendement total	2 498	(41)
100	31 juill. 2023	Amuse Inc, swap sur rendement total	1 797	(40)
64	31 juill. 2023	Ana Holdings Inc, swap sur rendement total	1 840	(95)
200	31 juill. 2023	Anest Iwata Corp, swap sur rendement total	1 770	(144)
300	31 juill. 2023	Arakawa Chemical Industries, swap sur rendement total	2 985	(80)
100	31 juill. 2023	Asahi Broadcasting Group Hol, swap sur rendement total	656	18
100	31 juill. 2023	Asahi Yukizai Corp, swap sur rendement total	2 876	151
900	31 juill. 2023	Asia Pile Holdings Corp, swap sur rendement total	5 009	57
1 698	31 juill. 2023	Astellas Pharma Inc, swap sur rendement total	34 987	(2 112)
200	31 juill. 2023	Bando Chemical Industries, swap sur rendement total	1 963	(88)
100	31 juill. 2023	Business Engineering Corp, swap sur rendement total	2 461	183
200	31 juill. 2023	Carlit Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 602	126
100	31 juill. 2023	Central Automotive Products, swap sur rendement total	2 523	72
800	31 juill. 2023	Chiyoda Corp, swap sur rendement total	2 949	(138)
200	31 juill. 2023	Chubu Electric Power Co Inc, swap sur rendement total	2 797	152
100	31 juill. 2023	Chuetsu Pulp & Paper Co Ltd, swap sur rendement total	985	11
100	31 juill. 2023	Cti Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	3 296	(46)
200	31 juill. 2023	Cts Co Ltd, swap sur rendement total	1 672	(41)
100	31 juill. 2023	Dai-Dan Co Ltd, swap sur rendement total	2 251	(7)
100	31 juill. 2023	Daido Steel Co Ltd, swap sur rendement total	4 431	(102)
1 000	31 juill. 2023	Daiichi Sankyo Co Ltd, swap sur rendement total	43 643	(2 665)
100	31 juill. 2023	Dainichi Co Ltd, swap sur rendement total	678	(21)
100	31 juill. 2023	Dainichiseika Color & Chem, swap sur rendement total	1 756	(7)
300	31 juill. 2023	Ehime Bank Ltd/The, swap sur rendement total	2 822	110
75	31 juill. 2023	Eisai Co Ltd, swap sur rendement total	6 704	(485)
300	31 juill. 2023	Fancel Corp, swap sur rendement total	8 281	388
100	31 juill. 2023	Fcc Co Ltd, swap sur rendement total	1 387	(76)
500	31 juill. 2023	Fujikura Kasei Co Ltd, swap sur rendement total	2 079	(20)
100	31 juill. 2023	Fujishoji Co Ltd, swap sur rendement total	1 269	234
100	31 juill. 2023	Fukui Bank Ltd/The, swap sur rendement total	1 545	45
200	31 juill. 2023	Furukawa Co Ltd, swap sur rendement total	2 598	(53)
200	31 juill. 2023	Furuno Electric Co Ltd, swap sur rendement total	1 990	(104)
100	31 juill. 2023	Furyu Corp, swap sur rendement total	1 118	(67)
300	31 juill. 2023	Futaba Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	1 097	(57)
100	31 juill. 2023	Godo Steel Ltd, swap sur rendement total	2 199	245
300	31 juill. 2023	Healios Kk, swap sur rendement total	826	(19)
200	31 juill. 2023	Hino Motors Ltd, swap sur rendement total	1 033	(235)
200	31 juill. 2023	H-One Co Ltd, swap sur rendement total	1 263	(65)
100	31 juill. 2023	Hyakujushi Bank Ltd/The, swap sur rendement total	1 964	121
100	31 juill. 2023	Icom Inc, swap sur rendement total	2 875	16
1 300	31 juill. 2023	Iino Kaiun Kaisha Ltd, swap sur rendement total	12 415	(39)
100	31 juill. 2023	I-Net Corp, swap sur rendement total	1 333	(7)
100	31 juill. 2023	Intelligent Wave Inc, swap sur rendement total	740	(84)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	31 juill. 2023	Isb Corp, swap sur rendement total	1 157	(183)
100	31 juill. 2023	Ise Chemicals Corp, swap sur rendement total	5 504	(41)
100	31 juill. 2023	Japan Transcity Corp, swap sur rendement total	525	10
100	31 juill. 2023	Jfe Systems Inc, swap sur rendement total	2 369	123
1 600	31 juill. 2023	Jvckenwood Corp, swap sur rendement total	6 063	(16)
700	31 juill. 2023	Jxtg Holdings Inc, swap sur rendement total	3 220	(109)
100	31 juill. 2023	Kakiyasu Honten Co Ltd, swap sur rendement total	2 139	(81)
100	31 juill. 2023	Kamei Corp, swap sur rendement total	1 254	21
200	31 juill. 2023	Kaneko Seeds Co Ltd, swap sur rendement total	2 941	6
200	31 juill. 2023	Kansai Paint Co Ltd, swap sur rendement total	3 325	(520)
100	31 juill. 2023	Kitagawa Corp, swap sur rendement total	1 174	(45)
100	31 juill. 2023	Kohsoku Corp, swap sur rendement total	1 776	(40)
200	31 juill. 2023	Kose Corp, swap sur rendement total	29 616	(155)
200	31 juill. 2023	Kuriyama Holdings Corp, swap sur rendement total	1 701	(136)
200	31 juill. 2023	Kyowa Leather Cloth Co Ltd, swap sur rendement total	1 023	(25)
100	31 juill. 2023	Lec Inc, swap sur rendement total	930	96
100	31 juill. 2023	Linical Co Ltd, swap sur rendement total	709	4
100	31 juill. 2023	M&A Capital Partners Co Ltd, swap sur rendement total	4 739	(246)
400	31 juill. 2023	Maewaza Industries Inc, swap sur rendement total	2 522	8
100	31 juill. 2023	Matsui Construction Co Ltd, swap sur rendement total	575	(2)
200	31 juill. 2023	Meiji Electric Industries Co, swap sur rendement total	2 165	28
100	31 juill. 2023	Meisei Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	805	62
100	31 juill. 2023	Micronics Japan Co Ltd, swap sur rendement total	1 337	(161)
1 300	31 juill. 2023	Mitsubishi Paper Mills Ltd, swap sur rendement total	3 778	54
100	31 juill. 2023	Moresco Corp, swap sur rendement total	1 199	58
100	31 juill. 2023	Mortgage Service Japan Ltd, swap sur rendement total	907	24
100	31 juill. 2023	Mrmx Holdings Ltd, swap sur rendement total	678	(2)
100	31 juill. 2023	Nakabayashi Co Ltd, swap sur rendement total	493	(19)
100	31 juill. 2023	Nichirin Co Ltd, swap sur rendement total	1 825	(114)
100	31 juill. 2023	Nihon Denkei Co Ltd, swap sur rendement total	1 521	26
200	31 juill. 2023	Nihon M&A Center Inc, swap sur rendement total	3 346	(417)
200	31 juill. 2023	Nihon Tokushu Toryo Co Ltd, swap sur rendement total	1 758	(32)
100	31 juill. 2023	Nippon Beet Sugar Mfg Co Ltd, swap sur rendement total	1 710	39
500	31 juill. 2023	Nippon Concrete Industries, swap sur rendement total	1 135	(67)
200	31 juill. 2023	Nippon Rietec Co Ltd, swap sur rendement total	1 733	228
500	31 juill. 2023	Nishi-Nippon Financial Holdi, swap sur rendement total	4 945	452
400	31 juill. 2023	Nissan Chemical Corp, swap sur rendement total	23 742	(3 942)
300	31 juill. 2023	Nissan Tokyo Sales Holdings, swap sur rendement total	903	(15)
200	31 juill. 2023	Nisshin Fudosan Co Ltd, swap sur rendement total	883	(1)
51	31 juill. 2023	Nitta Corp, swap sur rendement total	1 465	(69)
200	31 juill. 2023	Obayashi Corp, swap sur rendement total	2 050	(53)
100	31 juill. 2023	Odakyu Electric Railway Co, swap sur rendement total	1 757	(61)
40	31 juill. 2023	Okinawa Electric Power Co, swap sur rendement total	415	(5)
200	31 juill. 2023	Oriental Land Co Ltd, swap sur rendement total	39 351	(1 099)
7	31 juill. 2023	Orix Jreit Inc, swap sur rendement total	13 406	(455)
150	31 juill. 2023	Osaka Steel Co Ltd, swap sur rendement total	1 791	43
600	31 juill. 2023	Osaki Electric Co Ltd, swap sur rendement total	3 235	(49)
100	31 juill. 2023	Pasco Corp, swap sur rendement total	1 396	29
100	31 juill. 2023	Procrea Holdings Inc, swap sur rendement total	2 264	61
1 549	31 juill. 2023	Rakuten Inc, swap sur rendement total	9 480	(869)
400	31 juill. 2023	Rasa Industries Ltd, swap sur rendement total	7 620	(1 053)
200	31 juill. 2023	Renaissance Inc, swap sur rendement total	1 805	(38)
100	31 juill. 2023	Resol Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	4 719	24
50	31 juill. 2023	Riken Technos Corp, swap sur rendement total	247	(9)
100	31 juill. 2023	Rokko Butter Co Ltd, swap sur rendement total	1 321	(79)
100	31 juill. 2023	Ryobi Ltd, swap sur rendement total	1 178	(99)
100	31 juill. 2023	Ryoden Corp, swap sur rendement total	1 740	10
100	31 juill. 2023	Sankyo Frontier Co Ltd, swap sur rendement total	3 224	(307)
100	31 juill. 2023	Sankyo Seiko Co Ltd, swap sur rendement total	489	(7)
50	31 juill. 2023	Seikagaku Corp, swap sur rendement total	462	(23)
100	31 juill. 2023	Shibusawa Warehouse Co Ltd, swap sur rendement total	2 135	1
50	31 juill. 2023	Shin-Etsu Polymer Co Ltd, swap sur rendement total	581	(58)
100	31 juill. 2023	Shinnihon Corp, swap sur rendement total	765	(3)
100	31 juill. 2023	Smk Corp, swap sur rendement total	2 373	(337)
335	31 juill. 2023	Soda Nikka Co Ltd, swap sur rendement total	2 460	399
100	31 juill. 2023	St Corp, swap sur rendement total	1 555	(14)
300	31 juill. 2023	Sumitomo Dainippon Pharma Co, swap sur rendement total	3 078	(207)
100	31 juill. 2023	Sumitomo Seika Chemicals Co, swap sur rendement total	4 185	(169)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
300	31 juill. 2023	Suruga Bank Ltd, swap sur rendement total	1 303	(18)
100	31 juill. 2023	T&K Toka Co Ltd, swap sur rendement total	1 218	189
150	31 juill. 2023	Tachibana Eletech Co Ltd, swap sur rendement total	2 719	(16)
200	31 juill. 2023	Takaoka Toko Co Ltd, swap sur rendement total	3 674	(118)
200	31 juill. 2023	Tayca Corp, swap sur rendement total	2 409	(208)
100	31 juill. 2023	Tdc Soft Inc, swap sur rendement total	1 505	(3)
100	31 juill. 2023	Thine Electronics Inc, swap sur rendement total	898	(133)
500	31 juill. 2023	Tokuyama Corp, swap sur rendement total	9 222	(596)
100	31 juill. 2023	Tokyo Century Corp, swap sur rendement total	4 601	(244)
400	31 juill. 2023	Tokyo Rope Mfg Co Ltd, swap sur rendement total	3 500	(150)
1 000	31 juill. 2023	Toli Corp, swap sur rendement total	2 341	173
100	31 juill. 2023	Tomony Holdings Inc, swap sur rendement total	380	22
100	31 juill. 2023	Tonami Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	3 769	18
200	31 juill. 2023	Topcon Corp, swap sur rendement total	3 144	(116)
200	31 juill. 2023	Topre Corp, swap sur rendement total	2 329	(256)
100	31 juill. 2023	Torigoe Co Ltd/The, swap sur rendement total	610	(27)
100	31 juill. 2023	Toyo Ink Sc Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 848	(77)
100	31 juill. 2023	Trend Micro Inc, swap sur rendement total	6 305	(653)
200	31 juill. 2023	Vital Ksk Holdings Inc, swap sur rendement total	1 746	49
500	31 juill. 2023	World Co Ltd, swap sur rendement total	6 762	16
1 200	31 juill. 2023	Yamabiko Corp, swap sur rendement total	13 543	(430)
100	31 juill. 2023	Yamanashi Chuo Bank Ltd/The, swap sur rendement total	1 140	65
100	31 juill. 2023	Yamatane Corp, swap sur rendement total	1 702	(39)
250	31 juill. 2023	Yokogawa Electric Corp, swap sur rendement total	5 404	(1 154)
100	31 juill. 2023	Yorozu Corp, swap sur rendement total	713	(107)
200	31 juill. 2023	Yurtec Corp, swap sur rendement total	1 510	25
700	31 juill. 2023	Yushin Precision Equipment, swap sur rendement total	4 787	(158)
200	31 juill. 2023	Zeon Corp, swap sur rendement total	2 744	23
				(18 661)
Dollar néo-zélandais – taux du marché des acceptations bancaires (BKBM) à 1 mois				
619	31 juill. 2023	A2 Milk Co Ltd, swap sur rendement total	3 915	373
108	31 juill. 2023	Contact Energy Ltd, swap sur rendement total	714	–
751	31 juill. 2023	Infratil Ltd, swap sur rendement total	5 567	(148)
813	31 juill. 2023	Scales Corp Ltd, swap sur rendement total	2 856	(207)
144	31 juill. 2023	Synlait Milk Ltd, swap sur rendement total	436	46
				64
Dollar de Singapour – taux interbancaire offert à Singapour (SIBOR) à 1 mois				
880	31 juill. 2023	Austasia Group Ltd, swap sur rendement total	5 663	5 663
400	31 juill. 2023	Brc Asia Ltd, swap sur rendement total	731	(6)
600	31 juill. 2023	Bumitama Agri Ltd, swap sur rendement total	358	(13)
200	31 juill. 2023	First Resources Ltd, swap sur rendement total	299	(31)
1 900	31 juill. 2023	Hong Fok Corp Ltd, swap sur rendement total	1 824	(73)
1 385	31 juill. 2023	Hrnetgroup Ltd, swap sur rendement total	1 098	(18)
6 726	31 juill. 2023	Japfa Ltd, swap sur rendement total	2 344	(1 133)
13 397	31 juill. 2023	Riverstone Holdings Ltd, swap sur rendement total	8 324	(233)
14 196	31 juill. 2023	Sheng Siong Group Ltd, swap sur rendement total	23 664	(82)
45	31 juill. 2023	Singapore Exchange Ltd, swap sur rendement total	407	(9)
400	31 juill. 2023	Singapore Tech Engineering, swap sur rendement total	1 354	(40)
36 912	31 juill. 2023	Thomson Medical Group Ltd, swap sur rendement total	2 909	(47)
400	31 juill. 2023	Wing Tai Holdings Ltd, swap sur rendement total	606	(2)
15 400	31 juill. 2023	Yanlord Land Group Ltd, swap sur rendement total	15 869	473
				4 449
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
1 055	31 juill. 2023	Alexander Forbes Group Holdi, swap sur rendement total	441	44
348	31 juill. 2023	Alviva Holdings Ltd, swap sur rendement total	753	71
153	31 juill. 2023	Anglo American Platinum Ltd, swap sur rendement total	17 361	(3 598)
5 389	31 juill. 2023	Arrowhead Properties Ltd, B, swap sur rendement total	1 343	(92)
108	31 juill. 2023	Aspen Pharmacare Holdings Lt, swap sur rendement total	1 172	(72)
233	31 juill. 2023	Avi Ltd, swap sur rendement total	1 395	26
165	31 juill. 2023	Bid Corp Ltd, swap sur rendement total	4 334	(92)
83	31 juill. 2023	Bidvest Group Ltd, swap sur rendement total	1 417	(126)
142	31 juill. 2023	Discovery Ltd, swap sur rendement total	1 395	(54)
40	31 juill. 2023	Exxaro Resources Ltd, swap sur rendement total	692	(48)
3 261	31 juill. 2023	Firststrand Ltd, swap sur rendement total	16 132	(1 346)
100	31 juill. 2023	Hosken Cons Investments Ltd, swap sur rendement total	1 246	(112)
100	31 juill. 2023	Hudaco Industries Ltd, swap sur rendement total	1 123	3
222	31 juill. 2023	Impala Platinum Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 768	45
477	31 juill. 2023	Investec Property Fund Ltd, swap sur rendement total	364	(1)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
150	31 juill. 2023	Lewis Group Ltd, swap sur rendement total	585	(15)
473	31 juill. 2023	Mtn Group Ltd, swap sur rendement total	4 795	(567)
43	31 juill. 2023	Multichoice Group Ltd, swap sur rendement total	401	(5)
90	31 juill. 2023	Nedbank Group Ltd, swap sur rendement total	1 524	(130)
130	31 juill. 2023	Nepi Rockcastle Plc, swap sur rendement total	1 067	(13)
837	31 juill. 2023	Netcare Ltd, swap sur rendement total	966	(13)
217	31 juill. 2023	Northam Platinum Ltd, swap sur rendement total	3 235	(171)
97	31 juill. 2023	Sanlam Ltd, swap sur rendement total	376	(33)
100	31 juill. 2023	Sasol Ltd, swap sur rendement total	2 146	(186)
144	31 juill. 2023	Shoprite Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 592	(237)
55	31 juill. 2023	Spar Group Limited/The, swap sur rendement total	497	(89)
778	31 juill. 2023	Sun International Ltd, swap sur rendement total	2 143	(88)
46	31 juill. 2023	The Foschini Group Ltd, swap sur rendement total	370	(44)
49	31 juill. 2023	Thungela Resources Ltd, swap sur rendement total	1 119	(119)
1 062	31 juill. 2023	Transaction Capital, swap sur rendement total	2 799	(453)
418	31 juill. 2023	Tsogo Sun Gaming Ltd, swap sur rendement total	390	(36)
				<u>(7 551)</u>
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
1 374	31 juill. 2023	Addtech Ab, actions, Bs, swap sur rendement total	26 569	(986)
339	31 juill. 2023	Alfa Laval Ab, swap sur rendement total	13 274	64
138	31 juill. 2023	Alimak Group Ab, swap sur rendement total	1 339	(91)
14	31 juill. 2023	Assa Abloy Ab-B, swap sur rendement total	407	(9)
88	31 juill. 2023	Avanza Bank Holding Ab, swap sur rendement total	2 559	150
100	31 juill. 2023	Beijer Alma Ab, swap sur rendement total	2 125	(54)
255	31 juill. 2023	Bonesupport Holding Ab, swap sur rendement total	2 668	(137)
25	31 juill. 2023	Eastnine Ab, swap sur rendement total	393	28
23	31 juill. 2023	Electrolux Ab, série B, swap sur rendement total	421	(20)
600	31 juill. 2023	Elekta Ab, actions, B, swap sur rendement total	4 900	66
123	31 juill. 2023	Evolution Gaming Group, swap sur rendement total	16 241	(837)
1 438	31 juill. 2023	Hennes & Mauritz Ab-actions, B, swap sur rendement total	20 989	(845)
809	31 juill. 2023	Hexatronic Group Ab, swap sur rendement total	14 891	(372)
185	31 juill. 2023	Humana Ab, swap sur rendement total	926	(103)
186	31 juill. 2023	Intrum Ab, swap sur rendement total	3 052	(99)
850	31 juill. 2023	Lagercrantz Group Ab, actions, B, swap sur rendement total	11 418	(798)
16	31 juill. 2023	Lifco Ab-actions, B, swap sur rendement total	362	(12)
317	31 juill. 2023	Lindab International Ab, swap sur rendement total	5 252	(18)
363	31 juill. 2023	Nibe Industrier Ab, actions, B, swap sur rendement total	4 584	(54)
66	31 juill. 2023	Np3 Fastigheter Ab, swap sur rendement total	1 705	141
97	31 juill. 2023	Paradox Interactive Ab, swap sur rendement total	2 677	184
133	31 juill. 2023	Proact It Group Ab, swap sur rendement total	1 436	(26)
528	31 juill. 2023	Rottneros Ab, swap sur rendement total	839	(109)
5	31 juill. 2023	Sagax Ab, B, swap sur rendement total	154	3
143	31 juill. 2023	Sandvik Ab, swap sur rendement total	3 503	(5)
352	31 juill. 2023	Scandic Hotels Group Ab, swap sur rendement total	1 475	(139)
102	31 juill. 2023	Securitas Ab, actions, B, swap sur rendement total	1 153	18
149	31 juill. 2023	Skf Ab, actions, B, swap sur rendement total	3 084	(201)
500	31 juill. 2023	Systemair Ab, swap sur rendement total	4 668	54
35	31 juill. 2023	Thule Group Ab/The, swap sur rendement total	991	(123)
54	31 juill. 2023	Tobii Ab, swap sur rendement total	117	-
200	31 juill. 2023	Volati Ab, swap sur rendement total	2 268	(169)
				<u>(4 499)</u>
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
73	31 juill. 2023	Ascom Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	794	(43)
13	31 juill. 2023	Berner Kantonalbank Ag, actions ord., swap sur rendement total	4 236	(28)
7	31 juill. 2023	Bossard Holding Ag, actions ord. A, swap sur rendement total	2 048	(69)
9	31 juill. 2023	Flughafen Zurich Ag, actions ord., swap sur rendement total	1 886	(171)
247	31 juill. 2023	Galenica Ag, swap sur rendement total	27 329	1 120
28	31 juill. 2023	Holcim Ltd, swap sur rendement total	1 963	(35)
4	31 juill. 2023	Lem Holding Sa, actions ord., swap sur rendement total	10 509	(334)
27	31 juill. 2023	Nestlé Sa, actions ord., swap sur rendement total	4 236	(208)
21	31 juill. 2023	Novartis Ag, actions ord., swap sur rendement total	2 571	(6)
3	31 juill. 2023	Roche Holding Ag, Genusschein, swap sur rendement total	1 276	(77)
17	31 juill. 2023	Sensirion Holding Ag, swap sur rendement total	2 440	(106)
9	31 juill. 2023	Swiss Life Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	6 342	(270)
74	31 juill. 2023	Swissquote Group Holding, actions ord., swap sur rendement total	14 468	(168)
47	31 juill. 2023	Thurgauer Kantonalbank, certificat, swap sur rendement total	8 191	2
18	31 juill. 2023	U-Blox Holding Ag, swap sur rendement total	2 905	(286)
100	31 juill. 2023	Varia Us Properties Ag, swap sur rendement total	6 751	(472)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	31 juill. 2023	Vontobel Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	8 977	434
				(717)
Dollar américain – taux interbancaire offert à Londres (ICE LIBOR) à 1 mois				
100	31 juill. 2023	360 Security Technology In, A, swap sur rendement total	128	(4)
3 630	31 juill. 2023	Aapico Hitech Pcl, swap sur rendement total	4 226	(595)
83	31 juill. 2023	Able C&C, swap sur rendement total	468	34
33	31 juill. 2023	Adani Transmission Ltd, swap sur rendement total	1 400	(205)
114	31 juill. 2023	Adtechnology Co Ltd, swap sur rendement total	1 507	(81)
100	31 juill. 2023	Aekyung Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	2 247	292
3 100	31 juill. 2023	Affin Bank Bhd, swap sur rendement total	1 936	(101)
55	31 juill. 2023	Afreecatv Co Ltd, swap sur rendement total	4 204	(596)
1 002	31 juill. 2023	Agi Greenpac Ltd, swap sur rendement total	5 369	413
60 200	31 juill. 2023	Alfa S.A.B.-A, swap sur rendement total	51 956	(4 776)
500	31 juill. 2023	Aliance Sonae Shoppig Center, swap sur rendement total	2 180	(22)
1 000	31 juill. 2023	Ammb Holdings Bhd, swap sur rendement total	1 274	(1)
8	31 juill. 2023	Amorepacific Corp, swap sur rendement total	1 183	91
939	31 juill. 2023	Amtran Technology Co Ltd, swap sur rendement total	414	10
67	31 juill. 2023	Andhra Paper Ltd, swap sur rendement total	461	(16)
2 400	31 juill. 2023	Area Continental Sab De Cv, swap sur rendement total	26 412	(836)
100	31 juill. 2023	Asahi India Glass Ltd, swap sur rendement total	857	(173)
1 000	31 juill. 2023	Asia Cement Corp, swap sur rendement total	1 808	(13)
11 800	31 juill. 2023	Asia Plus Group Holdings Pcl, swap sur rendement total	1 376	11
10 400	31 juill. 2023	Ata Ims Bhd, swap sur rendement total	720	(11)
1 000	31 juill. 2023	Audix Corp, swap sur rendement total	2 257	(61)
90	31 juill. 2023	Automotive Axles Ltd, swap sur rendement total	2 917	(107)
4 000	31 juill. 2023	Azul Sa, swap sur rendement total	11 288	(1 392)
1 100	31 juill. 2023	B3 Sa-Brasil Bolsa Balcao, swap sur rendement total	3 725	99
48 014	31 juill. 2023	Bajaj Hindusthan Sugar Ltd, swap sur rendement total	13 527	4 587
500	31 juill. 2023	Banco Abc Brasil Sa, swap sur rendement total	2 517	(7)
3 900	31 juill. 2023	Banco Btg Pactual Sa, parts, swap sur rendement total	24 127	(2 219)
300	31 juill. 2023	Banco Del Bajio Sa, swap sur rendement total	1 284	(77)
8 600	31 juill. 2023	Banco Do Brasil Sa, swap sur rendement total	76 557	(1 344)
100	31 juill. 2023	Banco Estado Rio Gran, actions priv., B, swap sur rendement total	249	(8)
2 838	31 juill. 2023	Banco Products (India) Ltd, swap sur rendement total	9 299	(316)
2 000	31 juill. 2023	Bank Of Beijing Co Ltd, A, swap sur rendement total	1 693	47
4 500	31 juill. 2023	Bank Of Chengdu Co Ltd, A, swap sur rendement total	13 523	272
235	31 juill. 2023	Bank Of India, swap sur rendement total	340	(34)
300	31 juill. 2023	Bank Of Jiangsu Co Ltd, A, swap sur rendement total	430	3
200	31 juill. 2023	Bank Of Shanghai Co Ltd, A, swap sur rendement total	232	3
8 200	31 juill. 2023	Bb Seguridade Participacoes, swap sur rendement total	70 852	4 830
2 400	31 juill. 2023	Bear Electric Appliance Co, A, swap sur rendement total	28 434	(161)
2	31 juill. 2023	Bgf Retail Co Ltd, swap sur rendement total	453	6
4	31 juill. 2023	Blue Dart Express Ltd, swap sur rendement total	505	(3)
115	31 juill. 2023	Bank Financial Group Inc, swap sur rendement total	804	(51)
700	31 juill. 2023	Braskem Sa, actions priv., A, swap sur rendement total	4 263	(529)
600	31 juill. 2023	Brf Sa, swap sur rendement total	1 273	48
200	31 juill. 2023	Bumrungrad Hospital Pcl, swap sur rendement total	1 659	(90)
700	31 juill. 2023	C&A Modas Ltda, swap sur rendement total	411	(16)
70 308	31 juill. 2023	Cal-Comp Electronics Thailan, swap sur rendement total	6 383	(125)
371	31 juill. 2023	Capacit'E Infraprojects Ltd, swap sur rendement total	930	57
150	31 juill. 2023	Castrol India Ltd, swap sur rendement total	303	(27)
100	31 juill. 2023	Cell Biotech Co Ltd, swap sur rendement total	1 365	133
841	31 juill. 2023	Celsia Sa Esp, swap sur rendement total	653	(38)
738	31 juill. 2023	Cementos Argos Sa	742	15
23	31 juill. 2023	Cesc Ventures Ltd, swap sur rendement total	170	(19)
2 560	31 juill. 2023	Chalet Hotels Ltd, swap sur rendement total	14 574	(1 351)
16 500	31 juill. 2023	Chengdu Hongqi Chain Co Lt, A, swap sur rendement total	18 246	1 800
1 600	31 juill. 2023	Chengdu Xingrong Environme, A, swap sur rendement total	1 537	(22)
900	31 juill. 2023	China Electric Manufacturing, swap sur rendement total	524	(62)
100	31 juill. 2023	China Pacific Insurance Gr, A, swap sur rendement total	482	15
1	31 juill. 2023	China Resources Sanjiu Med, A, swap sur rendement total	9	(2)
700	31 juill. 2023	China State Construction, A, swap sur rendement total	747	124
2 600	31 juill. 2023	Chularat Hospital Pcl, swap sur rendement total	374	3
1 000	31 juill. 2023	Chunghwa Chemical Synthesis, swap sur rendement total	2 892	131
300	31 juill. 2023	Cia De Saneamento Do Pa, parts, swap sur rendement total	1 389	(92)
4 844	31 juill. 2023	Cia Energetica Minas Ger,actions priv., swap sur rendement total	13 831	(473)
192 411	31 juill. 2023	Cia Sud Americana De Vapores, swap sur rendement total	20 567	(642)
81	31 juill. 2023	Com2Us Corp, swap sur rendement total	5 190	94

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
395	31 juill. 2023	Commercial Intl Bank- CIAE, actions ord., swap sur rendement total	639	(440)
1 200	31 juill. 2023	Companhia Brasileira De Alum, swap sur rendement total	3 553	(146)
300	31 juill. 2023	Cp All Pcl, swap sur rendement total	801	49
43	31 juill. 2023	Cs Wind Corp, swap sur rendement total	3 180	(154)
27	31 juill. 2023	Ctc Bio Inc, swap sur rendement total	183	(12)
20	31 juill. 2023	Cuckoo Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	354	12
170	31 juill. 2023	Daewon Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	3 427	354
24	31 juill. 2023	Daewoo Shipbuilding & Marine, swap sur rendement total	489	16
44	31 juill. 2023	Daewoong Co Ltd, swap sur rendement total	963	(12)
2	31 juill. 2023	Daewoong Pharmaceutical Co, swap sur rendement total	341	18
524	31 juill. 2023	Dalmia Bharat Sugar & Indust, swap sur rendement total	3 273	181
2 000	31 juill. 2023	Delta Electronics Inc, swap sur rendement total	25 262	(1 353)
33	31 juill. 2023	Dgb Financial Group Inc, swap sur rendement total	248	(17)
1 400	31 juill. 2023	Diamond Building Products Pc, swap sur rendement total	441	9
22 318	31 juill. 2023	Dish Tv India Ltd, swap sur rendement total	6 726	(955)
16	31 juill. 2023	Dongbu Hitek Co Ltd, swap sur rendement total	639	(80)
133	31 juill. 2023	Dongbu Steel Co Ltd, swap sur rendement total	1 057	(166)
100	31 juill. 2023	Dongfang Electric Corp Ltd, A, swap sur rendement total	413	(8)
98	31 juill. 2023	Dongkuk Steel Mill Co Ltd, swap sur rendement total	1 175	(192)
441	31 juill. 2023	Dongwon Development Co, swap sur rendement total	1 621	(21)
17	31 juill. 2023	Doosan Bobcat Inc, swap sur rendement total	632	20
11	31 juill. 2023	Doosan Corp, swap sur rendement total	983	(105)
67	31 juill. 2023	E.Sun Financial Holding Co, swap sur rendement total	71	(2)
70	31 juill. 2023	Easy Bio Inc, swap sur rendement total	211	(11)
341	31 juill. 2023	Eclerx Services Ltd, swap sur rendement total	7 146	(1 104)
600	31 juill. 2023	Ecorodovias Infra E Log Sa, swap sur rendement total	684	11
100	31 juill. 2023	Edp - Energias Do Brasil Sa, swap sur rendement total	533	(21)
1 164	31 juill. 2023	Embassy Office Parks Reit, swap sur rendement total	6 407	(261)
75	31 juill. 2023	Empresa Nacional De Telecom, swap sur rendement total	351	51
1 300	31 juill. 2023	Equatorial Energia Sa, actions ord., swap sur rendement total	9 003	(810)
372	31 juill. 2023	Eris Lifesciences Ltd, swap sur rendement total	3 944	(241)
200	31 juill. 2023	Eucatex Sa Industria, actions priv., swap sur rendement total	434	58
177	31 juill. 2023	Fdc Ltd, swap sur rendement total	785	(58)
600	31 juill. 2023	Fgv Holdings Bhd, swap sur rendement total	244	(4)
189	31 juill. 2023	Fiem Industries Ltd, swap sur rendement total	5 369	(772)
45	31 juill. 2023	Finolex Cables Ltd, swap sur rendement total	403	(12)
1 000	31 juill. 2023	Formosa Plastics Corp, swap sur rendement total	3 827	6
5 596	31 juill. 2023	Forth Smart Service Pcl, swap sur rendement total	2 825	(327)
100	31 juill. 2023	Foxconn Industrial Interne, A, swap sur rendement total	180	5
2 000	31 juill. 2023	Fulgent Sun International, swap sur rendement total	13 403	(108)
100	31 juill. 2023	Fuyao Glass Industry Group, A, swap sur rendement total	689	(23)
153	31 juill. 2023	Gabriel India Ltd, swap sur rendement total	466	(26)
1 300	31 juill. 2023	Gd Power Development Co, A, swap sur rendement total	1 090	(39)
293	31 juill. 2023	Genie Music Corp, swap sur rendement total	1 074	(93)
24 200	31 juill. 2023	Genera Sab De Cv, swap sur rendement total	36 925	1 775
200	31 juill. 2023	Genting Plantations Bhd, swap sur rendement total	394	14
3 787	31 juill. 2023	Geojit Financial Services Lt, swap sur rendement total	2 934	(80)
1 327	31 juill. 2023	Gfl Ltd, swap sur rendement total	1 430	(53)
251	31 juill. 2023	Glaxosmithkline Pharmaceutic, swap sur rendement total	5 422	(186)
2 200	31 juill. 2023	Globetronics Technology Bhd, swap sur rendement total	785	12
100	31 juill. 2023	Gm Breweries Ltd, swap sur rendement total	1 023	34
900	31 juill. 2023	Gol Linhas Aereas, actions priv., swap sur rendement total	1 693	55
61	31 juill. 2023	Goodyear India Ltd, swap sur rendement total	1 108	(15)
600	31 juill. 2023	Gps Participacoes E Empreend, swap sur rendement total	1 832	49
1 000	31 juill. 2023	Grape King Bio Ltd, swap sur rendement total	7 407	1 108
231	31 juill. 2023	Greenland Holdings Corp Lt, A, swap sur rendement total	135	(17)
510	31 juill. 2023	Grindwell Norton Ltd, swap sur rendement total	14 900	(1 457)
50	31 juill. 2023	Gruma S.A.B.-B, swap sur rendement total	907	57
600	31 juill. 2023	Grupo Bimbo Sab, série A, swap sur rendement total	3 437	(28)
600	31 juill. 2023	Grupo Comercial Chedraui Sa, swap sur rendement total	3 471	(68)
1 817	31 juill. 2023	Grupo Energia Bogota Sa Esp, swap sur rendement total	854	(66)
42	31 juill. 2023	Grupo Nutresa Sa, swap sur rendement total	522	3
114	31 juill. 2023	Gs Engineering & Construct, swap sur rendement total	2 592	(118)
100	31 juill. 2023	Guangdong Ly Intelligent M, A, swap sur rendement total	89	(5)
500	31 juill. 2023	Guangdong Topstar Technolo, A, swap sur rendement total	1 429	(23)
100	31 juill. 2023	Guosen Securities Co Ltd, A, swap sur rendement total	174	(1)
100	31 juill. 2023	Gwangjushinsegae Co Ltd, swap sur rendement total	3 440	86
86	31 juill. 2023	Hana Financial Group, swap sur rendement total	3 888	29

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
31	31 juill. 2023	Hana Materials Inc, swap sur rendement total	1 090	(19)
26	31 juill. 2023	Hankook Tire & Technology Co, swap sur rendement total	871	(30)
23	31 juill. 2023	Hansol Paper Co Ltd, swap sur rendement total	328	1
100	31 juill. 2023	Hansol Technics Co Ltd, swap sur rendement total	548	(8)
112	31 juill. 2023	Hanwha Aerospace Co Ltd, swap sur rendement total	8 862	621
78	31 juill. 2023	Hanwha Chemical Corp, swap sur rendement total	3 606	(461)
753	31 juill. 2023	Hanwha Corporation, swap sur rendement total	20 764	(1 423)
118	31 juill. 2023	Hanwha General Insurance Co, swap sur rendement total	591	82
7 288	31 juill. 2023	Hanwha Life Insurance Co Ltd, swap sur rendement total	21 702	3 080
649	31 juill. 2023	Hb Technology Co Ltd, swap sur rendement total	1 340	30
254	31 juill. 2023	Healthcare Global Enterprise, swap sur rendement total	1 196	(59)
5 700	31 juill. 2023	Henan Lingrui Pharmaceutic, A, swap sur rendement total	14 599	(678)
2 800	31 juill. 2023	Hibiscus Petroleum Bhd, swap sur rendement total	922	(28)
500	31 juill. 2023	Hidrovias Do Brasil Sa, swap sur rendement total	290	(18)
19	31 juill. 2023	Hil Ltd, swap sur rendement total	809	(14)
20	31 juill. 2023	Hindustan Aeronautics Ltd, swap sur rendement total	829	(91)
611	31 juill. 2023	Hitejinro Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	6 384	(94)
1 000	31 juill. 2023	Hitron Technology Inc, swap sur rendement total	1 056	(141)
589	31 juill. 2023	Home Center Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	719	(74)
4 057	31 juill. 2023	Hon Hai Precision-CIAE, actions ord. S, swap sur rendement total	35 511	(261)
200	31 juill. 2023	Hong Leong Bank Berhad, swap sur rendement total	1 265	(265)
300	31 juill. 2023	Hong Leong Financial Group, swap sur rendement total	1 717	12
9	31 juill. 2023	Hotel Shilla Co Ltd, swap sur rendement total	804	88
100	31 juill. 2023	Huafon Chemical Co Ltd, A, swap sur rendement total	134	(6)
52	31 juill. 2023	Hwasung Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	587	(92)
100	31 juill. 2023	Hypera Sa, swap sur rendement total	1 166	(19)
250	31 juill. 2023	Hyundai Engineering & Const, swap sur rendement total	9 380	(1 050)
6	31 juill. 2023	Hyundai Glovis Co Ltd, swap sur rendement total	1 055	(21)
166	31 juill. 2023	Hyundai Marine & Fire Ins Co, swap sur rendement total	5 255	171
60	31 juill. 2023	Hyundai Mipo Dockyard, swap sur rendement total	5 450	188
18	31 juill. 2023	Hyundai Mobis Co Ltd, swap sur rendement total	3 880	39
45	31 juill. 2023	Hyundai Motor Co, swap sur rendement total	7 305	16
136	31 juill. 2023	Hyundai Motor Securities Co, swap sur rendement total	1 329	(71)
88	31 juill. 2023	Hyundai Rotem Company, swap sur rendement total	2 687	(152)
22	31 juill. 2023	Hyundai Steel Co, swap sur rendement total	724	(29)
400	31 juill. 2023	Ihh Healthcare Bhd, swap sur rendement total	765	56
1 147	31 juill. 2023	Ihq Inc, swap sur rendement total	522	(213)
151	31 juill. 2023	Il Dong Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	3 271	(1 540)
237	31 juill. 2023	Il Dong Pharmaceutical Co Lt, swap sur rendement total	7 274	(2 018)
11	31 juill. 2023	Inbody Co Ltd, swap sur rendement total	239	31
2 000	31 juill. 2023	Infortrend Technology Inc, swap sur rendement total	1 689	(48)
131	31 juill. 2023	Interconexion Electrica Sa, swap sur rendement total	768	50
52	31 juill. 2023	Interflex Co Ltd, swap sur rendement total	214	(20)
1 000	31 juill. 2023	Inventec Corp, swap sur rendement total	1 157	63
500	31 juill. 2023	Ioi Corp Bhd, swap sur rendement total	623	38
2 600	31 juill. 2023	Ioi Properties Group Bhd, swap sur rendement total	848	(44)
1 000	31 juill. 2023	I-Sheng Electric Wire & Cabl, swap sur rendement total	1 861	16
64	31 juill. 2023	It'S Skin Co Ltc, swap sur rendement total	1 228	77
94	31 juill. 2023	J.B. Chemicals & Pharma Ltd, swap sur rendement total	2 994	(175)
571	31 juill. 2023	J.Kumar Infraprojects Ltd, swap sur rendement total	2 547	(120)
2 315	31 juill. 2023	Jagran Prakashan Ltd, swap sur rendement total	2 774	(26)
9 000	31 juill. 2023	Jasmine Intl Public Co Ltd, swap sur rendement total	775	(38)
200	31 juill. 2023	Jbs Sa, swap sur rendement total	1 127	46
22	31 juill. 2023	Jet Airways India Ltd, swap sur rendement total	26	(5)
500	31 juill. 2023	Jiangsu Lihua Animal Husba, A, swap sur rendement total	3 364	120
100	31 juill. 2023	Jiangsu Zhongnan Construct, A, swap sur rendement total	43	(10)
116	31 juill. 2023	Jk Paper Ltd, swap sur rendement total	777	(38)
222	31 juill. 2023	Jm Financial Ltd, swap sur rendement total	260	(16)
586	31 juill. 2023	Jmc Projects (India) Limited, swap sur rendement total	1 313	50
300	31 juill. 2023	Joicare Pharmaceutical Gr, A, swap sur rendement total	665	(36)
426	31 juill. 2023	Jtekt India Ltd, swap sur rendement total	1 053	3
27	31 juill. 2023	Kangwon Land Inc, swap sur rendement total	673	(20)
141	31 juill. 2023	Karnataka Bank Ltd, swap sur rendement total	351	1
23 952	31 juill. 2023	Karur Vysya Bank Ltd, swap sur rendement total	44 431	4 364
2 100	31 juill. 2023	Kelington Group Bhd, swap sur rendement total	885	(52)
37	31 juill. 2023	Kginicis Co Ltd, swap sur rendement total	465	(15)
643	31 juill. 2023	Kia Motors Corp, swap sur rendement total	40 991	(3 717)
1 100	31 juill. 2023	Klabin Sa, parts, swap sur rendement total	5 640	57

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
32	31 juill. 2023	Kolon Corp, swap sur rendement total	753	(53)
964	31 juill. 2023	Korea Aerospace Industries, swap sur rendement total	52 749	5 280
44	31 juill. 2023	Korea Gas Corporation, swap sur rendement total	1 712	156
36	31 juill. 2023	Korea Information&Communicat, swap sur rendement total	441	(56)
379	31 juill. 2023	Korea Shipbuilding & Offshor, swap sur rendement total	28 806	(1 395)
1 500	31 juill. 2023	Kpj Healthcare Berhad, swap sur rendement total	466	34
32	31 juill. 2023	Kt&G Corp, swap sur rendement total	3 148	22
648	31 juill. 2023	Ktb Investment & Securities, swap sur rendement total	1 951	(200)
2 300	31 juill. 2023	Kuala Lumpur Kepong Bhd, swap sur rendement total	15 823	1 127
5	31 juill. 2023	Kumho Petrochemical Co Ltd, swap sur rendement total	677	(244)
192	31 juill. 2023	Kyeryong Const Indust Co Ltd, swap sur rendement total	3 757	(93)
2 700	31 juill. 2023	Ladprao General Hospital Pcl, swap sur rendement total	597	4
100	31 juill. 2023	Laonpeople Inc, swap sur rendement total	525	65
10 866	31 juill. 2023	Lemon Tree Hotels Ltd, swap sur rendement total	15 244	(3 068)
53	31 juill. 2023	Lg Chem Ltd, swap sur rendement total	34 186	(5 106)
34	31 juill. 2023	Lg Uplus Corp, swap sur rendement total	404	(13)
5 000	31 juill. 2023	Lier Chemical Co Ltd, A, swap sur rendement total	17 638	(666)
47	31 juill. 2023	Lig Nex1 Co Ltd, swap sur rendement total	4 659	233
1 000	31 juill. 2023	Lite-On Technology Corp, swap sur rendement total	2 813	(78)
200	31 juill. 2023	Lojas Renner S.A., swap sur rendement total	1 059	(883)
3	31 juill. 2023	Lotte Checmical Corp, swap sur rendement total	576	44
43	31 juill. 2023	Lotte Fine Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	2 621	(124)
610	31 juill. 2023	Lumax Auto Technologies Ltd, swap sur rendement total	2 393	(275)
347	31 juill. 2023	Lumax Industries Ltd, swap sur rendement total	9 618	(1 695)
85	31 juill. 2023	Lutronic Corp, swap sur rendement total	1 805	102
700	31 juill. 2023	M Dias Branco Sa, swap sur rendement total	6 429	(636)
3 300	31 juill. 2023	Macquarie Mexico Real Estate, swap sur rendement total	6 527	(169)
133	31 juill. 2023	Mahindra Holidays & Resorts, swap sur rendement total	587	(58)
277	31 juill. 2023	Mas Financial Services Ltd, swap sur rendement total	3 678	(261)
11 112	31 juill. 2023	Masisa Sa, swap sur rendement total	620	146
310	31 juill. 2023	Matrimony.Com Ltd, swap sur rendement total	2 964	(218)
36	31 juill. 2023	Max Financial Services Ltd, swap sur rendement total	400	(25)
6 400	31 juill. 2023	Mega Lifesciences Pcl, swap sur rendement total	11 708	134
21	31 juill. 2023	Megastudyedu Co Ltd, swap sur rendement total	1 797	137
182	31 juill. 2023	Meritz Financial Group Inc, swap sur rendement total	8 354	1 378
648	31 juill. 2023	Meritz Fire & Marine Insuran, swap sur rendement total	34 622	4 236
73	31 juill. 2023	Meritz Securities Co Ltd, swap sur rendement total	490	53
5 100	31 juill. 2023	Metalurgica Gerdau Sa, swap sur rendement total	16 955	(840)
200	31 juill. 2023	Minerva Sa, swap sur rendement total	664	11
800	31 juill. 2023	Minor International Pcl, swap sur rendement total	1 010	61
1 223	31 juill. 2023	Mirae Asset Life Insurance, swap sur rendement total	3 800	245
148	31 juill. 2023	Mirza International Ltd, swap sur rendement total	600	(169)
157	31 juill. 2023	Moda-Innochips Co Ltd, swap sur rendement total	496	(38)
569	31 juill. 2023	Moil Ltd, swap sur rendement total	1 501	(29)
5 400	31 juill. 2023	Moon Environment Technolog, A, swap sur rendement total	11 773	(497)
11 900	31 juill. 2023	Mrv Engenharia, swap sur rendement total	23 181	(2 517)
26	31 juill. 2023	Namhae Chemical Corp, swap sur rendement total	238	(4)
43	31 juill. 2023	Narayana Hrudayalaya Ltd, swap sur rendement total	536	2
300	31 juill. 2023	Natura &Co Holding Sa, swap sur rendement total	893	(176)
10 461	31 juill. 2023	Nava Ltd, swap sur rendement total	42 083	10 151
64	31 juill. 2023	Nesco Ltd, swap sur rendement total	640	(42)
139	31 juill. 2023	Nexen Corp, swap sur rendement total	613	23
182	31 juill. 2023	Nhn Corp, swap sur rendement total	4 872	312
25	31 juill. 2023	Nice Information & Telecom, swap sur rendement total	714	18
532	31 juill. 2023	Nlc India Ltd, swap sur rendement total	750	(4)
997	31 juill. 2023	Nrb Bearings Ltd, swap sur rendement total	2 493	28
1 100	31 juill. 2023	Oriental Holdings Berhad, swap sur rendement total	2 298	(12)
76	31 juill. 2023	Pan Ocean Co Ltd, swap sur rendement total	468	16
549	31 juill. 2023	Pc Jeweller Ltd, swap sur rendement total	750	(34)
1 000	31 juill. 2023	P-Duke Technology Co Ltd, swap sur rendement total	3 809	14
18	31 juill. 2023	People & Technology Inc, swap sur rendement total	839	(74)
300	31 juill. 2023	Petro Rio Sa, swap sur rendement total	2 861	(3)
1 100	31 juill. 2023	Petrobras - Petroleo Bras, Pr, swap sur rendement total	6 908	367
700	31 juill. 2023	Petronas Chemicals Group Bhd, swap sur rendement total	1 852	(259)
4 400	31 juill. 2023	Polyplex Pcl, swap sur rendement total	4 347	176
4 100	31 juill. 2023	Porto Seguro Sa, swap sur rendement total	24 328	(1 319)
8	31 juill. 2023	Posco Chemtech Co Ltd, swap sur rendement total	1 548	(649)
500	31 juill. 2023	Posco Ict Co Ltd, swap sur rendement total	3 359	(139)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
1 000	31 juill. 2023	Pou Chen, swap sur rendement total	1 508	71
63	31 juill. 2023	Power Mech Projects Ltd, swap sur rendement total	2 044	(326)
286	31 juill. 2023	Prakash Industries Ltd, swap sur rendement total	256	7
359	31 juill. 2023	Prataap Snacks Ltd, swap sur rendement total	5 349	(350)
1 000	31 juill. 2023	President Chain Store Corp, swap sur rendement total	11 992	(15)
2	31 juill. 2023	Procter & Gamble Hygiene, swap sur rendement total	476	2
900	31 juill. 2023	Profarma Distribuidora, swap sur rendement total	887	30
3 200	31 juill. 2023	Public Bank Berhad, swap sur rendement total	4 253	(149)
100	31 juill. 2023	Pyeong Hwa Automotive Co Lt, swap sur rendement total	757	35
100	31 juill. 2023	Qgep Participacoes Sa, swap sur rendement total	346	3
5 100	31 juill. 2023	Qingdao Haier Co Ltd, A, swap sur rendement total	24 502	270
1 000	31 juill. 2023	Quanta Computer Inc, swap sur rendement total	3 188	48
1 900	31 juill. 2023	Raia Drogasil Sa, swap sur rendement total	11 552	272
1 100	31 juill. 2023	Rajthanee Hospital Pcl, swap sur rendement total	1 302	9
500	31 juill. 2023	Rajthanee Hospital Pcl, swap sur rendement total	592	4
8 239	31 juill. 2023	Redington India Ltd, swap sur rendement total	24 399	(327)
344	31 juill. 2023	Rites Ltd, swap sur rendement total	1 912	(198)
1 000	31 juill. 2023	Ruentex Development Co Ltd, swap sur rendement total	1 907	(117)
2 800	31 juill. 2023	Rumo Na, swap sur rendement total	13 356	(223)
2 700	31 juill. 2023	S Hotels & Resorts Pcl, swap sur rendement total	431	10
48	31 juill. 2023	S&T Dynamics Co Ltd, swap sur rendement total	482	(23)
129	31 juill. 2023	S&T Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	2 177	102
5	31 juill. 2023	S-1 Corporation, swap sur rendement total	319	(12)
73	31 juill. 2023	Sam Kang M&T Co Ltd, swap sur rendement total	1 577	(142)
5	31 juill. 2023	Samchully Co Ltd, swap sur rendement total	2 102	177
314	31 juill. 2023	Sammok S-Form Co Ltd, swap sur rendement total	5 637	(960)
84	31 juill. 2023	Samsung Biologics Co Ltd, swap sur rendement total	74 138	(1 354)
57	31 juill. 2023	Samsung Card Co, swap sur rendement total	1 811	(59)
13	31 juill. 2023	Samsung Electr, CIAE, swap sur rendement total	19 464	(901)
125	31 juill. 2023	Samsung Electro-Mechanics Co, swap sur rendement total	17 536	252
765	31 juill. 2023	Samsung Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	18 298	(804)
8	31 juill. 2023	Samsung Fire & Marine Ins, swap sur rendement total	1 720	49
5 789	31 juill. 2023	Samsung Heavy Industries, swap sur rendement total	31 801	1 116
23	31 juill. 2023	Samsung Life Insurance Co Lt, swap sur rendement total	1 756	(283)
119	31 juill. 2023	Samsung Sdi Co Ltd, swap sur rendement total	75 605	(12 497)
100	31 juill. 2023	Sao Martinho Sa, swap sur rendement total	680	(187)
140	31 juill. 2023	Schaeffler India Ltd, swap sur rendement total	6 299	42
269	31 juill. 2023	Seah Besteel Corp, swap sur rendement total	4 714	(527)
47	31 juill. 2023	Seah Steel Holdings, swap sur rendement total	7 402	(855)
3 792	31 juill. 2023	Sejong Telecom Inc, swap sur rendement total	2 646	(264)
99	31 juill. 2023	Seowonintech Co Ltd, swap sur rendement total	611	(5)
4 700	31 juill. 2023	Sermsang Power Corp Co Ltd, swap sur rendement total	1 839	28
700	31 juill. 2023	Shanghai Tunnel Engineerin, A, swap sur rendement total	725	(31)
300	31 juill. 2023	Shenzhen Deren Electronic, A, swap sur rendement total	508	(46)
131	31 juill. 2023	Shinwon Corp, swap sur rendement total	218	(5)
400	31 juill. 2023	Sime Darby Plantation Bhd, swap sur rendement total	572	31
41	31 juill. 2023	Simmtech Co Ltd, swap sur rendement total	1 166	(210)
11	31 juill. 2023	Sk Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	2 235	70
31	31 juill. 2023	Sk Telecom, swap sur rendement total	1 580	14
24	31 juill. 2023	Ske Co Ltd, swap sur rendement total	2 283	(448)
11	31 juill. 2023	Skf India Ltd, swap sur rendement total	818	(47)
338	31 juill. 2023	Sml Isuzu Ltd, swap sur rendement total	3 747	(465)
17	31 juill. 2023	Solar Industries India Ltd, swap sur rendement total	1 221	120
89	31 juill. 2023	Somany Ceramics Ltd, swap sur rendement total	692	(56)
100	31 juill. 2023	Subros Ltd, swap sur rendement total	490	(2)
181	31 juill. 2023	Sundaytoz Corp, swap sur rendement total	2 413	(319)
632	31 juill. 2023	Supreme Petrochem Ltd, swap sur rendement total	8 190	174
300	31 juill. 2023	Ta Ann Holdings Berhad, swap sur rendement total	358	(3)
204	31 juill. 2023	Taeyoung Engineering & Const, swap sur rendement total	884	(152)
2 000	31 juill. 2023	Taiwan Cement, swap sur rendement total	2 967	(5)
3 000	31 juill. 2023	Taiwan Cooperative Financial, swap sur rendement total	3 439	(58)
582	31 juill. 2023	Tamil Nadu Newsprint & Paper, swap sur rendement total	2 237	(169)
700	31 juill. 2023	Tangrenshen Group Co Ltd, A, swap sur rendement total	973	(12)
932	31 juill. 2023	Tata Teleservices Maharashtra, swap sur rendement total	1 416	(175)
1 000	31 juill. 2023	The Shanghai Commercial & Sa, swap sur rendement total	1 942	(297)
200	31 juill. 2023	Theragen Etex Co Ltd, swap sur rendement total	950	86
27	31 juill. 2023	Thermax Ltd, swap sur rendement total	870	(54)
41 495	31 juill. 2023	Thoresen Thai Agencies Pcl, swap sur rendement total	13 315	440

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
172	31 juill. 2023	Tk Corporation, swap sur rendement total	2 977	(126)
1 000	31 juill. 2023	Ton Yi Industrial Corp, swap sur rendement total	752	(26)
1 000	31 juill. 2023	Topco Scientific Co Ltd, swap sur rendement total	7 230	(310)
8 400	31 juill. 2023	Tpi Polene Public Co Ltd, swap sur rendement total	598	(21)
51	31 juill. 2023	Transport Corp Of India Ltd, swap sur rendement total	517	(73)
7 495	31 juill. 2023	Triveni Engineering & Indus, swap sur rendement total	34 608	(2 400)
1 200	31 juill. 2023	Tsh Resources Bhd, swap sur rendement total	395	(45)
40	31 juill. 2023	Ttk Prestige Ltd, swap sur rendement total	525	(65)
72	31 juill. 2023	Tway Air Co Ltd, swap sur rendement total	192	44
1 011	31 juill. 2023	Tym Corp, swap sur rendement total	3 130	445
1 273	31 juill. 2023	Uco Bank, swap sur rendement total	657	(41)
16 569	31 juill. 2023	Ujjivan Small Finance Bank L, swap sur rendement total	7 870	(17)
200	31 juill. 2023	Ultrapar Participacoes Sa, swap sur rendement total	646	(82)
1 088	31 juill. 2023	Union Bank Of Taiwan, swap sur rendement total	767	(24)
100	31 juill. 2023	Unipar Carbocloro Sa, swap sur rendement total	2 256	(285)
2 000	31 juill. 2023	Uni-President Enterprises Co, swap sur rendement total	5 872	48
13 398	31 juill. 2023	Unisem (M) Berhad, swap sur rendement total	11 377	314
1 000	31 juill. 2023	Universal Cement, swap sur rendement total	979	14
2 000	31 juill. 2023	Usinas Sider Minas Ger, actions priv., A, swap sur rendement total	3 670	(226)
3 000	31 juill. 2023	Via Technologies Inc, swap sur rendement total	8 901	(882)
7 600	31 juill. 2023	Vibra Energia Sa, swap sur rendement total	31 052	(1 217)
22	31 juill. 2023	Voltamp Transformers Ltd, swap sur rendement total	999	7
500	31 juill. 2023	Weg Sa, swap sur rendement total	4 942	(136)
1 000	31 juill. 2023	Well Shin Technology Co Ltd, swap sur rendement total	2 182	(20)
2 825	31 juill. 2023	Welspun Enterprises Ltd/New, swap sur rendement total	7 697	303
251	31 juill. 2023	West Coast Paper Mills Ltd, swap sur rendement total	2 153	(385)
1 000	31 juill. 2023	Wistron Corp, swap sur rendement total	1 296	77
381	31 juill. 2023	Wonderla Holidays Ltd, swap sur rendement total	2 133	(342)
357	31 juill. 2023	Wonik Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 303	25
153	31 juill. 2023	Woongjin Co Ltd, swap sur rendement total	195	7
200	31 juill. 2023	Wuxi Apptec Co Ltd, A, swap sur rendement total	3 182	173
100	31 juill. 2023	Y-Entec Co Ltd, swap sur rendement total	907	(10)
200	31 juill. 2023	Yipinhong Pharmaceutical, A, swap sur rendement total	1 358	7
204	31 juill. 2023	Youngone Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	13 465	1 641
400	31 juill. 2023	Yto Express Group Co Ltd, A, swap sur rendement total	1 578	88
1 000	31 juill. 2023	Yungshin Global Holding Corp, swap sur rendement total	2 028	246
1 700	31 juill. 2023	Zamp Sa, swap sur rendement total	2 375	(229)
300	31 juill. 2023	Zhejiang Cfmoto Power Co L, A, swap sur rendement total	6 630	(132)
200	31 juill. 2023	Zhejiang Crystal-Optech, A, swap sur rendement total	463	(1)
600	31 juill. 2023	Zhejiang Wanfeng Auto, A, swap sur rendement total	701	(41)
200	31 juill. 2023	Zhengzhou Coal Mining Mach, A, swap sur rendement total	438	(60)
2 628	31 juill. 2023	Zuari Agro Chemicals Ltd, swap sur rendement total	7 055	120
				(34 066)
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position acheteur		(78 140)

Swaps d'actions – position vendeur

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

(1 607)	31 juill. 2023	Accent Group Ltd, swap sur rendement total	(2 481)	180
(111)	31 juill. 2023	Adelaide Brighton Ltd, swap sur rendement total	(169)	5
(1 774)	31 juill. 2023	Ama Group Ltd, swap sur rendement total	(350)	1
(12 150)	31 juill. 2023	Amp Ltd, swap sur rendement total	(14 681)	537
(577)	31 juill. 2023	Ap Eagers Ltd, swap sur rendement total	(5 752)	735
(1 004)	31 juill. 2023	Apn Industria Reit, swap sur rendement total	(2 713)	8
(61)	31 juill. 2023	Appen Ltd, swap sur rendement total	(140)	7
(10)	31 juill. 2023	Arb Corp Ltd, swap sur rendement total	(236)	24
(56)	31 juill. 2023	Australian Strategic Material, swap sur rendement total	(74)	12
(380)	31 juill. 2023	Bank Of Queensland Ltd, swap sur rendement total	(2 409)	105
(62)	31 juill. 2023	Bapcor Ltd, swap sur rendement total	(368)	26
(3 551)	31 juill. 2023	Betmakers Technology Group L, swap sur rendement total	(897)	(43)
(1 223)	31 juill. 2023	Bravura Solutions Ltd, swap sur rendement total	(983)	(94)
(56)	31 juill. 2023	Carsales.Com Ltd, swap sur rendement total	(1 068)	61
(350)	31 juill. 2023	Centuria Industrial Reit, swap sur rendement total	(1 016)	21
(140)	31 juill. 2023	Challenger Ltd, swap sur rendement total	(980)	(40)
(456)	31 juill. 2023	Charter Hall Group, swap sur rendement total	(5 124)	714
(220)	31 juill. 2023	Charter Hall Long Wale Reit, swap sur rendement total	(910)	(8)
(660)	31 juill. 2023	Charter Hall Social Infrastr, swap sur rendement total	(2 088)	(9)
(99)	31 juill. 2023	City Chic Collective Ltd, swap sur rendement total	(43)	29

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(33)	31 juill. 2023	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd, swap sur rendement total	(657)	(60)
(1 517)	31 juill. 2023	Cromwell Property Group, swap sur rendement total	(953)	32
(89)	31 juill. 2023	Data#3 Ltd, swap sur rendement total	(554)	1
(102)	31 juill. 2023	Domino'S Pizza Enterprises L, swap sur rendement total	(6 209)	25
(2 912)	31 juill. 2023	Gold Road Resources Ltd, swap sur rendement total	(4 522)	170
(2 297)	31 juill. 2023	Goodman Group, swap sur rendement total	(36 957)	3 421
(358)	31 juill. 2023	Hansen Technologies Ltd, swap sur rendement total	(1 691)	(2)
(483)	31 juill. 2023	Ht&E Ltd, swap sur rendement total	(428)	39
(2 709)	31 juill. 2023	Humm Group Ltd, swap sur rendement total	(1 406)	16
(1 174)	31 juill. 2023	Imugene Ltd, swap sur rendement total	(156)	44
(725)	31 juill. 2023	Jervois Mining Ltd, swap sur rendement total	(183)	61
(803)	31 juill. 2023	Magellan Financial Group Ltd, swap sur rendement total	(6 596)	648
(1 600)	31 juill. 2023	Mayne Pharma Group Ltd, swap sur rendement total	(294)	43
(4 441)	31 juill. 2023	Mirvac Group, swap sur rendement total	(8 904)	203
(437)	31 juill. 2023	Money3 Corp Ltd, swap sur rendement total	(755)	5
(10 122)	31 juill. 2023	National Storage Reit, swap sur rendement total	(22 089)	166
(274)	31 juill. 2023	Navigator Global Investments, swap sur rendement total	(292)	2
(143)	31 juill. 2023	Nine Entertainment Co Holdin, swap sur rendement total	(242)	35
(515)	31 juill. 2023	Novonix Ltd, swap sur rendement total	(696)	320
(8 434)	31 juill. 2023	Perenti Global Ltd, swap sur rendement total	(10 191)	(1 625)
(3 351)	31 juill. 2023	Pointsbet Holdings Ltd, swap sur rendement total	(4 572)	1 599
(2 473)	31 juill. 2023	Polynovo Ltd, swap sur rendement total	(4 590)	12
(149)	31 juill. 2023	Rea Group Ltd, swap sur rendement total	(15 170)	1 717
(2 183)	31 juill. 2023	Reliance Worldwide Corp Ltd, swap sur rendement total	(5 937)	212
(716)	31 juill. 2023	Resolute Mining Ltd, swap sur rendement total	(132)	(24)
(926)	31 juill. 2023	Seek Ltd, swap sur rendement total	(17 826)	1 010
(584)	31 juill. 2023	Select Harvests Ltd, swap sur rendement total	(2 108)	248
(3 307)	31 juill. 2023	Sigma Healthcare Ltd, swap sur rendement total	(1 854)	119
(403)	31 juill. 2023	Southern Cross Media Group L, swap sur rendement total	(394)	(3)
(409)	31 juill. 2023	Star Entertainment Grp Ltd/T, swap sur rendement total	(665)	336
(47)	31 juill. 2023	Suncorp Group Ltd, swap sur rendement total	(520)	(4)
(483)	31 juill. 2023	Superloop Ltd, swap sur rendement total	(322)	8
(960)	31 juill. 2023	Telix Pharmaceuticals Ltd, swap sur rendement total	(6 413)	85
(270)	31 juill. 2023	Test Local Currency, swap sur rendement total	(4 731)	15
(4 288)	31 juill. 2023	Vicinity Centres, swap sur rendement total	(7 880)	129
(33)	31 juill. 2023	Woolworths Group Ltd, swap sur rendement total	(1 018)	30
(906)	31 juill. 2023	Worleyparsons Ltd, swap sur rendement total	(12 487)	(158)
(1 588)	31 juill. 2023	Zip Co Ltd, swap sur rendement total	(744)	333
				<u>11 479</u>
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
(2 131)	31 juill. 2023	4D Pharma Plc, swap sur rendement total	(579)	1
(220)	31 juill. 2023	Ab Dynamics Plc, swap sur rendement total	(5 750)	(89)
(527)	31 juill. 2023	Abcam Plc, swap sur rendement total	(10 531)	958
(979)	31 juill. 2023	Accrol Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(456)	(13)
(565)	31 juill. 2023	Advanced Medical Solutions, swap sur rendement total	(2 385)	140
(438)	31 juill. 2023	Angle Plc, swap sur rendement total	(361)	18
(6 843)	31 juill. 2023	Assura Plc, swap sur rendement total	(6 171)	(179)
(721)	31 juill. 2023	Aston Martin Lagonda Global, swap sur rendement total	(1 810)	(230)
(168)	31 juill. 2023	Aveva Group Plc, swap sur rendement total	(8 798)	(65)
(494)	31 juill. 2023	B&M European Value Retail Sa, swap sur rendement total	(3 312)	(7)
(2 360)	31 juill. 2023	Barclays Plc, swap sur rendement total	(6 097)	82
(1 402)	31 juill. 2023	Batm Advanced Communications, swap sur rendement total	(626)	(17)
(93)	31 juill. 2023	Berkeley Group Holdings/The, swap sur rendement total	(5 719)	73
(16 008)	31 juill. 2023	Boohoo Group Plc, swap sur rendement total	(9 244)	1 638
(72)	31 juill. 2023	Boot (Henry) Plc, swap sur rendement total	(276)	(1)
(755)	31 juill. 2023	Breedon Group Plc, swap sur rendement total	(751)	(5)
(100)	31 juill. 2023	Brooks Macdonald Group Plc, swap sur rendement total	(3 455)	(42)
(5 301)	31 juill. 2023	Bt Group Plc, swap sur rendement total	(9 881)	473
(4 968)	31 juill. 2023	Cairn Homes Plc, swap sur rendement total	(6 372)	15
(4 234)	31 juill. 2023	Capital & Counties Propertie, swap sur rendement total	(7 349)	(322)
(186)	31 juill. 2023	Chesnara Plc, swap sur rendement total	(859)	20
(117)	31 juill. 2023	Close Brothers Group Plc, swap sur rendement total	(1 997)	53
(8 298)	31 juill. 2023	Costain Group Plc, swap sur rendement total	(5 325)	199
(2 239)	31 juill. 2023	Countryside Properties Plc, swap sur rendement total	(8 386)	(607)
(65)	31 juill. 2023	Darktrace Plc, swap sur rendement total	(274)	31
(2 301)	31 juill. 2023	De La Rue Plc, swap sur rendement total	(2 944)	111
(225)	31 juill. 2023	Dechra Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	(9 601)	398
(2 365)	31 juill. 2023	Dignity Plc, swap sur rendement total	(15 997)	(1 663)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(198)	31 juill. 2023	Direct Line Insurance Group, swap sur rendement total	(714)	(38)
(5 121)	31 juill. 2023	Diversified Energy Co Plc, swap sur rendement total	(9 715)	833
(205)	31 juill. 2023	Domino'S Pizza Group Plc, swap sur rendement total	(980)	(21)
(5 467)	31 juill. 2023	Easyjet Plc, swap sur rendement total	(28 923)	5 839
(1 188)	31 juill. 2023	Ecora Resources Plc, swap sur rendement total	(2 916)	(151)
(622)	31 juill. 2023	Ekf Diagnostics Holdings Plc, swap sur rendement total	(507)	(79)
(654)	31 juill. 2023	Empiric Student Property Plc, swap sur rendement total	(898)	22
(100)	31 juill. 2023	Ergomed Plc, swap sur rendement total	(2 073)	93
(3 508)	31 juill. 2023	Essentra Plc, swap sur rendement total	(13 522)	430
(10)	31 juill. 2023	First Derivatives Plc, swap sur rendement total	(222)	7
(301)	31 juill. 2023	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(55 388)	4 479
(1 710)	31 juill. 2023	Foxtons Group Plc, swap sur rendement total	(828)	65
(141)	31 juill. 2023	Frasers Group Plc, swap sur rendement total	(1 632)	209
(29)	31 juill. 2023	Frontier Developments Plc, swap sur rendement total	(454)	87
(260)	31 juill. 2023	Future Plc, swap sur rendement total	(5 369)	598
(950)	31 juill. 2023	Gb Group Plc, swap sur rendement total	(4 874)	157
(1 326)	31 juill. 2023	Genuit Group Plc, swap sur rendement total	(6 073)	710
(100)	31 juill. 2023	Globaldata Plc, swap sur rendement total	(1 915)	86
(79)	31 juill. 2023	Grainger Plc, swap sur rendement total	(329)	(16)
(145)	31 juill. 2023	Great Portland Estates Plc, swap sur rendement total	(1 181)	-
(3 243)	31 juill. 2023	Greatland Gold Plc, swap sur rendement total	(423)	(20)
(6 144)	31 juill. 2023	Gym Group Plc/The, swap sur rendement total	(10 915)	(587)
(100)	31 juill. 2023	Hargreaves Services Plc, swap sur rendement total	(644)	(79)
(27)	31 juill. 2023	Headlam Group Plc, swap sur rendement total	(133)	1
(2 150)	31 juill. 2023	Helical Plc, swap sur rendement total	(11 793)	(27)
(106)	31 juill. 2023	Hikma Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	(2 681)	(52)
(802)	31 juill. 2023	Hill & Smith Holdings Plc, swap sur rendement total	(15 490)	153
(90)	31 juill. 2023	Homeserve Plc, swap sur rendement total	(1 756)	(5)
(574)	31 juill. 2023	Hotel Chocolat Group Plc, swap sur rendement total	(1 455)	(97)
(6 843)	31 juill. 2023	Hyve Group Plc, swap sur rendement total	(8 209)	(1 468)
(253)	31 juill. 2023	Ig Design Group Plc, swap sur rendement total	(507)	11
(1 274)	31 juill. 2023	Integratin Holdings Plc, swap sur rendement total	(6 420)	(321)
(7 206)	31 juill. 2023	Itm Power Plc, swap sur rendement total	(10 763)	1 379
(18 146)	31 juill. 2023	Itv Plc, swap sur rendement total	(22 229)	(39)
(51)	31 juill. 2023	James Fisher & Sons Plc, swap sur rendement total	(325)	(43)
(15 076)	31 juill. 2023	Jd Sports Fashion Plc, swap sur rendement total	(31 029)	20
(883)	31 juill. 2023	Jet2 Plc, swap sur rendement total	(13 836)	697
(3 869)	31 juill. 2023	John Wood Group Plc, swap sur rendement total	(8 523)	(273)
(111)	31 juill. 2023	Jupiter Fund Management, swap sur rendement total	(240)	(13)
(1 194)	31 juill. 2023	Kier Group Plc, swap sur rendement total	(1 154)	83
(56)	31 juill. 2023	Knights Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(98)	(17)
(13 890)	31 juill. 2023	Legal & General Group Plc, swap sur rendement total	(56 484)	625
(592)	31 juill. 2023	M&G Plc, swap sur rendement total	(1 813)	48
(765)	31 juill. 2023	Marshalls Plc, swap sur rendement total	(3 406)	216
(568)	31 juill. 2023	Naked Wines Plc, swap sur rendement total	(1 174)	(256)
(423)	31 juill. 2023	Next Plc, swap sur rendement total	(40 484)	(122)
(3 432)	31 juill. 2023	Ocado Group Plc, swap sur rendement total	(34 502)	558
(95)	31 juill. 2023	Oxford Biomedica Plc, swap sur rendement total	(685)	(96)
(180)	31 juill. 2023	Pagegroup Plc, swap sur rendement total	(1 353)	33
(51)	31 juill. 2023	Paypoint Plc, swap sur rendement total	(424)	23
(224)	31 juill. 2023	Pennon Group Plc, swap sur rendement total	(3 244)	99
(6 524)	31 juill. 2023	Phoenix Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(64 714)	(1 960)
(629)	31 juill. 2023	Phoenix Spree Deutschland Lt, swap sur rendement total	(2 532)	40
(441)	31 juill. 2023	Prs Reit Plc/The, swap sur rendement total	(639)	(19)
(2 642)	31 juill. 2023	Prudential Plc, swap sur rendement total	(48 551)	(4 735)
(66)	31 juill. 2023	Qinetiq Group Plc, swap sur rendement total	(384)	(9)
(4 311)	31 juill. 2023	Quilter Plc, swap sur rendement total	(6 529)	604
(34)	31 juill. 2023	Redrow Plc, swap sur rendement total	(251)	3
(1 188)	31 juill. 2023	Regional Reit Ltd, swap sur rendement total	(1 174)	(13)
(63)	31 juill. 2023	Rentokil Initial Plc, swap sur rendement total	(522)	36
(4 382)	31 juill. 2023	Restaurant Group Plc, swap sur rendement total	(2 231)	(176)
(1 197)	31 juill. 2023	Rws Holdings Plc, swap sur rendement total	(7 328)	(859)
(1 601)	31 juill. 2023	S4 Capital Plc, swap sur rendement total	(4 937)	25
(491)	31 juill. 2023	Saga Plc, swap sur rendement total	(1 007)	(215)
(50)	31 juill. 2023	Sage Group Plc/The, swap sur rendement total	(608)	9
(959)	31 juill. 2023	Sainsbury (J) Plc, swap sur rendement total	(3 403)	86
(400)	31 juill. 2023	Serica Energy Plc, swap sur rendement total	(1 858)	182
(491)	31 juill. 2023	Severfield Plc, swap sur rendement total	(496)	3

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(333)	31 juill. 2023	Softcat Plc, swap sur rendement total	(6 426)	417
(3 114)	31 juill. 2023	St James'S Place Plc, swap sur rendement total	(55 576)	2 906
(2 504)	31 juill. 2023	Strix Group Plc, swap sur rendement total	(3 347)	(258)
(1 888)	31 juill. 2023	Supermarket Income Reit Plc, swap sur rendement total	(3 154)	37
(466)	31 juill. 2023	Sylvania Platinum Ltd, swap sur rendement total	(779)	(35)
(274)	31 juill. 2023	Target Healthcare Reit Plc, swap sur rendement total	(358)	(4)
(117)	31 juill. 2023	Tate & Lyle Plc, swap sur rendement total	(1 367)	28
(88)	31 juill. 2023	Trainline Plc, swap sur rendement total	(394)	76
(100)	31 juill. 2023	Treatt Plc, swap sur rendement total	(1 019)	72
(557)	31 juill. 2023	Victoria Plc, swap sur rendement total	(4 367)	(489)
(2 091)	31 juill. 2023	Vodafone Group Plc, swap sur rendement total	(2 872)	251
(347)	31 juill. 2023	Woodside Energy Group, swap sur rendement total	(11 255)	173
(596)	31 juill. 2023	Workspace Group Plc, swap sur rendement total	(4 319)	(191)
				10 696
Euro – taux à court terme (€STR)				
(1 134)	31 juill. 2023	Accor Sa, swap sur rendement total	(38 290)	2 983
(48)	31 juill. 2023	Ackermans & Van Haaren, swap sur rendement total	(11 120)	(617)
(196)	31 juill. 2023	Adp, swap sur rendement total	(35 485)	5 913
(5 100)	31 juill. 2023	Aegon Nv, swap sur rendement total	(34 943)	(505)
(5)	31 juill. 2023	Aena Sme Sa, swap sur rendement total	(848)	44
(6 260)	31 juill. 2023	Air France-Klm, swap sur rendement total	(11 144)	482
(381)	31 juill. 2023	Aktia Bank Oyj, swap sur rendement total	(5 631)	(81)
(72)	31 juill. 2023	Akzo Nobel N.V., swap sur rendement total	(6 514)	596
(41)	31 juill. 2023	Alteara, swap sur rendement total	(7 482)	554
(210)	31 juill. 2023	Altri Sgps Sa, swap sur rendement total	(1 520)	86
(1 161)	31 juill. 2023	Amper Sa, swap sur rendement total	(250)	33
(5)	31 juill. 2023	Amundi Sa, swap sur rendement total	(383)	9
(236)	31 juill. 2023	Arkema, swap sur rendement total	(28 626)	147
(55)	31 juill. 2023	Asm International Nv, swap sur rendement total	(18 742)	1 902
(451)	31 juill. 2023	Atos Se, swap sur rendement total	(5 877)	664
(393)	31 juill. 2023	B&S Group Sarl, swap sur rendement total	(2 748)	177
(269)	31 juill. 2023	Be Semiconductor Industries, swap sur rendement total	(22 001)	1 463
(19)	31 juill. 2023	Bekaert Nv, swap sur rendement total	(997)	(40)
(167)	31 juill. 2023	Biomerieux, swap sur rendement total	(23 647)	(407)
(5)	31 juill. 2023	Bnp Paribas, swap sur rendement total	(385)	20
(708)	31 juill. 2023	Bpost Sa, swap sur rendement total	(4 918)	713
(427)	31 juill. 2023	Brunel International, swap sur rendement total	(5 915)	77
(154)	31 juill. 2023	Ca Immobilien Anlagen Ag, swap sur rendement total	(6 313)	722
(44)	31 juill. 2023	Care Property Invest, swap sur rendement total	(1 003)	(60)
(100)	31 juill. 2023	Carmila, swap sur rendement total	(1 929)	54
(573)	31 juill. 2023	Collectis, swap sur rendement total	(1 646)	114
(1 450)	31 juill. 2023	Cellnex Telecom Sa, swap sur rendement total	(64 833)	3 507
(4)	31 juill. 2023	Cfe, swap sur rendement total	(55)	(1)
(11)	31 juill. 2023	Cofinimmo, swap sur rendement total	(1 331)	(10)
(395)	31 juill. 2023	Colruyt Sa, swap sur rendement total	(12 167)	1 724
(5)	31 juill. 2023	Corbion Nv, swap sur rendement total	(230)	(18)
(46)	31 juill. 2023	Covivio, swap sur rendement total	(3 688)	(5)
(435)	31 juill. 2023	Dalata Hotel Group Plc, swap sur rendement total	(2 057)	99
(4)	31 juill. 2023	Dredging Environmental, swap sur rendement total	(717)	(717)
(242)	31 juill. 2023	Edenred, swap sur rendement total	(17 805)	582
(162)	31 juill. 2023	Eiffage, swap sur rendement total	(21 533)	499
(109)	31 juill. 2023	Elisa Oyj, swap sur rendement total	(7 796)	67
(100)	31 juill. 2023	Enento Group Oyj, swap sur rendement total	(3 095)	97
(1 142)	31 juill. 2023	Engie, swap sur rendement total	(22 109)	1 844
(566)	31 juill. 2023	Euronav Nv, swap sur rendement total	(12 842)	2 406
(112)	31 juill. 2023	Eutelsat Communications, swap sur rendement total	(1 127)	22
(49)	31 juill. 2023	Flow Traders, swap sur rendement total	(1 533)	38
(263)	31 juill. 2023	Flughafen Wien Ag, swap sur rendement total	(12 303)	261
(3 062)	31 juill. 2023	Fortum Oyj, swap sur rendement total	(70 137)	(2 744)
(269)	31 juill. 2023	Galp Energia Sgps Sa, swap sur rendement total	(4 905)	(305)
(339)	31 juill. 2023	Gaztransport Et Techniga Sa, swap sur rendement total	(48 924)	9 623
(61)	31 juill. 2023	Gecina Sa, swap sur rendement total	(8 393)	(147)
(1 072)	31 juill. 2023	Glenveagh Properties Plc, swap sur rendement total	(1 311)	123
(67)	31 juill. 2023	Greenvolt, swap sur rendement total	(756)	20
(17)	31 juill. 2023	Heineken Holding Nv, swap sur rendement total	(1 771)	15
(319)	31 juill. 2023	Heineken Nv, swap sur rendement total	(40 539)	236
(194)	31 juill. 2023	Icade, swap sur rendement total	(11 289)	(211)
(8)	31 juill. 2023	Imerys Sa, swap sur rendement total	(420)	16

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(93)	31 juill. 2023	Inpost Sa, swap sur rendement total	(1 059)	(44)
(145)	31 juill. 2023	Irish Residential Properties, swap sur rendement total	(234)	1
(1 286)	31 juill. 2023	Just Eat Takeaway.Com Nv, swap sur rendement total	(36 728)	3 465
(895)	31 juill. 2023	Kapsch Trafficcom Ag, swap sur rendement total	(14 625)	1 959
(86)	31 juill. 2023	Kaufman & Broad Sa, swap sur rendement total	(3 414)	(206)
(3)	31 juill. 2023	Kerry Group Plc, A, swap sur rendement total	(365)	9
(188)	31 juill. 2023	Kojamo Oyj, swap sur rendement total	(3 752)	132
(58)	31 juill. 2023	Kone Oyj-B, swap sur rendement total	(4 051)	(42)
(27)	31 juill. 2023	Koninklijke Dsm Nv, swap sur rendement total	(4 463)	316
(54)	31 juill. 2023	Korian, swap sur rendement total	(790)	(43)
(51)	31 juill. 2023	La Française Des Jeux Saem, swap sur rendement total	(2 772)	179
(41)	31 juill. 2023	Lagardere Sca, swap sur rendement total	(1 188)	(48)
(200)	31 juill. 2023	Lassila & Tikanoja Oyj, swap sur rendement total	(3 077)	67
(100)	31 juill. 2023	Manitou Bf, swap sur rendement total	(3 586)	(396)
(31)	31 juill. 2023	Mayr-Melnhof Karton Ag, swap sur rendement total	(6 778)	480
(584)	31 juill. 2023	Mephy Energy Sa, swap sur rendement total	(10 311)	1 152
(40)	31 juill. 2023	Melexis Nv, swap sur rendement total	(4 685)	106
(258)	31 juill. 2023	Mercialys, swap sur rendement total	(3 645)	(218)
(32)	31 juill. 2023	Metrovacesa Sa, swap sur rendement total	(295)	39
(22)	31 juill. 2023	Michelin (Cgde), swap sur rendement total	(827)	22
(85)	31 juill. 2023	Montea, swap sur rendement total	(8 186)	(346)
(159)	31 juill. 2023	Nacon Sa, swap sur rendement total	(598)	(4)
(48)	31 juill. 2023	Neinor Homes Sa, swap sur rendement total	(568)	42
(6)	31 juill. 2023	Nn Group Nv, swap sur rendement total	(331)	8
(33)	31 juill. 2023	Oeneo, swap sur rendement total	(668)	(14)
(44)	31 juill. 2023	Oesterreichische Post Ag, swap sur rendement total	(1 871)	162
(55)	31 juill. 2023	Omv Ag, swap sur rendement total	(3 826)	138
(1 325)	31 juill. 2023	Oriola Corp, B, swap sur rendement total	(3 334)	103
(69)	31 juill. 2023	Orion Oyj-cat. B, swap sur rendement total	(5 113)	(37)
(295)	31 juill. 2023	Plastic Omnium, swap sur rendement total	(5 793)	456
(225)	31 juill. 2023	Raisio Oyj-actions, V, swap sur rendement total	(810)	(123)
(100)	31 juill. 2023	Rallye Sa, swap sur rendement total	(388)	35
(60)	31 juill. 2023	Randstad Nv, swap sur rendement total	(4 942)	(146)
(513)	31 juill. 2023	Recticel, swap sur rendement total	(11 528)	(417)
(205)	31 juill. 2023	Renault Sa, swap sur rendement total	(9 271)	867
(1)	31 juill. 2023	Robertet Sa, swap sur rendement total	(1 210)	(15)
(119)	31 juill. 2023	S.O.I.T.E.C., swap sur rendement total	(26 303)	222
(9)	31 juill. 2023	Safran Sa, swap sur rendement total	(1 522)	7
(18)	31 juill. 2023	Sartorius Stedim Biotech, swap sur rendement total	(7 874)	552
(83)	31 juill. 2023	Seb Sa, swap sur rendement total	(9 392)	(334)
(100)	31 juill. 2023	Semperit Ag Holding, swap sur rendement total	(2 866)	(12)
(1 646)	31 juill. 2023	Ses, swap sur rendement total	(14 496)	1 159
(154)	31 juill. 2023	Signify Nv, swap sur rendement total	(6 988)	183
(200)	31 juill. 2023	Sligro Food Group Nv, swap sur rendement total	(4 697)	141
(259)	31 juill. 2023	Smurfit Kappa Group Plc, swap sur rendement total	(12 944)	150
(1 024)	31 juill. 2023	Solocal Group, swap sur rendement total	(903)	89
(135)	31 juill. 2023	Solvay Sa, swap sur rendement total	(18 440)	(63)
(56)	31 juill. 2023	Sopra Steria Group, swap sur rendement total	(11 434)	241
(1 638)	31 juill. 2023	Stellantis Nv, swap sur rendement total	(31 432)	1 692
(202)	31 juill. 2023	Suominen Oyj, swap sur rendement total	(875)	35
(72)	31 juill. 2023	Technip Energies Nv, swap sur rendement total	(1 527)	39
(178)	31 juill. 2023	Telenet Group Holding Nv, swap sur rendement total	(3 925)	(110)
(1 712)	31 juill. 2023	Télévision Française (T.F.1), swap sur rendement total	(17 713)	72
(121)	31 juill. 2023	Terveystalo Oyj, swap sur rendement total	(1 094)	1
(138)	31 juill. 2023	Thales Sa, swap sur rendement total	(23 807)	595
(30)	31 juill. 2023	Universal Music Group Nv, swap sur rendement total	(977)	9
(34)	31 juill. 2023	Upm-Kymmene Oyj, swap sur rendement total	(1 717)	38
(20)	31 juill. 2023	Vastned Retail Nv, swap sur rendement total	(612)	(3)
(111)	31 juill. 2023	Verallia, swap sur rendement total	(5 085)	(384)
(2)	31 juill. 2023	Vib Vermoegen Ag, swap sur rendement total	(59)	(4)
(2 429)	31 juill. 2023	Vivendi, swap sur rendement total	(31 310)	(1 067)
(643)	31 juill. 2023	Volitalia Sa, actions, ord., swap sur rendement total	(15 863)	1 251
(220)	31 juill. 2023	Warehouses De Pauw Sca, swap sur rendement total	(8 494)	(303)
(99)	31 juill. 2023	Westwing Group Ag, swap sur rendement total	(1 374)	(188)
(3)	31 juill. 2023	Wolters Kluwer, swap sur rendement total	(424)	427
(262)	31 juill. 2023	Worldline Sa, swap sur rendement total	(13 840)	3 099
				<u>47 237</u>

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
(16 110)	31 juill. 2023	Ak Medical Holdings Ltd, swap sur rendement total	(27 380)	(5 799)
(3 000)	31 juill. 2023	Akso Inc, swap sur rendement total	(22 395)	(4 887)
(2 500)	31 juill. 2023	Anhui Conch Cement Co Ltd, H, swap sur rendement total	(11 848)	475
(1 200)	31 juill. 2023	Ascentage Pharma Group Inter, swap sur rendement total	(5 354)	(765)
(298)	31 juill. 2023	Asia Cement China Holdings, swap sur rendement total	(190)	(26)
(1 500)	31 juill. 2023	Asm Pacific Technology, swap sur rendement total	(14 491)	509
(18 002)	31 juill. 2023	Avichina Industry & Tech, H, swap sur rendement total	(10 969)	508
(200)	31 juill. 2023	Bank Of East Asia Ltd, swap sur rendement total	(328)	(16)
(6 251)	31 juill. 2023	Beijing Chunlizhengda Medi, H, swap sur rendement total	(17 319)	(1 792)
(20 000)	31 juill. 2023	Beijing Enterprises Clean En, swap sur rendement total	(226)	(10)
(12 000)	31 juill. 2023	Beijing Enterprises Water Gr, swap sur rendement total	(4 166)	161
(4 010)	31 juill. 2023	Beijing Jingneng Clean Ene, H, swap sur rendement total	(1 281)	(86)
(12 000)	31 juill. 2023	Beijing North Star Co Ltd, H, swap sur rendement total	(1 875)	52
(1 000)	31 juill. 2023	Beijing Tong Ren Tang Chines, swap sur rendement total	(1 989)	(233)
(100)	31 juill. 2023	Boc Aviation Ltd, swap sur rendement total	(1 131)	(45)
(14 000)	31 juill. 2023	Bosideng Intl Hldgs Ltd, swap sur rendement total	(9 126)	273
(2 000)	31 juill. 2023	C&D International Investment, swap sur rendement total	(7 899)	(1 389)
(131)	31 juill. 2023	Cansino Biologics Inc, H, swap sur rendement total	(1 518)	772
(4 000)	31 juill. 2023	Canvest Environmental Protec, swap sur rendement total	(2 923)	135
(4 000)	31 juill. 2023	Central China Real Estate, swap sur rendement total	(292)	(79)
(3 000)	31 juill. 2023	Central China Securities C, H, swap sur rendement total	(589)	24
(33 900)	31 juill. 2023	Cgn New Energy Holdings Co L, swap sur rendement total	(15 890)	173
(4 000)	31 juill. 2023	Cgn Power Co Ltd, H, swap sur rendement total	(1 292)	25
(500)	31 juill. 2023	China Aircraft Leasing Group, swap sur rendement total	(376)	(4)
(8 003)	31 juill. 2023	China Coal Energy Co, H, swap sur rendement total	(8 822)	1 159
(2 000)	31 juill. 2023	China Conch Venture Holdings, swap sur rendement total	(5 889)	292
(1 000)	31 juill. 2023	China Construction Bank, H, swap sur rendement total	(849)	(28)
(1 009)	31 juill. 2023	China Datang Corp Renewabl, H, swap sur rendement total	(405)	(13)
(4 003)	31 juill. 2023	China Eastern Airlines Co, H, swap sur rendement total	(2 203)	(174)
(2 000)	31 juill. 2023	China Everbright Greentech L, swap sur rendement total	(733)	(175)
(20 000)	31 juill. 2023	China Everbright Intl Ltd, swap sur rendement total	(12 117)	320
(12 000)	31 juill. 2023	China Everbright Ltd, swap sur rendement total	(12 103)	(774)
(1 000)	31 juill. 2023	China Feihe Ltd, swap sur rendement total	(1 153)	(39)
(1 000)	31 juill. 2023	China Galaxy Securities Co, H, swap sur rendement total	(661)	11
(3 600)	31 juill. 2023	China Gas Holdings Ltd, swap sur rendement total	(7 100)	(885)
(3 006)	31 juill. 2023	China High Speed Transmissio, swap sur rendement total	(1 832)	64
(459)	31 juill. 2023	China International Marine, H, swap sur rendement total	(472)	11
(10 000)	31 juill. 2023	China Jinmao Holdings Group, swap sur rendement total	(2 916)	272
(2 006)	31 juill. 2023	China Lilang Ltd, swap sur rendement total	(1 309)	(20)
(1 000)	31 juill. 2023	China Longyuan Power Group, H, swap sur rendement total	(1 656)	2
(2 000)	31 juill. 2023	China Medical System Holding, swap sur rendement total	(4 264)	(318)
(10 000)	31 juill. 2023	China Merchants Land Ltd, swap sur rendement total	(955)	(16)
(21 000)	31 juill. 2023	China Molybdenum Co Ltd, H, swap sur rendement total	(13 124)	81
(2 000)	31 juill. 2023	China Oilfield Services, H, swap sur rendement total	(3 295)	107
(1 000)	31 juill. 2023	China Power International, swap sur rendement total	(573)	(50)
(15 000)	31 juill. 2023	China Reinsurance Group Co, H, swap sur rendement total	(1 289)	6
(500)	31 juill. 2023	China Renaissance Holdings L, swap sur rendement total	(705)	(43)
(18 000)	31 juill. 2023	China Resources Cement, swap sur rendement total	(12 937)	251
(500)	31 juill. 2023	China Resources Pharmaceutic, swap sur rendement total	(549)	120
(6 000)	31 juill. 2023	China South City Holdings, swap sur rendement total	(583)	17
(2 000)	31 juill. 2023	China Tower Corp Ltd-H, swap sur rendement total	(292)	1
(500)	31 juill. 2023	Chinese Estates Holdings Ltd, swap sur rendement total	(219)	(23)
(400)	31 juill. 2023	Chow Tai Fook Jewellery Grou, swap sur rendement total	(1 105)	(149)
(1 000)	31 juill. 2023	Cofco Joycome Foods Ltd, swap sur rendement total	(387)	10
(118 000)	31 juill. 2023	Cosco Shipping Development, H, swap sur rendement total	(21 304)	484
(6 000)	31 juill. 2023	Cosco Shipping Energy Tran, H, swap sur rendement total	(6 229)	978
(24 016)	31 juill. 2023	Cosmopolitan Intl Hldgs, swap sur rendement total	(6 879)	(1 022)
(5 006)	31 juill. 2023	Cpmc Holdings Ltd, swap sur rendement total	(3 667)	118
(5 500)	31 juill. 2023	Cstone Pharmaceuticals, swap sur rendement total	(4 421)	(1 101)
(5 400)	31 juill. 2023	Dongfang Electric Corp Ltd, H, swap sur rendement total	(12 449)	(73)
(18 002)	31 juill. 2023	Dynagreen Environmental Pr, H, swap sur rendement total	(7 875)	58
(96 053)	31 juill. 2023	Esprit Holdings Ltd, swap sur rendement total	(14 007)	(1 458)
(1 136)	31 juill. 2023	Esr Cayman Ltd, swap sur rendement total	(3 230)	258
(2 000)	31 juill. 2023	Far East Consortium Internat, swap sur rendement total	(663)	(19)
(2 000)	31 juill. 2023	Flat Glass Group Co Ltd, H, swap sur rendement total	(6 555)	379
(20 000)	31 juill. 2023	Gemdale Properties And Inves, swap sur rendement total	(2 222)	(97)
(1 000)	31 juill. 2023	Great Eagle Holdings Ltd, swap sur rendement total	(2 979)	(322)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(8 000)	31 juill. 2023	Greatview Aseptic Packaging, swap sur rendement total	(2 028)	(285)
(14 000)	31 juill. 2023	Guangdong Investment Ltd, swap sur rendement total	(19 419)	(1 931)
(82 000)	31 juill. 2023	Guotai Junan International, swap sur rendement total	(10 249)	(679)
(3 370)	31 juill. 2023	Haidilao International Holdi, swap sur rendement total	(13 105)	(2 351)
(2 200)	31 juill. 2023	Haitong International Securi, swap sur rendement total	(332)	(41)
(1 200)	31 juill. 2023	Haitong Securities Co Ltd, H, swap sur rendement total	(1 000)	3
(3 000)	31 juill. 2023	Hengan Intl Group Co Ltd, swap sur rendement total	(21 587)	(2 787)
(16 500)	31 juill. 2023	Hkbn Ltd, swap sur rendement total	(14 981)	(21)
(2 013)	31 juill. 2023	Hong Kong & China Gas, swap sur rendement total	(2 593)	(265)
(50)	31 juill. 2023	Hopson Development Holdings, swap sur rendement total	(67)	(38)
(4 000)	31 juill. 2023	Huadian Power Intl Corp, H, swap sur rendement total	(2 243)	(146)
(2 000)	31 juill. 2023	Huaneng Power Intl Inc, H, swap sur rendement total	(1 281)	(27)
(2 200)	31 juill. 2023	Imax China Holding Inc, swap sur rendement total	(2 693)	(432)
(3 000)	31 juill. 2023	Ind & Comm Bk Of China, H, swap sur rendement total	(2 094)	(50)
(5 000)	31 juill. 2023	Jinchuan Group International, swap sur rendement total	(486)	28
(14 000)	31 juill. 2023	Joy City Property Ltd, swap sur rendement total	(778)	(143)
(3 000)	31 juill. 2023	Js Global Lifestyle Co Ltd, swap sur rendement total	(4 567)	(37)
(1 000)	31 juill. 2023	Kerry Properties Ltd, swap sur rendement total	(2 951)	(359)
(28 000)	31 juill. 2023	Kwg Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	(9 041)	(355)
(1 200)	31 juill. 2023	Livzon Pharmaceutical Group, H, swap sur rendement total	(5 468)	222
(4 000)	31 juill. 2023	Luoyang Glass Company Ltd, H, swap sur rendement total	(5 694)	846
(500)	31 juill. 2023	Luye Pharma Group Ltd, swap sur rendement total	(318)	(52)
(2 000)	31 juill. 2023	Maoyan Entertainment, swap sur rendement total	(3 128)	(526)
(1 000)	31 juill. 2023	Melco International Develop., swap sur rendement total	(1 469)	(376)
(4 808)	31 juill. 2023	Mgm China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(7 178)	(2 788)
(4 400)	31 juill. 2023	Midea Real Estate Holding Lt, swap sur rendement total	(9 197)	362
(5 000)	31 juill. 2023	Nine Dragons Paper Holdings, swap sur rendement total	(6 198)	(806)
(13 000)	31 juill. 2023	Nissin Foods Co Ltd, swap sur rendement total	(15 098)	(396)
(1 000)	31 juill. 2023	Pacific Textiles Holdings, swap sur rendement total	(444)	2
(10 000)	31 juill. 2023	Pccw Ltd, swap sur rendement total	(6 111)	(188)
(650)	31 juill. 2023	Pharmaron Beijing Co Ltd, H, swap sur rendement total	(6 110)	(1 083)
(1 000)	31 juill. 2023	Prada S.P.A., swap sur rendement total	(7 656)	(209)
(6 000)	31 juill. 2023	Prosperity Reit, swap sur rendement total	(2 073)	(264)
(14 000)	31 juill. 2023	Q Technology Group Co Ltd, swap sur rendement total	(10 232)	(477)
(2 000)	31 juill. 2023	Redco Properties Group Ltd, swap sur rendement total	(559)	37
(8 000)	31 juill. 2023	Regal International Airport, swap sur rendement total	(32 984)	(3 371)
(1 000)	31 juill. 2023	Road King Infrastructure Ltd, swap sur rendement total	(691)	(41)
(16 000)	31 juill. 2023	Ronshine China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(3 111)	(1 017)
(7 601)	31 juill. 2023	Sands China Ltd, swap sur rendement total	(34 176)	(4 961)
(5 000)	31 juill. 2023	S-Enjoy Service Group Co Ltd, swap sur rendement total	(7 986)	(538)
(400)	31 juill. 2023	Shandong Weigao Gp Medical, H, swap sur rendement total	(890)	(100)
(8 000)	31 juill. 2023	Shanghai Fudan-Zhangjiang, H, swap sur rendement total	(4 819)	(750)
(400)	31 juill. 2023	Shanghai Henlius Biotech I, H, swap sur rendement total	(889)	(31)
(1 000)	31 juill. 2023	Shanghai Industrial Hldg Ltd, swap sur rendement total	(1 675)	(76)
(6 000)	31 juill. 2023	Shanghai Industrial Urban De, swap sur rendement total	(687)	(138)
(2 000)	31 juill. 2023	Shangri-La Asia Ltd, swap sur rendement total	(2 222)	(536)
(2 000)	31 juill. 2023	Shenzhen Expressway Co, H, swap sur rendement total	(2 337)	(53)
(10 014)	31 juill. 2023	Shenzhen Investment Ltd, swap sur rendement total	(2 330)	(114)
(4 000)	31 juill. 2023	Shougang Fushan Resources Gr, swap sur rendement total	(1 729)	97
(29 500)	31 juill. 2023	Shui On Land Ltd, swap sur rendement total	(5 070)	(291)
(12 000)	31 juill. 2023	Shun Tak Holdings Ltd, swap sur rendement total	(3 500)	(887)
(8 000)	31 juill. 2023	Sichuan Expressway Co, H, swap sur rendement total	(2 528)	81
(1 000)	31 juill. 2023	Sihuan Pharmaceutical Hldgs, swap sur rendement total	(165)	(15)
(14 000)	31 juill. 2023	Sinopec Kantons Holdings, swap sur rendement total	(7 170)	(707)
(2 800)	31 juill. 2023	Sinopharm Group Co, H, swap sur rendement total	(9 644)	(645)
(6 000)	31 juill. 2023	Smartone Telecommunications, swap sur rendement total	(4 906)	(766)
(6 500)	31 juill. 2023	Soho China Ltd, swap sur rendement total	(1 546)	(40)
(2 000)	31 juill. 2023	Ssy Group Ltd, swap sur rendement total	(1 496)	(139)
(1 000)	31 juill. 2023	Sunvision Holdings, swap sur rendement total	(733)	(48)
(1 000)	31 juill. 2023	Sunlight Real Estate Invest, swap sur rendement total	(585)	(64)
(324)	31 juill. 2023	Super Hi International Holdi, swap sur rendement total	-	-
(2 500)	31 juill. 2023	Television Broadcasts Ltd, swap sur rendement total	(1 601)	27
(16 000)	31 juill. 2023	Tiangong Intl Co Ltd, swap sur rendement total	(8 000)	835
(2 000)	31 juill. 2023	Tong Ren Tang Technologies, H, swap sur rendement total	(1 962)	(164)
(2 000)	31 juill. 2023	Travelsky Technology Ltd, H, swap sur rendement total	(5 729)	(259)
(3 000)	31 juill. 2023	Value Partners Group Ltd, swap sur rendement total	(1 500)	(277)
(3 500)	31 juill. 2023	Venus Medtech Hangzhou Inc, H, swap sur rendement total	(8 664)	(873)
(14 000)	31 juill. 2023	Vitasoy Intl Holdings Ltd, swap sur rendement total	(39 032)	(4 354)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(34 511)	31 juill. 2023	Viva Biotech Holdings, swap sur rendement total	(10 485)	(445)
(8 000)	31 juill. 2023	Vobile Group Ltd, swap sur rendement total	(4 666)	169
(2 000)	31 juill. 2023	Vpower Group International, H, swap sur rendement total	(158)	20
(300)	31 juill. 2023	Vtech Holdings Ltd, swap sur rendement total	(2 620)	(30)
(1 000)	31 juill. 2023	Want Want China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(908)	14
(62 667)	31 juill. 2023	We Solutions Ltd, swap sur rendement total	(2 622)	708
(17 600)	31 juill. 2023	Wynn Macau Ltd, swap sur rendement total	(26 582)	(8 309)
(15 197)	31 juill. 2023	Yichang Hec Changjiang Pha, H, swap sur rendement total	(17 148)	(259)
(43 435)	31 juill. 2023	Yuexiu Real Estate Investmen, swap sur rendement total	(14 855)	(479)
(6 000)	31 juill. 2023	Zhejiang Expressway Co, H, swap sur rendement total	(6 260)	(193)
(2 000)	31 juill. 2023	Zhuguang Holdings Group Co, swap sur rendement total	(312)	(83)
(4 099)	31 juill. 2023	Zhuzhou Crrc Times Electri, H, swap sur rendement total	(27 574)	(1 937)
(41 200)	31 juill. 2023	Zoomlion Heavy Industry, H, swap sur rendement total	(26 392)	(338)
				<u>(60 813)</u>
Yen japonais – taux moyen du financement à un jour offert à Tokyo (TONAR)				
(100)	31 juill. 2023	Daido Metal Co Ltd, swap sur rendement total	(490)	17
(200)	31 juill. 2023	Em Systems Co Ltd, swap sur rendement total	(1 672)	357
(200)	31 juill. 2023	Enigmo Inc, swap sur rendement total	(1 310)	(84)
(100)	31 juill. 2023	Exedy Corp, swap sur rendement total	(1 659)	53
(100)	31 juill. 2023	Funai Soken Holdings Inc, swap sur rendement total	(2 791)	79
(100)	31 juill. 2023	Goldcrest Co Ltd, swap sur rendement total	(1 726)	76
(200)	31 juill. 2023	Gree Inc, swap sur rendement total	(1 429)	148
(100)	31 juill. 2023	Hibiya Engineering Ltd, swap sur rendement total	(1 956)	(10)
(300)	31 juill. 2023	Ichiyoshi Securities Co Ltd, swap sur rendement total	(1 898)	(12)
(100)	31 juill. 2023	Idom Inc, swap sur rendement total	(682)	50
(100)	31 juill. 2023	Intage Holdings Inc, swap sur rendement total	(1 415)	158
(200)	31 juill. 2023	Japan Material Co Ltd, swap sur rendement total	(4 389)	606
(100)	31 juill. 2023	Japan Post Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(1 139)	(33)
(200)	31 juill. 2023	Justsystems Corp, swap sur rendement total	(5 786)	990
(100)	31 juill. 2023	Kokuyo Co Ltd, swap sur rendement total	(1 908)	(53)
(100)	31 juill. 2023	Max Co Ltd, swap sur rendement total	(2 002)	112
(400)	31 juill. 2023	Mito Securities Co Ltd, swap sur rendement total	(875)	53
(100)	31 juill. 2023	Mitsubishi Ufj Financial Gro, swap sur rendement total	(913)	(96)
(100)	31 juill. 2023	Mitsuuroko Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(1 169)	(80)
(100)	31 juill. 2023	Nippon Densetsu Kogyo Co Ltd, swap sur rendement total	(1 611)	129
(100)	31 juill. 2023	Ns Tool Co Ltd, swap sur rendement total	(1 058)	100
(100)	31 juill. 2023	Okuwa Co Ltd, swap sur rendement total	(911)	56
(100)	31 juill. 2023	Optim Corp, swap sur rendement total	(1 040)	153
(91)	31 juill. 2023	Rohto Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(2 168)	2 025
(100)	31 juill. 2023	Sac'S Bar Holdings Inc, swap sur rendement total	(794)	28
(100)	31 juill. 2023	Takamiya Co Ltd, swap sur rendement total	(382)	13
(100)	31 juill. 2023	Toda Corp, swap sur rendement total	(729)	23
(100)	31 juill. 2023	Tokyu Corp, swap sur rendement total	(1 708)	88
(100)	31 juill. 2023	Toray Industries Inc, swap sur rendement total	(756)	7
(100)	31 juill. 2023	Trancom Co Ltd, swap sur rendement total	(7 589)	544
(100)	31 juill. 2023	Ts Tech Co Ltd, swap sur rendement total	(1 556)	83
				<u>5 580</u>
Dollar néo-zélandais – taux du marché des acceptations bancaires (BKBM) à 1 mois				
(246)	31 juill. 2023	Fisher & Paykel Healthcare C, swap sur rendement total	(4 764)	231
(8 354)	31 juill. 2023	Kiwi Property Group Ltd, swap sur rendement total	(6 515)	163
(949)	31 juill. 2023	Meridian Energy Ltd, swap sur rendement total	(4 261)	(265)
(9 034)	31 juill. 2023	Pacific Edge Ltd, swap sur rendement total	(3 871)	(297)
(2 463)	31 juill. 2023	Precinct Properties New Zeal, swap sur rendement total	(2 670)	41
(101)	31 juill. 2023	Restaurant Brands Nz Ltd, swap sur rendement total	(498)	76
(180)	31 juill. 2023	Sanford Limited, swap sur rendement total	(632)	53
(418)	31 juill. 2023	Serko Ltd, swap sur rendement total	(806)	61
(1 404)	31 juill. 2023	Stride Property Group, swap sur rendement total	(1 708)	89
				<u>152</u>
Dollar de Singapour – taux interbancaire offert à Singapour (SIBOR) à 1 mois				
(700)	31 juill. 2023	Aims Apac Reit, swap sur rendement total	(877)	(26)
(500)	31 juill. 2023	Capitaland Ascendas Reit, swap sur rendement total	(1 384)	30
(11 800)	31 juill. 2023	Capitaland Ascott Trust, swap sur rendement total	(12 517)	(1 132)
(3 900)	31 juill. 2023	Capitaland China Trust, swap sur rendement total	(4 413)	50
(6 965)	31 juill. 2023	Esr-Reit, swap sur rendement total	(2 603)	(152)
(10 100)	31 juill. 2023	Far East Hospitality Trust, swap sur rendement total	(6 326)	34
(1 072)	31 juill. 2023	Frasers Centrepoint Trust, swap sur rendement total	(2 274)	(63)
(6 887)	31 juill. 2023	Frasers Hospitality Trust, swap sur rendement total	(3 096)	7
(1 400)	31 juill. 2023	Frasers Logistics & Industrial Trust, swap sur rendement total	(1 641)	(23)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(300)	31 juill. 2023	Ho Bee Land Ltd, swap sur rendement total	(736)	5
(600)	31 juill. 2023	Keppel De Reit, swap sur rendement total	(1 073)	52
(604)	31 juill. 2023	Keppel Infrastructure Trust, swap sur rendement total	(330)	1
(500)	31 juill. 2023	Mapletree Pan Asia Comm, swap sur rendement total	(844)	23
(1 000)	31 juill. 2023	Oue Commercial Real Estate I, swap sur rendement total	(338)	31
(600)	31 juill. 2023	Oue Ltd, swap sur rendement total	(758)	9
(900)	31 juill. 2023	Q & M Dental Group Singapore, swap sur rendement total	(286)	10
(12 400)	31 juill. 2023	Raffles Medical Group Ltd, swap sur rendement total	(17 538)	(446)
(560)	31 juill. 2023	Sats Ltd, swap sur rendement total	(1 607)	(52)
(800)	31 juill. 2023	Starhill Global Reit, swap sur rendement total	(436)	(7)
(1 200)	31 juill. 2023	Suntec Reit, swap sur rendement total	(1 673)	17
				(1 632)
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
(696)	31 juill. 2023	Attacq Ltd, swap sur rendement total	(416)	10
(470)	31 juill. 2023	Fortress Reit Ltd-A, swap sur rendement total	(393)	23
(945)	31 juill. 2023	Kap Industrial Holdings Ltd, swap sur rendement total	(334)	4
(7)	31 juill. 2023	Kumba Iron Ore Ltd, swap sur rendement total	(274)	(7)
(19)	31 juill. 2023	Naspers Ltd, actions, N, swap sur rendement total	(4 273)	(225)
(100)	31 juill. 2023	Resilient Reit Ltd, swap sur rendement total	(428)	(1)
(80)	31 juill. 2023	Woolworths Holdings Ltd, swap sur rendement total	(423)	6
				(190)
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
(486)	31 juill. 2023	Aak Ab, swap sur rendement total	(11 240)	(236)
(278)	31 juill. 2023	Addlife Ab-B, swap sur rendement total	(3 926)	(20)
(1 329)	31 juill. 2023	Afry Ab, swap sur rendement total	(29 535)	299
(11)	31 juill. 2023	Axfood Ab, swap sur rendement total	(409)	(5)
(33)	31 juill. 2023	Bactiguard Holding Ab, swap sur rendement total	(474)	–
(15)	31 juill. 2023	Better Collective A/S, swap sur rendement total	(248)	19
(349)	31 juill. 2023	Bilia Ab, actions, A, swap sur rendement total	(5 187)	139
(14)	31 juill. 2023	Bioarctic Ab, swap sur rendement total	(495)	48
(84)	31 juill. 2023	Boliden Ab, swap sur rendement total	(4 274)	51
(671)	31 juill. 2023	Bonava Ab, action B, swap sur rendement total	(2 567)	(129)
(32)	31 juill. 2023	Bulten Ab, swap sur rendement total	(248)	34
(1 336)	31 juill. 2023	Bygghemma Group First Ab, swap sur rendement total	(3 226)	344
(723)	31 juill. 2023	Castellum Ab, swap sur rendement total	(12 049)	(47)
(110)	31 juill. 2023	Catena Ab, swap sur rendement total	(5 559)	(313)
(413)	31 juill. 2023	Cellavision Ab, swap sur rendement total	(12 299)	(355)
(512)	31 juill. 2023	Dios Fastigheter Ab, swap sur rendement total	(5 023)	120
(771)	31 juill. 2023	Duni Ab, swap sur rendement total	(8 642)	1 228
(602)	31 juill. 2023	Embracer Group Ab, swap sur rendement total	(3 702)	48
(19)	31 juill. 2023	Epiroc Ab, A, swap sur rendement total	(469)	12
(23)	31 juill. 2023	Fabege Ab, swap sur rendement total	(265)	(4)
(36)	31 juill. 2023	Fastighets Ab Balder, actions, B, swap sur rendement total	(227)	(10)
(34)	31 juill. 2023	Fingerprint Cards Ab, B, swap sur rendement total	(13)	1
(138)	31 juill. 2023	Fingerprint Cards Ab, B, swap sur rendement total	–	–
(527)	31 juill. 2023	Granges Ab, swap sur rendement total	(5 846)	(44)
(129)	31 juill. 2023	Holmen Ab, actions, B, swap sur rendement total	(6 943)	286
(118)	31 juill. 2023	Husqvarna Ab, actions, B, swap sur rendement total	(1 122)	78
(76)	31 juill. 2023	Jm Ab, swap sur rendement total	(1 701)	(27)
(344)	31 juill. 2023	Kambi Group Plc, swap sur rendement total	(8 488)	141
(155)	31 juill. 2023	K-Fast Holding Ab, swap sur rendement total	(474)	(37)
(13)	31 juill. 2023	Know It Ab, swap sur rendement total	(345)	1
(12)	31 juill. 2023	Mycronic Ab, swap sur rendement total	(306)	6
(289)	31 juill. 2023	Ncc Ab, actions, B, swap sur rendement total	(3 655)	140
(835)	31 juill. 2023	Nolato Ab, actions, B, swap sur rendement total	(5 934)	113
(1 891)	31 juill. 2023	Pandex Ab, swap sur rendement total	(28 623)	3 529
(20)	31 juill. 2023	Powercell Sweden Ab, swap sur rendement total	(310)	15
(394)	31 juill. 2023	Pricer Ab, actions, B, swap sur rendement total	(838)	57
(17)	31 juill. 2023	Saab Ab, B, swap sur rendement total	(908)	24
(2 552)	31 juill. 2023	Sinch Ab, swap sur rendement total	(12 687)	(1 318)
(1 814)	31 juill. 2023	Ssab Ab, actions, B, swap sur rendement total	(12 785)	1 006
(50)	31 juill. 2023	Ssab Ab, actions, A, swap sur rendement total	(370)	20
(3 960)	31 juill. 2023	Stillfront Group Ab, swap sur rendement total	(9 022)	(716)
(145)	31 juill. 2023	Storytel Ab, swap sur rendement total	(834)	(27)
(21)	31 juill. 2023	Svenska Cellulosa Ab Sca, B, swap sur rendement total	(360)	31
(1 219)	31 juill. 2023	Svenska Handelsbanken, actions, A, swap sur rendement total	(16 660)	934
(29)	31 juill. 2023	Tele2 Ab, actions, B, swap sur rendement total	(321)	27
(24)	31 juill. 2023	Trelleborg Ab, actions, B, swap sur rendement total	(752)	43

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(20)	31 juill. 2023	Troax Group Ab, swap sur rendement total	(475)	13
(30)	31 juill. 2023	Vitec Software Group Ab, actions, B, swap sur rendement total	(1 631)	(95)
(382)	31 juill. 2023	Vitrolife Ab, swap sur rendement total	(9 250)	(10)
				<u>5 414</u>
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
(322)	31 juill. 2023	Adecco Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(14 364)	661
(79)	31 juill. 2023	Allreal Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(17 401)	(358)
(286)	31 juill. 2023	Arbonia Ag, swap sur rendement total	(5 411)	317
(135)	31 juill. 2023	Baloise Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(28 213)	(81)
(4)	31 juill. 2023	Bkw Ag, swap sur rendement total	(741)	–
(193)	31 juill. 2023	Cie Financière Richemont, actions ord., swap sur rendement total	(33 889)	1 173
(43)	31 juill. 2023	Clariant Ag, actions ord., swap sur rendement total	(923)	35
(100)	31 juill. 2023	Coltene Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(11 159)	(172)
(2 420)	31 juill. 2023	Evolva Holding Sa, swap sur rendement total	(291)	(13)
(1 453)	31 juill. 2023	Gam Holding Ag, swap sur rendement total	(2 000)	(202)
(32)	31 juill. 2023	Geberit Ag, actions ord., swap sur rendement total	(20 409)	921
(53)	31 juill. 2023	Gurit Holding Ag-Br, swap sur rendement total	(6 986)	500
(48)	31 juill. 2023	Julius Baer Group Ltd, swap sur rendement total	(3 786)	3
(82)	31 juill. 2023	Kuehne + Nagel Intl Ag, actions ord., swap sur rendement total	(25 843)	1 619
(107)	31 juill. 2023	Logitech International, actions ord., swap sur rendement total	(8 941)	(112)
(375)	31 juill. 2023	Meyer Burger Technology Ag, swap sur rendement total	(32)	(32)
(1 211)	31 juill. 2023	Meyer Burger Technology Ag, swap sur rendement total	(950)	(55)
(22)	31 juill. 2023	Mobimo Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(7 604)	(185)
(56)	31 juill. 2023	Schindler Holding, cert. de participation, swap sur rendement total	(14 262)	281
(14)	31 juill. 2023	Sgs Sa- actions ord., swap sur rendement total	(44 081)	1 026
(71)	31 juill. 2023	Sig Combibloc Group Ag, swap sur rendement total	(2 100)	53
(113)	31 juill. 2023	Sika Ag, actions ord., swap sur rendement total	(36 689)	2 546
(454)	31 juill. 2023	Softwareone Holding Ag, swap sur rendement total	(8 717)	618
(13)	31 juill. 2023	Straumann Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(2 010)	39
(4)	31 juill. 2023	Swatch Group Ag/The, Br, swap sur rendement total	(1 541)	(77)
(62)	31 juill. 2023	Swiss Re Ag, swap sur rendement total	(7 852)	(56)
(14)	31 juill. 2023	Temenos Ag, actions ord., swap sur rendement total	(1 040)	111
(110)	31 juill. 2023	Ubs Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(2 772)	13
(9)	31 juill. 2023	Vat Group Ag, swap sur rendement total	(3 332)	223
				<u>8 796</u>
Dollar américain – taux interbancaire offert à Londres (ICE LIBOR) à 1 mois				
(24)	31 juill. 2023	Ace Technologies Corp, swap sur rendement total	(173)	(45)
(1 900)	31 juill. 2023	Aes Brasil Energia Sa, swap sur rendement total	(4 704)	371
(100)	31 juill. 2023	Alpargatas Sa, actions priv., swap sur rendement total	(387)	199
(1 900)	31 juill. 2023	Alupar Investimento Sa, parts, swap sur rendement total	(13 753)	(398)
(4 600)	31 juill. 2023	Americanas Sa, swap sur rendement total	(11 378)	1 038
(950)	31 juill. 2023	Ananti Inc, swap sur rendement total	(6 822)	(575)
(100)	31 juill. 2023	Becele Sab De Cv, swap sur rendement total	(295)	1
(245)	31 juill. 2023	Boryung Pharmaceutical Co, swap sur rendement total	(2 386)	305
(1 125)	31 juill. 2023	Bukwang Pharmaceutical Co, swap sur rendement total	(10 582)	(1 347)
(53)	31 juill. 2023	Cafe24 Corp, swap sur rendement total	(562)	132
(5 300)	31 juill. 2023	Camil Alimentos Sa, swap sur rendement total	(11 248)	1 201
(197)	31 juill. 2023	Celllivery Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(2 541)	(10)
(859)	31 juill. 2023	Celltrion Healthcare Co Ltd, swap sur rendement total	(53 560)	1 606
(31)	31 juill. 2023	Celltrion Inc, swap sur rendement total	(5 349)	(5)
(358)	31 juill. 2023	Celltrion Pharm Inc, swap sur rendement total	(25 747)	(2 496)
(300)	31 juill. 2023	Centro De Imagem Diagnostico, swap sur rendement total	(1 661)	(104)
(50)	31 juill. 2023	Cheil Worldwide Inc, swap sur rendement total	(1 239)	(31)
(4)	31 juill. 2023	Chong Kun Dang Pharma, swap sur rendement total	(353)	(10)
(1 000)	31 juill. 2023	Chun Yuan Steel Industry Co, swap sur rendement total	(703)	(5)
(300)	31 juill. 2023	Cia Brasileira De Distribuic, swap sur rendement total	(1 270)	331
(4 000)	31 juill. 2023	Cia De Transmissao De Ene, actions priv., swap sur rendement total	(23 581)	214
(100)	31 juill. 2023	Cia Ferro Ligas Da Bahia, Fe, swap sur rendement total	(1 371)	83
(27 500)	31 juill. 2023	Cielo Sa, swap sur rendement total	(37 561)	(3 962)
(3)	31 juill. 2023	Cj Cheiljedang Corp, swap sur rendement total	(1 227)	(31)
(2 600)	31 juill. 2023	Cogna Educacional Sa, swap sur rendement total	(1 413)	82
(463)	31 juill. 2023	Consortio Ara S.A.B., série *, swap sur rendement total	(103)	–
(3 700)	31 juill. 2023	Construtora Tenda Sa, swap sur rendement total	(4 002)	191
(5 800)	31 juill. 2023	Cosan Sa Industria Comercio, swap sur rendement total	(25 451)	1 800
(400)	31 juill. 2023	Cpfl Energia Sa, swap sur rendement total	(3 404)	200
(518)	31 juill. 2023	Crystalgenomics Inc, swap sur rendement total	(1 949)	(42)
(165)	31 juill. 2023	Cuckoo Homesys Co Ltd, swap sur rendement total	(5 215)	212
(6 300)	31 juill. 2023	Cyrela Brazil Realty Sa Emp, swap sur rendement total	(21 106)	2 138

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(95)	31 juill. 2023	Dairy Farm Intl Hldgs Ltd, swap sur rendement total	(377)	(47)
(1 000)	31 juill. 2023	Da-Li Development Co Ltd, swap sur rendement total	(1 305)	(26)
(20)	31 juill. 2023	Dawonsys Co Ltd, swap sur rendement total	(305)	49
(71)	31 juill. 2023	Doosan Fuel Cell Co Ltd, swap sur rendement total	(2 240)	175
(60)	31 juill. 2023	Doosan Heavy Industries, swap sur rendement total	(993)	34
(206)	31 juill. 2023	Duk San Neolux Co Ltd, swap sur rendement total	(8 659)	(324)
(1 500)	31 juill. 2023	El Puerto De Liverpool, C1, swap sur rendement total	(11 988)	(92)
(1 000)	31 juill. 2023	Engie Brasil Energia Sa, swap sur rendement total	(9 709)	277
(114)	31 juill. 2023	Eo Technics Co Ltd, swap sur rendement total	(8 162)	81
(4 000)	31 juill. 2023	Even Construtora E Inco Sa, swap sur rendement total	(4 850)	619
(5 200)	31 juill. 2023	Ez Tec Empreendimentos E Par, swap sur rendement total	(17 900)	2 197
(147)	31 juill. 2023	Fila Korea Ltd, swap sur rendement total	(5 254)	(305)
(2 200)	31 juill. 2023	Gaec Educacao Sa, swap sur rendement total	(2 177)	335
(348)	31 juill. 2023	Genexine Co Ltd, swap sur rendement total	(6 996)	430
(30)	31 juill. 2023	Green Cross Corp, swap sur rendement total	(4 176)	(184)
(408)	31 juill. 2023	Green Cross Holdings Corp, swap sur rendement total	(7 456)	(269)
(2 600)	31 juill. 2023	Grendene Sa, swap sur rendement total	(4 019)	395
(15)	31 juill. 2023	Grupo Aeroport Del Sureste, B, swap sur rendement total	(474)	30
(600)	31 juill. 2023	Grupo Cementos Chihuahua, swap sur rendement total	(5 441)	441
(1 600)	31 juill. 2023	Grupo De Moda Soma Sa, swap sur rendement total	(4 159)	179
(100)	31 juill. 2023	Grupo Herdez Sab-série *, swap sur rendement total	(304)	(25)
(1 300)	31 juill. 2023	Grupo Mexico Sab De Cv, série B, swap sur rendement total	(6 185)	1 024
(300)	31 juill. 2023	Grupo Rotoplas Sab De Cv, swap sur rendement total	(657)	10
(2 100)	31 juill. 2023	Grupo Traxion Sab De Cv, swap sur rendement total	(3 939)	197
(315)	31 juill. 2023	Hanall Biopharma Co Ltd, swap sur rendement total	(6 028)	(1 424)
(165)	31 juill. 2023	Hanon Systems, swap sur rendement total	(1 435)	28
(27)	31 juill. 2023	Hansae Co Ltd, swap sur rendement total	(447)	21
(229)	31 juill. 2023	Hanssem Co Ltd, swap sur rendement total	(10 980)	17
(41 600)	31 juill. 2023	Hapvida Participacoes E Inve, swap sur rendement total	(54 167)	1 251
(113)	31 juill. 2023	Hdc Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(667)	(3)
(347)	31 juill. 2023	Hdc Hyundai Development Co, E, swap sur rendement total	(3 730)	204
(404)	31 juill. 2023	Helixmith Co Ltd, swap sur rendement total	(4 582)	839
(764)	31 juill. 2023	Hlb Inc, swap sur rendement total	(23 325)	1 180
(68 750)	31 juill. 2023	Hoteles City Express Sab De, swap sur rendement total	(40 306)	(7 059)
(106)	31 juill. 2023	Hyosung Corporation, swap sur rendement total	(7 646)	658
(445)	31 juill. 2023	Hyundai Greenfood Co Ltd, swap sur rendement total	(3 220)	(61)
(727)	31 juill. 2023	Hyundai Merchant Marine, swap sur rendement total	(15 279)	1 212
(6)	31 juill. 2023	Hyundai Robotics Co Ltd, swap sur rendement total	(368)	28
(101)	31 juill. 2023	Ilyang Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(2 101)	(329)
(106)	31 juill. 2023	Imarketkorea Inc, swap sur rendement total	(2 302)	30
(550)	31 juill. 2023	Industrias Romi Sa, swap sur rendement total	(2 179)	(196)
(300)	31 juill. 2023	Instituto Hermes Pardini Sa, swap sur rendement total	(1 629)	188
(5 675)	31 juill. 2023	International Meal Company, swap sur rendement total	(4 073)	(714)
(900)	31 juill. 2023	Irani Sa, swap sur rendement total	(1 857)	157
(115)	31 juill. 2023	Is Dongseo Co Ltd, swap sur rendement total	(3 486)	528
(44)	31 juill. 2023	Itm Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	(1 239)	156
(14 600)	31 juill. 2023	Jhsf Participacoes Sa, swap sur rendement total	(18 786)	1 441
(26)	31 juill. 2023	Kcc Corp, swap sur rendement total	(5 716)	638
(32)	31 juill. 2023	Kolmar Bnh Co Ltd, swap sur rendement total	(974)	(195)
(124)	31 juill. 2023	Kolmar Korea Co Ltd, swap sur rendement total	(5 679)	(721)
(266)	31 juill. 2023	Komipharm International Co, swap sur rendement total	(1 999)	98
(1 000)	31 juill. 2023	Kuoyang Construction, swap sur rendement total	(791)	59
(5)	31 juill. 2023	L&F Co Ltd, swap sur rendement total	(933)	178
(4)	31 juill. 2023	Lg Electronics Inc, swap sur rendement total	(372)	66
(1)	31 juill. 2023	Lg Innotek Co Ltd, swap sur rendement total	(271)	41
(100)	31 juill. 2023	Localiza Rent A Car, swap sur rendement total	(1 373)	149
(7 200)	31 juill. 2023	Locaweb Servicios De Internet, swap sur rendement total	(12 955)	2 641
(500)	31 juill. 2023	Log-In Logistica Intermodal, swap sur rendement total	(4 498)	(564)
(5 400)	31 juill. 2023	Magazine, swap sur rendement total	(3 792)	949
(7 000)	31 juill. 2023	Magazine Luiza Sa, swap sur rendement total	(3 660)	566
(1 500)	31 juill. 2023	Marisa Lojas Sa, swap sur rendement total	(481)	91
(14)	31 juill. 2023	Medpacto Inc, swap sur rendement total	(335)	5
(273)	31 juill. 2023	Mezzion Pharma Co Ltd, swap sur rendement total	(3 815)	(292)
(4 383)	31 juill. 2023	Mirae Asset Daewoo Co Ltd, swap sur rendement total	(28 648)	1 359
(2 300)	31 juill. 2023	Movida Participacoes Sa, swap sur rendement total	(4 594)	449
(2 800)	31 juill. 2023	Multilaser Industrial Sa, swap sur rendement total	(2 892)	(499)
(75)	31 juill. 2023	Nasmedia Co Ltd, swap sur rendement total	(10 320)	(1 538)
(100)	31 juill. 2023	Nepes Corp, swap sur rendement total	(1 682)	302

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(48)	31 juill. 2023	Netmarble Corp, swap sur rendement total	(3 117)	(697)
(1 000)	31 juill. 2023	Newmax Technology Co Ltd, swap sur rendement total	(1 228)	229
(1 815)	31 juill. 2023	Nh Investment & Securities C, swap sur rendement total	(17 112)	872
(142)	31 juill. 2023	Nkmax Co Ltd, swap sur rendement total	(2 091)	111
(6)	31 juill. 2023	Oci Co Ltd, swap sur rendement total	(521)	63
(5 900)	31 juill. 2023	Odontoprev Sa, swap sur rendement total	(13 656)	(756)
(2 600)	31 juill. 2023	Omega Energia Sa, swap sur rendement total	(6 398)	300
(800)	31 juill. 2023	Operadora De Sites Mex, A-1, swap sur rendement total	(1 067)	124
(326)	31 juill. 2023	Optoelectronics Solutions Co, swap sur rendement total	(6 168)	(711)
(1 200)	31 juill. 2023	Orbia Advance Corp Sab De Cv, swap sur rendement total	(2 879)	120
(300)	31 juill. 2023	Ptt Pcl, swap sur rendement total	(390)	(6)
(45)	31 juill. 2023	Rfhic Corp, swap sur rendement total	(1 086)	(24)
(3)	31 juill. 2023	Samsung Sds Co Ltd, swap sur rendement total	(397)	(2)
(437)	31 juill. 2023	Samsung Securities Co Ltd, swap sur rendement total	(14 775)	962
(61)	31 juill. 2023	Seegene Inc, swap sur rendement total	(1 784)	126
(724)	31 juill. 2023	Seobu T&D, swap sur rendement total	(6 024)	(621)
(63)	31 juill. 2023	Seojin System Co Ltd, swap sur rendement total	(1 185)	(121)
(80)	31 juill. 2023	Seoul Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	(869)	44
(1 200)	31 juill. 2023	Ser Educacional Sa, swap sur rendement total	(1 375)	318
(100)	31 juill. 2023	Siam Commercial Bank Pub Co, swap sur rendement total	(419)	(14)
(3 700)	31 juill. 2023	Sinqia Sa, swap sur rendement total	(14 254)	1 751
(200)	31 juill. 2023	Sk Discovery Co Ltd, swap sur rendement total	(6 504)	76
(12)	31 juill. 2023	Sk Innovation Co Ltd, swap sur rendement total	(1 987)	214
(203)	31 juill. 2023	Sk Networks Co Ltd, swap sur rendement total	(845)	28
(1 000)	31 juill. 2023	Slc Agricola Sa, swap sur rendement total	(12 113)	(529)
(134)	31 juill. 2023	S-Oil Corp, swap sur rendement total	(12 014)	1
(336)	31 juill. 2023	Ssangyong Cement Ind, swap sur rendement total	(2 081)	8
(239)	31 juill. 2023	St Pharm Co Ltd, swap sur rendement total	(22 507)	(3 786)
(3 400)	31 juill. 2023	Tegma Gestao Logistica, swap sur rendement total	(16 889)	792
(3 941)	31 juill. 2023	Telcon Rf Pharmaceutical Inc, swap sur rendement total	(4 300)	380
(248)	31 juill. 2023	Toptec Co Ltd, swap sur rendement total	(1 741)	235
(100)	31 juill. 2023	Totvs Sa, swap sur rendement total	(708)	92
(2 900)	31 juill. 2023	Transmissora Alianca De, parts, swap sur rendement total	(25 771)	(11)
(1 600)	31 juill. 2023	Trisul Sa, swap sur rendement total	(1 411)	111
(2 700)	31 juill. 2023	Unifin Financiera Sab De Cv, swap sur rendement total	(225)	3
(700)	31 juill. 2023	Vivara Participacoes Sa, swap sur rendement total	(4 024)	(67)
(80)	31 juill. 2023	Wonik Ips Co Ltd, swap sur rendement total	(2 129)	156
(142)	31 juill. 2023	Woongjin Coway Co Ltd, swap sur rendement total	(8 533)	(237)
(64)	31 juill. 2023	Yungjin Pharmaceutical Co, swap sur rendement total	(224)	6
(89)	31 juill. 2023	Zinus Inc, swap sur rendement total	(3 349)	(379)
				<u>7 339</u>
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position vendeur		<u>34 058</u>
		Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total		<u>335 931</u>
		Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total		<u>(380 013)</u>
		Plus-value (moins-value) latente des swaps sur rendement total, montant net		<u>(44 082)</u>

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2022 et 2021

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 31 décembre 2022

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

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

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2022 et 2021

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 les exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021, les changements aux parts en circulation ont été les suivants :

	Solde à l'ouverture de l'exercice	Parts rachetables émises	Parts rachetables réinvesties	Parts rachetables rachetées	Solde à la clôture de l'exercice
2022					
Série A	13 355	1 377	743	(1 255)	14 220
Série F	321 623	20 845	9 858	(164 828)	187 498
Série I	1 970 842	49	136 669	(273 588)	1 833 972
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
31 décembre 2022 et 2021

Imposition du Fonds (note 7)

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

Au cours de l'exercice, 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 31 décembre 2022, CCLFGII détenait 1 747 173 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 17 820 990 \$ (1 883 286 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 23 051 421 \$ en 2021). Au 31 décembre 2022, GFCC&L détenait 6 649 parts de série A, 6 892 parts de série F et 7 260 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 68 677 \$, 70 966 \$ et 74 051 \$ (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 \$ en 2021).

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

Le Fonds a payé 53 834 \$ (65 464 \$ en 2021) en commissions de courtage et autres coûts de transactions relativement à des opérations de portefeuille durant l'exercice. Les paiements indirects effectués pour l'exercice se sont établis à 7 124 \$ (7 159 \$ en 2021).

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2022 et 2021

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises aux 31 décembre 2022 et 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 31 décembre 2022

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

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2022 et 2021

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

Aux 31 décembre 2022 et 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

Aux 31 décembre 2022 et 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 1 885 000 \$ (2 746 000 \$ en 2021). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Risque de crédit

Aux 31 décembre 2022 et 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 1,7 % (2,0 % en 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
31 décembre 2022 et 2021

Prêt de titre (note 12)

Pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2022	2021
	(\$)	(\$)
Revenus bruts tirés du prêt de titres	2 167	2 101
Charges liées au prêt de titres	(427)	(418)
Revenus nets tirés du prêt de titres	1 740	1 683
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	(154)	(53)
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	1 586	1 630

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 aux 31 décembre 2022 et 2021.

	31 décembre 2022	31 décembre 2021
	(en milliers de \$)	(en milliers de \$)
Titres prêtés	848	1 157
Garanties reçues	890	1 215
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Effet de levier et emprunt (note 13)

Au cours des exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié entre 62,1 % et 79,8 % (entre 62,8 % et 86,3 % 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 31 décembre 2022, l'exposition totale du Fonds correspondait à 73,0 % (63,4 % en 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 des exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de 1 873 990 \$ à 4 792 875 \$ (de 2 156 117 \$ à 5 337 261 \$ en 2021), avec un taux d'intérêt moyen de 1,95 % (0,42 % en 2021). Au 31 décembre 2022, les emprunts en trésorerie correspondaient à 15,7 % (8,5 % en 2021) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2022 et 2021

Événements postérieurs à la date de clôture (note 14)

Après la clôture de l'exercice, les porteurs de parts du Fonds ont approuvé des modifications aux frais de gestion et à la rémunération au rendement du Fonds et des modifications aux objectifs de placement du Fonds. Dans le cadre des modifications aux objectifs de placement du Fonds, le nom du Fonds sera changé pour CC&L Global Market Neutral II Fund. Les modifications aux frais de gestion et à la rémunération au rendement du Fonds sont présentées ci-après.

Série	Frais de gestion actuels	Frais de gestion proposés	Rémunération au rendement actuelle	Rémunération au rendement proposée
A	1,50 %	1,90 %	20 % de l'excédent du rendement total des parts de série A sur un taux de rendement minimal, qui correspond au rendement de l'indice MSCI Monde (tous pays, CAD, rendement net).	20 % du rendement net positif des parts de série A pour le trimestre civil, avec un rendement de référence perpétuel.
F	0,50 %	0,90 %	20 % de l'excédent du rendement total des parts de série F sur un taux de rendement minimal, qui correspond au rendement de l'indice MSCI Monde (tous pays, CAD, rendement net).	20 % du rendement net positif des parts de série F pour le trimestre civil, avec un rendement de référence perpétuel.

Ces modifications, ainsi que les modifications aux objectifs de placement, sont décrites en détail dans une circulaire de la direction disponible sur le Système électronique de données, d'analyse et de recherche (SEDAR). Les modifications devraient entrer en vigueur le 23 mars 2023 ou vers de cette date.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

États de la situation financière

Aux 31 décembre

	2022	2021
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	2 409 454 \$	804 922 \$
Placements	22 962 988	30 488 282
Plus-value latente des contrats de change à terme	22 253	11 691
Plus-value latente des contrats de swap	320 991	594 701
Marge de variation quotidienne	2 029 587	2 111 450
Montant à recevoir du courtier	579 416	831 590
Dividendes à recevoir	60 755	73 502
Autres créances	205	–
	28 385 649	34 916 138
Passif		
Passif courant		
Dettes bancaires	3 388 108	1 915 637
Placements vendus à découvert	5 619 834	6 738 464
Moins-value latente des contrats de change à terme	1 727	7 123
Moins-value latente des contrats de swap	320 346	460 255
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	14 881	6 418
Montant à payer au courtier	472 464	845 888
Frais d'emprunt de titres à payer	6 277	883
Charges à payer	59 483	34 280
Frais de gestion à payer	2 074	816
Rémunération au rendement à payer	5 991	3 446
	9 891 185	10 013 210
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18 494 464 \$	24 902 928 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	483 210 \$	491 333 \$
Série F	3 195 816 \$	423 659 \$
Série I	14 815 438 \$	23 987 936 \$
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	48 055	41 855
Série F	313 938	35 406
Série I	1 454 887	2 004 975
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	10,06 \$	11,74 \$
Série F	10,18 \$	11,97 \$
Série I	10,18 \$	11,96 \$

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

Administrateur

« Tim Elliott »

Administrateur

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

États du résultat global

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2022	2021
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	(60 945) \$	171 795 \$
Variation du gain (perte) de change latent	22 176	(142 422)
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	2 626	3 562
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	705 621	656 812
Charges de dividende sur les titres vendus à découvert	(117 492)	(66 996)
Intérêts aux fins des distributions	29 765	1 214
Gain (perte) net réalisé sur les placements	1 049 841	3 323 560
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	669 814	(499 182)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	(66 724)	(4 371)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	133 064	(23 411)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	153 880	1 217 455
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	(3 277 768)	1 558 046
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	188 063	731 373
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	15 958	(638)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	(133 801)	52 161
Gain (perte) net total sur placements	<u>(649 779)</u>	<u>6 946 023</u>
Total des revenus (pertes) nets	<u>(685 922)</u>	<u>6 978 958</u>
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	32 167	25 909
Honoraires des dépositaires	74 000	48 992
Frais de dépôt	22 251	18 885
Honoraires du comité d'examen indépendant	4 711	4 955
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	642	547
Charges d'intérêts	81 534	15 839
Frais de gestion	26 022	7 831
Rémunération au rendement	6 977	6 113
Honoraires de professionnels	13 708	16 853
Coût d'emprunt de titres	79 480	42 512
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	10 359	7 578
Coûts d'opérations (note 9)	<u>23 511</u>	<u>27 435</u>
Total des charges d'exploitation	<u>375 362</u>	<u>223 449</u>
Retenues d'impôts (note 7)	<u>(11 754)</u>	<u>(9 228)</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>(1 073 038) \$</u>	<u>6 746 281 \$</u>

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

États du résultat global

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2022	2021
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	(31 888) \$	92 714 \$
Série F	(284 337) \$	103 292 \$
Série I	(756 813) \$	6 550 275 \$
	<hr/>	<hr/>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	44 004	26 993
Série F	288 444	27 857
Série I	1 417 786	1 630 516
	<hr/>	<hr/>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	(0,72) \$	3,43 \$
Série F	(0,99) \$	3,71 \$
Série I	(0,53) \$	4,02 \$
	<hr/>	<hr/>

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

Pour les exercices clos les 31 décembre

	Série A 2022	Série A 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	491 333 \$	228 619 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(31 888)	92 714
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	46 014	170 000
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	42 264	86 980
Rachat de parts rachetables	(22 249)	–
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	66 029	256 980
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(24 501)	(16 124)
Gains en capital nets réalisés	(17 763)	(66 514)
Remboursement de capital	–	(4 342)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(42 264)	(86 980)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(8 123)	262 714
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	483 210 \$	491 333 \$
	Série F 2022	Série F 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	423 659 \$	279 270 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(284 337)	103 292
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	4 049 906	118 000
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	326 456	75 199
Rachat de parts rachetables	(993 412)	(76 903)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	3 382 950	116 296
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	208 378)	(14 114)
Gains en capital nets réalisés	(118 078)	(57 324)
Remboursement de capital	–	(3 761)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(326 456)	(75 199)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	2 772 157	144 389
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	3 195 816 \$	423 659 \$

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

Pour les exercices clos les 31 décembre

	Série I 2022	Série I 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	23 987 936 \$	17 363 328 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(756 813)	6 550 275
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	32 881	78 752
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	1 595 412	4 526 331
Rachat de parts rachetables	(8 448 566)	(4 419)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(6 820 273)	4 600 664
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(1 051 009)	(1 047 961)
Gains en capital nets réalisés	(544 403)	(3 243 712)
Remboursement de capital	–	(234 658)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 595 412)	(4 526 331)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(9 172 498)	6 624 608
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	14 815 438 \$	23 987 936 \$
	Total 2022	Total 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	24 902 928 \$	17 871 217 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(1 073 038)	6 746 281
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	4 128 801	366 752
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	1 964 132	4 688 510
Rachat de parts rachetables	(9 464 227)	(81 322)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(3 371 294)	4 973 940
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(1 283 888)	(1 078 199)
Gains en capital nets réalisés	(680 244)	(3 367 550)
Remboursement de capital	–	(242 761)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 964 132)	(4 688 510)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(6 408 464)	7 031 711
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	18 494 464 \$	24 902 928 \$

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les exercices clos les 31 décembre

	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	(1 073 038) \$	6 746 281 \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	(22 176)	142 422
(Gain) perte net réalisé sur les placements	(1 049 841)	(3 323 560)
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	(669 814)	499 182
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	3 277 768	(1 558 046)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	(188 063)	(731 373)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	(15 958)	638
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	133 801	(52 161)
Achat de placements	(59 533 384)	(79 843 526)
Produit de la vente de placements	64 448 748	78 809 586
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	81 863	589 785
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	12 747	(27 885)
(Augmentation) diminution des autres créances	(205)	151
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	5 394	(2 094)
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	8 463	3 256
Augmentation (diminution) des charges à payer	25 203	825
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1 258	406
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	2 545	3 446
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	5 445 311	1 257 333
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	4 113 952	366 752
Rachat de parts rachetables**	(9 449 378)	366 752
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(5 335 426)	285 430
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	109 885	1 542 763
Variation du gain (perte) de change latent	22 176	(142 422)
Trésorerie, à l'ouverture de l'exercice	804 922	13 424
Dette bancaire, à l'ouverture de l'exercice	(1 915 637)	(2 524 480)
	(978 654)	(1 110 715)
Trésorerie, à la clôture de l'exercice	2 409 454 \$	804 922 \$
Dette bancaire, à la clôture de l'exercice	(3 388 108) \$	(1 915 637) \$
	(978 654) \$	(1 110 715) \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	706 746 \$	619 809 \$
Dividendes payés*	109 029	63 740
Intérêts reçus*	29 765	1 214
Intérêts payés*	81 534	15 839

* Inclus dans les activités d'exploitation.

** Déduction faite d'échanges hors trésorerie de 14 849 \$ (0 \$ en 2021)

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Actions canadiennes – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2021 : 13,33 %)				
Advantage Energy Ltd.	1 000	10 094	9 470	
Africa Oil Corp.	1 600	3 934	3 984	
ARC Resources Ltd.	6 821	85 588	124 483	
Athabasca Oil Corp.	9 000	10 772	21 690	
Baytex Energy Corp.	3 700	19 637	22 496	
Birchcliff Energy Ltd.	1 000	7 023	9 430	
Bonterra Energy Corp.	600	5 538	4 056	
Corporation Cameco, TSE	700	22 214	21 483	
Canacol Energy Ltd.	100	361	196	
Canadian Natural Resources Ltd., TSE	7 300	375 621	548 887	
Cardinal Energy Ltd.	4 800	22 463	36 576	
Cenovus Energy Inc.	11 655	168 928	306 177	
CES Energy Solutions Corp.	200	350	552	
Crescent Point Energy Corp.	3 636	30 124	35 124	
Crew Energy Inc.	2 600	9 560	14 638	
Enbridge Inc.	12 100	617 575	640 332	
Enerflex Ltd.	200	1 199	1 708	
Enerplus Corp.	133	1 096	3 179	
Ensign Energy Services Inc.	1 100	2 290	3 751	
Freehold Royalties Ltd.	900	13 323	14 247	
Gear Energy Ltd.	1 500	1 692	1 695	
Headwater Exploration Inc.	2 700	18 428	15 984	
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	1 200	74 818	79 140	
Kelt Exploration Ltd.	100	552	501	
Keyera Corp.	900	28 339	26 631	
MEG Energy Corp.	3 100	25 019	58 435	
NexGen Energy Ltd.	4 900	32 629	29 351	
NuVista Energy Ltd.	200	2 143	2 496	
Paramount Resources Ltd.	600	16 405	17 184	
Parex Resources Inc.	1 586	36 777	31 958	
Pembina Pipeline Corp.	2 293	107 199	105 386	
Peyto Exploration & Development Corp.	1 500	15 688	20 805	
PrairieSky Royalty Ltd.	1 430	21 258	31 031	
Secure Energy Services Inc.	7 564	35 541	53 175	
Suncor Énergie Inc.	8 400	300 544	360 780	
Surge Energy Inc.	1 254	10 654	11 424	
Tamarack Valley Energy Ltd.	9 967	33 174	44 453	
Corporation TC Énergie, TSE	7 000	445 899	377 860	
Tidewater Midstream and Infrastructure Ltd.	200	269	202	
Topaz Energy Corp.	600	11 453	12 678	
Tourmaline Oil Corp.	2 100	132 097	143 472	
VAALCO Energy Inc.	165	710	1 019	
Whitecap Resources Inc.	6 971	39 657	74 869	
Yangarra Resources Ltd.	1 000	2 782	2 810	
		2 801 417	3 325 798	17,98
Matières premières (31 décembre 2021 : 13,60 %)				
Acadian Timber Corp.	200	3 303	2 994	
Mines Agnico Eagle Ltée	2 366	166 728	166 472	
Alamos Gold Inc.	2 600	29 721	35 594	
Algoma Steel Group Inc.	100	901	855	
Argonaut Gold Inc.	1 000	3 034	520	
Aris Mining Corp.	2 800	13 374	9 380	
Société aurifère Barrick	11 600	300 650	269 236	
Calibre Mining Corp.	700	822	630	
Canfor Corp.	500	12 252	10 655	
Capstone Copper Corp.	3 400	16 458	16 796	
Cascades inc.	900	11 455	7 614	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
CCL Industries Inc., cat. B	300	19 459	17 352	
Centerra Gold Inc.	3 300	32 927	23 133	
Chemtrade Logistics Income Fund	2 727	23 589	24 461	
Dundee Precious Metals Inc.	1 571	11 947	10 227	
Eldorado Gold Corp.	3 999	42 766	45 149	
Endeavour Silver Corp.	800	3 588	3 504	
First Majestic Silver Corp.	1 600	19 726	18 048	
First Quantum Minerals Ltd.	1 895	53 226	53 610	
Franco-Nevada Corp., TSE	1 300	219 002	239 941	
GoldMining Inc.	1 000	1 773	1 540	
Hudbay Minerals Inc.	1 400	11 745	9 576	
IAMGOLD Corp.	7 700	31 556	26 719	
Interfor Corp.	900	20 945	18 900	
Ivanhoe Mines Ltd.	6 200	57 925	66 340	
Karora Resources Inc.	400	1 864	1 860	
Kinross Gold Corp., TSE	16 251	124 432	89 706	
Labrador Iron Ore Royalty Corp.	1 700	61 492	57 086	
Liberty Gold Corp.	4 796	5 276	2 686	
Lucara Diamond Corp.	2 900	4 702	1 450	
Lundin Mining Corp.	4 400	43 266	36 564	
Methanex Corp.	500	25 001	25 630	
Neo Performance Materials Inc.	200	2 446	1 920	
New Gold Inc.	8 000	12 201	10 640	
Nutrien Ltd.	2 800	231 109	276 780	
OceanaGold Corp.	15 699	43 065	40 503	
Orezone Gold Corp.	700	867	882	
Minière Osisko Inc.	2 400	9 633	8 400	
Pan American Silver Corp.	4 000	105 870	88 400	
Sandstorm Gold Ltd	2 400	19 770	17 088	
Silvercorp Metals inc.	2 700	16 525	10 746	
SSR Mining Inc.	2 800	64 667	59 332	
Stelco Holdings Inc.	200	8 530	8 858	
Stella-Jones Inc.	400	20 135	19 408	
Taseko Mines Ltd.	2 571	3 179	5 091	
Ressources Teck Ltée	1 716	73 585	87 808	
Torex Gold Resources Inc.	300	5 011	4 665	
Transcontinental inc.	600	10 090	9 168	
West Fraser Timber Co., Ltd., TSE	701	68 925	68 537	
Western Copper & Gold Corp.	500	1 022	1 205	
Western Forest Products Inc.	1 300	2 342	1 508	
Wheaton Precious Metals Corp., TSE	3 500	179 066	185 150	
Yamana Gold Inc.	6 357	32 705	47 805	
		2 285 648	2 248 122	12,16
Industries (31 décembre 2021 : 11,27 %)				
Groupe Aecon Inc.	200	1 961	1 822	
Air Canada	4 500	90 691	87 255	
ATS Corp.	1 900	72 380	79 971	
Badger Infrastructure Solutions Ltd.	300	9 818	7 998	
Ballard Power Systems Inc.	1 300	9 827	8 424	
Bird Construction Inc.	200	1 287	1 624	
Black Diamond Group Ltd.	2 600	5 472	12 558	
Bombardier Inc.	256	11 307	13 381	
Boyd Group Services Inc.	200	33 658	41 832	
Calian Group Ltd.	100	6 362	6 679	
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	3 900	553 706	627 276	
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	6 800	596 597	686 460	
Cargojet Inc.	100	13 133	11 635	
Civeo Corp.	62	1 051	2 613	
Dexterra Group Inc.	140	1 133	774	
Doman Building Materials Group Ltd.	2 000	14 715	11 500	
Exchange Income Corp.	165	8 036	8 684	
Finning International Inc.	700	25 151	23 562	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
GFL Environmental Inc., TSE	2 500	99 003	98 850	
Héroux-Devtek Inc.	300	5 378	3 945	
Magellan Aerospace Corp.	500	6 219	5 000	
MDA Ltd.	400	2 448	2 560	
Mullen Group Ltd.	566	6 602	8 235	
NFI Group Inc.	1 881	26 060	17 907	
Quincaillerie Richelieu Ltée	400	14 485	14 484	
Ritchie Bros Auctioneers Inc.	700	52 799	54 747	
Métaux Russel Inc.	600	18 111	17 268	
Groupe SNC-Lavalin inc.	1 200	32 117	28 632	
Stantec Inc., TSE	700	42 436	45 416	
TFI International Inc.	500	44 869	67 805	
Thomson Reuters Corp.	1 400	165 685	216 244	
Industries Toromont Ltée	600	67 064	58 626	
Corporation Wajax	200	4 004	3 946	
Waste Connections Inc.	1 793	272 057	321 808	
Westshore Terminals Investment Corp.	800	17 963	17 944	
WSP Global Inc.	900	127 127	141 381	
		2 460 712	2 758 846	14,92
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 3,54 %)				
Aritzia Inc.	1 000	49 295	47 350	
AutoCanada Inc.	100	2 735	2 331	
BRP Inc.	559	51 028	57 706	
La Société Canadian Tire Ltée	500	89 073	70 750	
Dollarama inc.	1 400	80 757	110 866	
Les Industries Dorel Inc., cat B	800	8 828	4 160	
Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	100	3 886	3 708	
Linamar Corp.	100	5 160	6 130	
Magna International Inc.	1 725	126 271	131 204	
Martinrea International Inc.	900	7 885	10 134	
Restaurant Brands International Inc.	1 300	96 527	113 841	
Roots Corp.	500	1 465	1 375	
Sleep Country Canada Holdings Inc.	400	12 165	9 192	
Spin Master Corp.	200	7 943	6 664	
		543 018	575 411	3,11
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 3,04 %)				
Alimentation Couche-Tard inc.	5 100	235 124	303 450	
Empire Co., Ltd.	2 200	81 034	78 452	
George Weston Ltée	400	48 745	67 196	
Jamieson Wellness Inc.	300	10 343	10 527	
Les Compagnies Loblaw Ltée	500	52 474	59 860	
Les Aliments Maple Leaf Inc.	800	21 895	19 560	
Metro inc.	779	52 324	58 402	
North West Co Inc.	300	10 639	10 671	
Saputo inc.	1 400	41 756	46 928	
		554 334	655 046	3,54
Soins de santé (31 décembre 2021 : 0,31 %)				
Bausch Health Cos Inc.	100	954	850	
BELLUS Santé inc.	700	9 355	7 756	
Extencicare Inc.	600	4 239	3 936	
Sienna Senior Living Inc.	3 455	46 308	37 660	
XBiotech Inc.	100	545	476	
		61 401	50 678	0,27
Services financiers (31 décembre 2021 : 32,73 %)				
Atrium Mortgage Investment Corp.	100	1 123	1 073	
Banque de Montréal, NYSE	200	13 510	24 552	
Banque de Montréal, TSE	4 300	537 704	527 438	
La Banque de Nouvelle-Écosse	7 900	612 482	524 086	
Brookfield Asset Management Ltd.	2 703	120 443	104 795	
Brookfield Corp., TSE	10 919	550 872	464 931	
Groupe Canaccord Genuity Inc.	1 900	21 490	15 941	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	6 100	414 790	334 097	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Banque canadienne de l'Ouest	700	19 038	16 842	
CI Financial Corp.	4 300	99 267	58 093	
Société financière Definity	200	7 840	7 696	
ECN Capital Corp.	1 900	11 275	5 282	
EQB Inc.	300	17 366	17 019	
Fairfax Financial Holdings Ltd.	100	52 835	80 207	
Firm Capital Mortgage Investment Corp.	200	2 329	2 138	
Goeasy Ltd.	100	17 247	10 645	
Great-West Lifeco Inc.	1 200	38 000	37 560	
Home Capital Group Inc.	300	11 635	12 774	
iA Société financière inc.	700	47 426	55 489	
Société financière IGM Inc.	900	40 801	34 020	
Intact Corporation financière	1 000	162 730	194 910	
Banque Laurentienne du Canada	600	24 503	19 380	
Société Financière Manuvie	9 814	232 537	237 008	
Banque nationale du Canada	2 200	204 797	200 706	
Onex Corp.	500	34 042	32 645	
Power Corporation du Canada	3 743	130 436	119 215	
Banque Royale du Canada, TSE	8 800	1 017 887	1 120 240	
Financière Sun Life inc.	3 900	245 925	245 115	
Timbercreek Financial Corp.	900	6 918	6 399	
Groupe TMX Ltée	400	50 097	54 208	
La Banque Toronto-Dominion, TSE	12 000	957 198	1 052 040	
Trisura Group Ltd.	500	20 803	22 645	
		5 725 346	5 639 189	30,49
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 11,39 %)				
Absolute Software Corp.	3 600	41 910	50 904	
BlackBerry Ltd.	4 400	50 919	19 404	
Celestica Inc.	398	17 919	16 664	
Canadian Solar Inc.	700	8 712	10 682	
CGI Inc., TSE	1 400	147 311	163 394	
Constellation Software Inc.	99	175 785	209 282	
Descartes Systems Group Inc.	900	83 500	84 951	
Kinaxis Inc.	200	29 865	30 382	
Corporation Nuvei	500	48 890	17 205	
Open Text Corp.	200	9 847	8 024	
Quarterhill Inc.	3 000	4 425	4 740	
Shopify Inc.	8 640	598 288	406 166	
TELUS International CDA Inc.	400	19 303	10 692	
		1 236 674	1 032 490	5,58
Services de communication (31 décembre 2021 : 5,25 %)				
AcuityAds Holdings Inc.	1 400	2 970	2 926	
Aimia Inc.	8 601	31 457	31 738	
BCE Inc.	6 500	411 309	386 685	
Cogeco Communications inc.	300	29 928	23 037	
Corus Entertainment Inc.	8 500	40 774	18 360	
Lions Gate Entertainment Corp., cat. A	470	4 040	3 636	
Québecor inc.	600	17 632	18 120	
Rogers Communications Inc., TSE	1 200	76 863	76 044	
Shaw Communications Inc., cat. B	2 991	80 043	116 679	
TELUS Corp.	11 859	336 026	309 876	
		1 031 042	987 101	5,34
Services publics (31 décembre 2021 : 3,51 %)				
Algonquin Power & Utilities Corp.	9 800	173 717	86 436	
AltaGas Ltd.	2 400	63 203	56 112	
Atco Ltd.	500	22 074	21 190	
Boralex inc.	600	23 852	24 012	
Brookfield Infrastructure Corp.	1 100	66 851	57 937	
Canadian Utilities Ltd.	800	29 063	29 320	
Capital Power Corp.	700	28 187	32 431	
Emera Inc.	2 900	167 666	150 075	
Fortis Inc.	3 300	187 960	178 794	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Hydro One Ltd.	2 100	65 468	76 167	
Innergex énergie renouvelable inc.	1 100	20 738	17 820	
Northland Power Inc.	1 616	61 566	60 002	
Polaris Renewable Energy Inc.	1 100	19 062	15 477	
Superior Plus Corp.	3 428	39 602	38 496	
TransAlta Corp., TSE	1 400	18 624	16 954	
TransAlta Renewables Inc.	900	15 856	10 125	
		1 003 489	871 348	4,71
Immobilier (31 décembre 2021 : 3,55 %)				
Allied Properties REIT	1 400	62 082	35 840	
Groupe Altus limitée	845	47 392	45 664	
Artis REIT	600	7 062	5 406	
Boardwalk REIT	200	10 112	9 886	
Colliers International Group Inc.	300	37 085	37 314	
Fonds de placement immobilier Crombie	899	15 550	14 258	
CT REIT	500	8 400	7 795	
Fiducie de placement immobilier industriel Dream	1 783	27 655	20 843	
FirstService Corp.	400	80 869	66 324	
FPI Granite Inc.	1 400	121 156	96 712	
Fonds de placement immobilier H&R	2 000	25 353	24 220	
InterRent REIT	1 900	24 317	24 320	
Killam Apartment REIT	1 800	37 774	29 178	
Minto Apartment REIT	200	2 912	2 810	
Morguard North American Residential Real Estate Investment	1 100	17 831	17 820	
NorthWest Healthcare Properties REIT	1 400	15 427	13 300	
Primaris REIT	650	11 180	9 516	
FPI RioCan	2 000	43 757	42 260	
SmartCentres REIT	900	25 004	24 102	
StorageVault Canada Inc.	100	664	602	
Summit Industrial Income REIT	2 482	51 138	56 317	
		672 720	584 487	3,16
Total des actions canadiennes – position acheteur		18 375 801	18 728 516	101,26
Actions canadiennes – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2021 : -0,06 %)				
Computer Modelling Group Ltd.	(200)	(1 066)	(1 166)	
Denison Mines Corp.	(21 800)	(40 801)	(33 790)	
Energy Fuels Inc., NYSE	(805)	(6 733)	(6 763)	
Energy Fuels Inc., TSE	(3 200)	(33 671)	(26 816)	
Pason Systems Inc.	(200)	(1 690)	(3 188)	
Shawcor Ltée	(700)	(4 327)	(9 618)	
Trican Well Service Ltd.	(600)	(2 487)	(2 196)	
Vermilion Energy Inc.	(600)	(17 765)	(14 382)	
		(108 540)	(97 919)	(0,53)
Matières premières (31 décembre 2021 : -0,98 %)				
Americas Gold & Silver Corp.	(3 500)	(8 455)	(2 695)	
Archer Exploration Corp.	(27)	(66)	(8)	
B2Gold Corp.	(100)	(548)	(481)	
Canfor Pulp Products Inc.	(200)	(1 851)	(828)	
Equinox Gold Corp.	(300)	(1 241)	(1 329)	
Fortuna Silver Mines Inc.	(6 600)	(34 227)	(33 594)	
Largo Inc.	(100)	(760)	(734)	
Lundin Gold Inc.	(100)	(910)	(1 323)	
Major Drilling Group International Inc.	(500)	(4 707)	(5 260)	
Maverix Metals Inc.	(400)	(2 080)	(2 528)	
Platinum Group Metals Ltd.	(2 000)	(4 888)	(4 740)	
SilverCrest Metals Inc.	(3 998)	(40 612)	(32 384)	
Skeena Resources Ltd.	(500)	(4 570)	(3 605)	
Wallbridge Mining Co., Ltd.	(1 500)	(997)	(270)	
		(105 912)	(89 779)	(0,49)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 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)	(3 564)	
DIRTT Environmental Solutions	(410)	(1 305)	(283)	
La Compagnie Électrique Lion	(100)	(378)	(304)	
PyroGenèse Canada Inc.	(5 277)	(18 041)	(5 435)	
Corporation Savaria	(200)	(2 771)	(2 798)	
Transat AT inc.	(200)	(825)	(588)	
Westport Fuel Systems Inc.	(900)	(1 894)	(936)	
Xebec Adsorption Inc.	(4 300)	(9 817)	(2 236)	
		(39 349)	(16 144)	(0,09)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -0,37 %)				
Bragg Gaming Group Inc.	(400)	(2 392)	(2 100)	
ElectraMeccanica Vehicles Corp.	(14 429)	(57 378)	(11 803)	
Fire & Flower Holdings Corp.	(1 500)	(4 023)	(1 770)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.	(500)	(31 237)	(28 535)	
Pollard Banknote Ltd.	(100)	(1 885)	(1 912)	
		(96 915)	(46 120)	(0,25)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -0,04 %)				
Andrew Peller Ltée	(200)	(1 208)	(998)	
SunOpta Inc.	(400)	(2 875)	(4 552)	
		(4 083)	(5 550)	(0,03)
Soins de santé (31 décembre 2021 : -0,45 %)				
Aptose Biosciences Inc.	(100)	(330)	(78)	
Aurora Cannabis Inc.	(1 000)	(1 385)	(1 250)	
Canopy Growth Corp.	(2 400)	(8 950)	(7 536)	
Cronos Group Inc.	(4 100)	(20 602)	(14 104)	
HEXO Corp.	(1 935)	(46 753)	(2 690)	
Thérapeutique Knight Inc.	(400)	(2 098)	(2 072)	
Organigram Holdings Inc.	(500)	(528)	(550)	
SNDL Inc.	(9 343)	(49 646)	(26 458)	
Valens Co Inc.	(1 600)	(2 300)	(1 456)	
Well Health Technologies Corp.	(7 400)	(36 030)	(21 016)	
		(168 622)	(77 210)	(0,42)
Services financiers (31 décembre 2021 : -0,03 %)				
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -0,21 %)				
Converge Technology Solutions Corp.	(100)	(689)	(459)	
Dye & Durham Ltd.	(100)	(1 536)	(1 641)	
Hut 8 Mining Corp	(14 300)	(39 016)	(16 588)	
Lightspeed Commerce Inc., TSE	(1 100)	(28 245)	(21 285)	
		(69 486)	(39 973)	(0,22)
Services de communication (31 décembre 2021 : néant)				
Enthusiast Gaming Holdings Inc.	(3 400)	(5 151)	(2 516)	
IMAX Corp.	(375)	(8 363)	(7 449)	
Groupe Stingray Inc.	(399)	(2 182)	(1 943)	
Telesat Corp.	(8)	(349)	(81)	
WildBrain Ltd.	(400)	(893)	(1 248)	
		(16 938)	(13 237)	(0,07)
Services publics (31 décembre 2021 : -0,11 %)				
Immobilier (31 décembre 2021 : néant)				
European Residential REIT	(400)	(1 477)	(1 212)	
Inovalis REIT	(400)	(1 717)	(1 508)	
Morguard REIT	(200)	(1 029)	(1 060)	
		(4 223)	(3 780)	(0,02)
Total des actions canadiennes – position vendeur		(614 068)	(389 712)	(2,12)
Actions américaines – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2021 : 0,78 %)				
Antero Midstream Corp.	846	12 650	12 369	
Arch Resources Inc.	106	22 194	20 508	
Berry Corp.	705	6 848	7 642	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Chevron Corp.	170	40 122	41 344	
ConocoPhillips	38	6 078	6 076	
Diamondback Energy Inc.	66	13 008	12 232	
DT Midstream Inc.	46	3 569	3 444	
Earthstone Energy Inc.	936	14 917	18 047	
EnLink Midstream LLC	112	1 882	1 867	
Enviva Inc.	21	1 602	1 507	
Equitrans Midstream Corp.	1 189	12 584	10 794	
Forum Energy Technologies Inc.	11	428	440	
Gran Tierra Energy Inc., ASE	59	62	79	
Gran Tierra Energy Inc., TSE	4 000	8 884	5 400	
Green Plains Inc.	64	2 992	2 645	
Helix Energy Solutions Group Inc.	1 454	6 650	14 539	
Hess Midstream LP	1 415	52 566	57 365	
HF Sinclair Corp.	313	22 156	22 007	
Kinder Morgan Inc.	977	24 131	23 934	
Kinetik Holdings Inc.	15	724	672	
KLX Energy Services Holdings Inc.	34	745	797	
Kosmos Energy Ltd.	795	4 437	6 851	
Liberty Energy Inc.	364	6 845	7 896	
Magnolia Oil & Gas Corp.	22	757	699	
NACCO Industries Inc.	8	549	412	
New Fortress Energy Inc.	110	7 116	6 323	
Newpark Resources Inc.	339	1 850	1 906	
NextDecade Corp.	697	5 936	4 665	
Nine Energy Service Inc.	76	940	1 496	
NOV Inc.	3	52	85	
Occidental Petroleum Corp.	27	2 281	2 304	
Oceaneering International Inc.	293	4 483	6 944	
Oil States International Inc.	260	1 789	2 628	
Par Pacific Holdings Inc.	11	349	347	
Patterson-UTI Energy Inc.	18	411	411	
PBF Energy Inc.	292	14 870	16 135	
Peabody Energy Corp.	290	10 822	10 381	
PHX Minerals Inc.	717	3 360	3 779	
Pioneer Natural Resources Co.	44	14 043	13 616	
Plains GP Holdings LP	116	1 933	1 955	
ProPetro Holding Corp.	52	758	731	
Ranger Oil Corp.	413	9 136	22 625	
Ring Energy Inc.	767	2 501	2 557	
Sitio Royalties Corp.	271	7 596	10 594	
Smart Sand Inc.	283	733	686	
Solaris Oilfield Infrastructure Inc.	91	1 288	1 224	
Talos Energy Inc.	49	1 323	1 254	
Tellurian Inc.	476	2 050	1 084	
Uranium Energy Corp.	1 247	6 379	6 556	
US Silica Holdings Inc.	98	1 866	1 660	
Viper Energy Partners LP	19	836	818	
Williams Cos Inc.	87	3 970	3 878	
		<u>376 051</u>	<u>406 208</u>	2,20
Matières premières (31 décembre 2021 : 0,18 %)				
Alcoa Corp.	30	1 821	1 848	
Ball Corp.	47	3 286	3 257	
Berry Global Group Inc.	19	1 585	1 556	
Chemours Co.	16	671	664	
Cleveland-Cliffs Inc.	59	1 314	1 288	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Corteva Inc.	30	2 408	2 389	
Ecolab Inc.	9	1 809	1 775	
Gold Resource Corp.	161	439	334	
Intrepid Potash Inc.	66	3 178	2 582	
Livent Corp.	83	3 537	2 235	
McEwen Mining Inc., TSE	30	343	239	
Mosaic Co.	25	1 479	1 486	
Rayonier Advanced Materials Inc.	47	345	611	
Ryerson Holding Corp.	37	1 779	1 517	
Scotts Miracle-Gro Co.	78	5 945	5 135	
		29 939	26 916	0,15
Industries (31 décembre 2021 : 0,36 %)				
American Airlines Group Inc.	795	14 734	13 702	
American Superconductor Corp.	92	580	459	
Astronics Corp.	32	341	447	
Bloom Energy Corp.	511	10 567	13 238	
BlueLinX Holdings Inc.	40	3 330	3 854	
BrightView Holdings Inc.	16	360	149	
CH Robinson Worldwide Inc.	3	391	372	
Concrete Pumping Holdings Inc.	71	627	563	
Ducommun Inc.	22	1 277	1 489	
Encore Wire Corp.	2	314	373	
Generac Holdings Inc.	77	10 240	10 502	
Hurco Cos Inc.	10	446	354	
Jacobs Solutions Inc.	12	2 010	1 952	
KBR Inc.	16	1 140	1 145	
Knight-Swift Transportation Holdings Inc.	17	1 190	1 207	
LSI Industries Inc.	320	2 929	5 307	
Manitowoc Co Inc.	16	353	199	
Mesa Air Group Inc.	36	372	75	
Mistras Group Inc.	42	214	281	
Old Dominion Freight Line Inc.	13	5 096	4 999	
Proto Labs Inc.	17	1 497	588	
Raytheon Technologies Corp.	3	397	410	
Science Applications International Corp.	9	1 352	1 353	
Spirit AeroSystems Holdings Inc.	266	9 014	10 668	
Sterling Infrastructure Inc.	100	2 894	4 444	
SunPower Corp.	219	6 557	5 350	
Sunworks Inc.	351	1 191	751	
Tetra Tech Inc.	7	1 398	1 377	
Union Pacific Corp.	2	595	561	
Upwork Inc.	347	8 906	4 909	
Vertiv Holdings Co.	26	481	481	
Waste Management Inc.	2	455	425	
Yellow Corp.	527	7 030	1 792	
		98 278	93 776	0,51
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 1,31 %)				
2U Inc.	224	8 758	1 903	
ADT Inc.	200	2 428	2 458	
Advance Auto Parts Inc.	7	1 404	1 395	
Airbnb Inc.	19	2 404	2 201	
Amazon.com Inc.	202	24 767	22 991	
American Axle & Manufacturing Holdings Inc.	37	489	392	
Aramark	23	1 332	1 288	
Beazer Homes USA Inc.	21	401	363	
Biglari Holdings Inc.	75	10 041	14 105	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Bloomin' Brands Inc.	199	5 519	5 425	
Bluegreen Vacations Holding Corp.	65	1 316	2 198	
Boyd Gaming Corp.	9	680	665	
Bright Horizons Family Solutions Inc.	14	1 209	1 197	
Brunswick Corp.	12	1 141	1 172	
Cheesecake Factory Inc.	8	373	344	
Chegg Inc.	216	5 801	7 396	
Cracker Barrel Old Country Store Inc.	13	1 705	1 669	
Dana Inc.	28	519	574	
Dave & Buster's Entertainment Inc.	169	8 749	8 115	
Dick's Sporting Goods Inc.	23	3 565	3 749	
Etsy Inc.	17	3 080	2 759	
Five Below Inc.	9	2 189	2 157	
GameStop Corp.	51	1 606	1 276	
Green Brick Partners Inc.	28	868	919	
Group 1 Automotive Inc.	2	454	489	
Hanesbrands Inc.	81	726	698	
Harley-Davidson Inc.	54	3 052	3 044	
Hibbett Inc.	4	356	370	
Hilton Grand Vacations Inc.	57	3 314	2 977	
Hilton Worldwide Holdings Inc.	2	371	342	
Hyatt Hotels Corp.	10	1 347	1 226	
iRobot Corp.	3	422	196	
Jack in the Box Inc.	7	783	647	
Kohl's Corp.	92	3 425	3 148	
Las Vegas Sands Corp.	126	8 274	8 207	
Leslie's Inc.	105	1 725	1 737	
Lindblad Expeditions Holdings Inc.	54	767	563	
Macy's Inc.	12	353	336	
MarineMax Inc.	46	2 895	1 946	
Marriott International Inc.	14	2 839	2 824	
McDonald's Corp.	21	7 590	7 499	
Mister Car Wash Inc.	31	400	388	
Nordstrom Inc.	362	8 416	7 917	
Papa John's International Inc.	15	1 666	1 673	
Penn Entertainment Inc.	308	12 919	12 395	
Petco Health & Wellness Co Inc.	321	4 678	4 123	
PlayAGS Inc.	992	4 838	6 855	
Porch Group Inc.	218	732	555	
Qurate Retail Inc.	287	1 413	634	
Red Robin Gourmet Burgers Inc.	64	2 030	484	
Red Rock Resorts Inc.	60	3 024	3 253	
Shake Shack Inc.	7	462	394	
Stitch Fix Inc.	404	6 065	1 702	
Strategic Education Inc.	4	358	424	
Target Corp.	79	16 521	15 954	
Taylor Morrison Home Corp.	11	362	452	
Tesla Inc.	292	56 627	48 736	
Texas Roadhouse Inc.	6	814	739	
Tractor Supply Co.	5	1 456	1 524	
Travel + Leisure Co.	7	343	345	
Universal Technical Institute Inc.	579	5 245	5 272	
VF Corp.	48	1 772	1 796	
Vivint Smart Home Inc.	230	3 433	3 709	
Wayfair Inc.	593	53 699	26 427	
Wingstop Inc.	2	362	373	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Wynn Resorts Ltd.	157	18 374	17 544	
		335 046	286 628	1,55
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 0,05 %)				
B&G Foods Inc.	30	457	453	
Coca-Cola Co.	51	4 372	4 396	
Coca-Cola Consolidated Inc.	3	1 997	2 083	
Constellation Brands Inc.	3	1 039	942	
Costco Wholesale Corp.	26	16 329	16 082	
Darling Ingredients Inc.	131	11 093	11 110	
Estee Lauder Cos Inc.	10	3 156	3 362	
Grocery Outlet Holding Corp.	67	2 759	2 650	
Hershey Co.	7	2 212	2 196	
Hostess Brands Inc.	54	1 645	1 642	
McCormick & Co Inc.	123	14 460	13 814	
Mondelez International Inc.	97	8 809	8 760	
Monster Beverage Corp.	168	23 175	23 112	
PepsiCo Inc.	24	5 863	5 875	
Philip Morris International Inc.	26	3 559	3 566	
Simply Good Foods Co.	70	3 295	3 607	
Spectrum Brands Holdings Inc.	3	342	248	
Sysco Corp.	26	2 818	2 693	
Turning Point Brands Inc.	6	351	176	
Tyson Foods Inc.	4	350	337	
Village Super Market Inc.	22	671	694	
		108 752	107 798	0,58
Soins de santé (31 décembre 2021 : 1,92 %)				
10X Genomics Inc.	17	802	839	
2seventy bio Inc.	20	650	254	
Abbott Laboratories	5	712	744	
Actinium Pharmaceuticals Inc.	25	373	361	
AdaptHealth Corp.	185	5 315	4 818	
Adaptive Biotechnologies Corp.	93	2 938	963	
Adverum Biotechnologies Inc.	1 327	4 023	1 042	
Agios Pharmaceuticals Inc.	138	8 704	5 251	
Alector Inc.	180	3 732	2 251	
Align Technology Inc.	1	490	286	
Alnylam Pharmaceuticals Inc.	4	1 170	1 288	
AmerisourceBergen Corp.	10	2 244	2 245	
Amicus Therapeutics Inc.	1	10	17	
AnaptysBio Inc.	82	2 272	3 443	
Apellis Pharmaceuticals Inc.	46	2 939	3 223	
Arrowhead Pharmaceuticals Inc.	9	397	495	
Arvinas Inc.	215	20 842	9 966	
Assembly Biosciences Inc.	814	4 530	1 434	
Assertio Holdings Inc.	184	586	1 072	
Astria Therapeutics Inc.	50	620	1 009	
Avantor Inc.	134	3 882	3 829	
Axonics Inc.	31	2 501	2 626	
BioCryst Pharmaceuticals Inc.	43	648	669	
Biogen Inc.	2	773	750	
BioMarin Pharmaceutical Inc.	89	12 617	12 480	
Bionano Genomics Inc.	1	7	2	
Bioxcel Therapeutics Inc.	26	560	757	
Cara Therapeutics Inc.	25	365	364	
Cardinal Health Inc.	30	3 148	3 125	
CareDx Inc.	229	6 577	3 540	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Castle Biosciences Inc.	25	746	797	
Celldex Therapeutics Inc.	48	2 023	2 899	
Centene Corp.	59	6 302	6 556	
Chimerix Inc.	675	4 668	1 701	
Chinook Therapeutics Inc.	175	4 544	6 212	
Cigna Corp.	1	435	449	
Clearside Biomedical Inc.	291	815	442	
Cogent Biosciences Inc.	211	2 616	3 305	
Collegium Pharmaceutical Inc.	19	537	597	
Corcept Therapeutics Inc.	79	2 232	2 174	
Crinetics Pharmaceuticals Inc.	13	376	322	
Cue Biopharma Inc.	287	1 223	1 108	
Cutera Inc.	20	1 474	1 198	
CVS Health Corp.	38	5 185	4 798	
Cytokinetics Inc.	178	9 298	11 051	
CytomX Therapeutics Inc.	1 774	5 572	3 846	
Danaher Corp.	5	1 803	1 798	
Eiger BioPharmaceuticals Inc.	115	1 008	184	
Elevance Health Inc.	3	2 077	2 085	
Emergent BioSolutions Inc.	10	510	160	
Enovis Corp.	16	1 209	1 160	
EQRx Inc.	302	861	1 007	
Esperion Therapeutics Inc.	314	2 553	2 651	
Exelixis Inc.	265	5 907	5 759	
Fate Therapeutics Inc.	447	16 625	6 111	
Figs Inc.	73	590	666	
Halozyme Therapeutics Inc.	88	6 940	6 785	
Health Catalyst Inc.	61	1 485	879	
HealthEquity Inc.	33	2 661	2 756	
HealthStream Inc.	18	548	606	
Heron Therapeutics Inc.	77	448	261	
Heska Corp.	1	313	84	
Homology Medicines Inc.	105	816	179	
Humana Inc.	42	30 713	29 148	
Illumina Inc.	43	12 380	11 781	
Incyte Corp.	7	784	762	
Insmed Inc.	340	9 537	9 205	
Inspire Medical Systems Inc.	1	320	341	
Intercept Pharmaceuticals Inc.	417	11 428	6 989	
Ionis Pharmaceuticals Inc.	179	9 653	9 161	
iRhythm Technologies Inc.	5	684	635	
Ironwood Pharmaceuticals Inc.	124	2 034	2 082	
Johnson & Johnson	124	30 075	29 680	
KalVista Pharmaceuticals Inc.	243	4 166	2 226	
Karuna Therapeutics Inc.	26	8 275	6 922	
Karyopharm Therapeutics Inc.	419	2 285	1 930	
Kezar Life Sciences Inc.	205	2 077	1 955	
Kryстал Biotech Inc.	4	368	429	
Lineage Cell Therapeutics Inc.	233	369	369	
Madrigal Pharmaceuticals Inc.	43	14 773	16 911	
MannKind Corp.	144	1 024	1 028	
McKesson Corp.	6	2 912	3 050	
Medpace Holdings Inc.	5	1 456	1 439	
Mersana Therapeutics Inc.	105	1 002	834	
Mirum Pharmaceuticals Inc.	32	679	845	
Molina Healthcare Inc.	23	9 875	10 291	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Multiplan Corp.	440	904	686	
NanoString Technologies Inc.	7	387	76	
NeoGenomics Inc.	8	406	100	
Neurocrine Biosciences Inc.	2	331	324	
Nevro Corp.	35	3 047	1 878	
Ocular Therapeutix Inc.	141	696	537	
Ommicell Inc.	3	419	205	
OPKO Health Inc.	1 009	3 564	1 709	
Pacira BioSciences Inc.	23	1 862	1 203	
Passage Bio Inc.	561	1 706	1 049	
PDL BioPharma Inc.	1 517	7 899	1 752	
Pediatrics Medical Group Inc.	15	448	302	
PerkinElmer Inc.	6	1 137	1 140	
Precigen Inc.	128	345	264	
Precision BioSciences Inc.	36	413	58	
Prometheus Biosciences Inc.	15	2 268	2 236	
Protagonist Therapeutics Inc.	35	501	517	
PTC Therapeutics Inc.	5	344	259	
Puma Biotechnology Inc.	327	1 376	1 874	
Regeneron Pharmaceuticals Inc.	2	2 049	1 955	
Repligen Corp.	6	1 401	1 376	
Replimune Group Inc.	8	352	295	
Revance Therapeutics Inc.	123	3 891	3 077	
Sage Therapeutics Inc.	69	3 560	3 566	
Sangamo Therapeutics Inc.	417	5 368	1 774	
Sarepta Therapeutics Inc.	23	3 344	4 038	
Savara Inc.	809	1 393	1 699	
Scholar Rock Holding Corp.	52	395	638	
Seagen Inc.	7	1 131	1 219	
SeaSpine Holdings Corp.	177	1 865	2 003	
Selecta Biosciences Inc.	349	1 911	534	
Shockwave Medical Inc.	34	11 593	9 472	
SI-BONE Inc.	164	4 695	3 022	
Sorrento Therapeutics Inc.	2	21	2	
SpringWorks Therapeutics Inc.	32	979	1 128	
Syneos Health Inc.	256	11 387	12 723	
Synlogic Inc.	152	364	157	
Tabula Rasa HealthCare Inc.	128	957	859	
Tactile Systems Technology Inc.	282	2 821	4 386	
Tandem Diabetes Care Inc.	214	13 293	13 034	
Teladoc Health Inc.	733	32 618	23 489	
Tenet Healthcare Corp.	5	373	331	
Traverse Therapeutics Inc.	501	14 553	14 276	
Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	49	3 196	3 076	
United Therapeutics Corp.	2	569	754	
UnitedHealth Group Inc.	6	4 312	4 310	
Vanda Pharmaceuticals Inc.	51	752	511	
Veeva Systems Inc.	7	1 707	1 531	
ViewRay Inc.	266	1 279	1 615	
Viking Therapeutics Inc.	290	1 381	3 694	
Viridian Therapeutics Inc.	160	5 841	6 333	
Voyager Therapeutics Inc.	161	1 366	1 331	
Y-mAbs Therapeutics Inc.	305	2 526	2 017	
		516 992	444 136	2,40

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Services financiers (31 décembre 2021 : 0,43 %)				
Aflac Inc.	29	2 807	2 827	
Ally Financial Inc.	60	2 024	1 988	
American Equity Investment Life Holding Co.	48	2 418	2 967	
American Express Co.	4	750	801	
American Financial Group Inc.	74	13 610	13 765	
American International Group Inc.	5	345	428	
Bank of Princeton	59	2 544	2 536	
Bread Financial Holdings Inc.	34	1 997	1 735	
Bridgewater Bancshares Inc.	15	375	361	
BRP Group Inc.	170	6 573	5 791	
Capital One Financial Corp.	3	392	378	
Carter Bankshares Inc.	18	367	405	
Citigroup Inc.	132	8 304	8 090	
Coinbase Global Inc.	483	26 320	23 161	
Crawford & Co., cat. A	29	360	218	
Crawford & Co., cat. B	108	821	777	
Eagle Bancorp Inc.	5	363	299	
Fifth Third Bancorp	122	5 416	5 424	
FNB Corp.	25	442	442	
Greenhill & Co Inc.	30	577	417	
Hartford Financial Services Group Inc.	4	351	411	
Huntington Bancshares Inc.	518	9 918	9 896	
Interactive Brokers Group Inc.	18	1 749	1 765	
KeyCorp	37	873	873	
Lincoln National Corp.	584	26 076	24 309	
Live Oak Bancshares Inc.	9	428	368	
M&T Bank Corp.	2	395	393	
Marsh & McLennan Cos Inc.	8	1 801	1 794	
Medallion Financial Corp.	114	849	1 103	
MetLife Inc.	8	808	784	
Moody's Corp.	2	766	755	
MSCI Inc.	7	4 424	4 412	
Oppenheimer Holdings Inc.	8	426	459	
PCB Bancorp	66	1 678	1 582	
PennyMac Mortgage Investment Trust	18	355	302	
Peoples Bancorp Inc.	100	4 034	3 828	
PNC Financial Services Group Inc.	21	4 341	4 494	
ProAssurance Corp.	14	416	331	
PROG Holdings Inc.	94	2 247	2 151	
Prudential Financial Inc.	111	15 464	14 959	
Ryan Specialty Holdings Inc.	105	5 738	5 906	
S&P Global Inc.	88	41 988	39 937	
Sculptor Capital Management Inc.	291	7 682	3 415	
Shore Bancshares Inc.	18	471	425	
Silvergate Capital Corp.	88	2 998	2 075	
Southside Bancshares Inc.	7	370	341	
Summit Financial Group Inc.	53	2 029	1 787	
Texas Capital Bancshares Inc.	4	338	327	
Truist Financial Corp.	35	2 044	2 041	
US Bancorp	6	361	355	
W R Berkley Corp.	13	1 276	1 278	
Wells Fargo & Co.	19	1 117	1 063	
Zions Bancorp NA	8	532	533	
		221 148	207 262	1,12

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 1,57 %)				
ACM Research Inc.	28	340	293	
Affirm Holdings Inc.	493	8 371	6 460	
Alteryx Inc.	174	13 653	11 946	
Amtech Systems Inc.	29	359	299	
ANSYS Inc.	6	2 050	1 964	
Apple Inc.	81	14 694	14 260	
Applied Materials Inc.	43	6 186	5 674	
AppLovin Corp.	1 156	18 382	16 493	
Arrow Electronics Inc.	7	984	992	
Blackbaud Inc.	11	864	877	
Blackline Inc.	24	2 265	2 188	
Box Inc.	257	9 077	10 840	
Casa Systems Inc.	66	439	244	
CEVA Inc.	7	391	243	
Cognizant Technology Solutions Corp.	4	325	310	
Concentrix Corp.	2	207	361	
Coupa Software Inc.	139	14 839	14 911	
DigitalOcean Holdings Inc.	36	1 381	1 242	
DocuSign Inc.	527	37 693	39 573	
Enphase Energy Inc.	43	14 969	15 437	
First Solar Inc.	71	15 171	14 410	
Global Payments Inc.	2	301	269	
Guidewire Software Inc.	338	29 866	28 651	
Hims & Hers Health Inc.	384	3 124	3 335	
HP Inc.	33	1 316	1 201	
HubSpot Inc.	12	4 412	4 701	
Impinj Inc.	13	1 740	1 923	
Intel Corp.	366	12 970	13 107	
LiveRamp Holdings Inc.	58	2 597	1 842	
MaxLinear Inc.	8	412	368	
Momentive Global Inc.	582	8 931	5 520	
MongoDB Inc.	41	10 220	10 935	
Monolithic Power Systems Inc.	48	25 770	22 998	
NetApp Inc.	24	2 152	1 953	
Nutanix Inc.	348	9 935	12 283	
ON Semiconductor Corp.	203	18 874	17 155	
Pure Storage Inc.	467	17 143	16 933	
Q2 Holdings Inc.	72	3 789	2 621	
Rapid7 Inc.	177	22 640	8 149	
RingCentral Inc.	349	18 729	16 740	
Rogers Corp.	8	1 302	1 294	
Sabre Corp.	478	3 899	4 003	
SecureWorks Corp.	174	3 313	1 507	
Semtech Corp.	106	4 265	4 121	
Silicon Laboratories Inc.	2	364	368	
Skyworks Solutions Inc.	55	6 744	6 791	
Smartsheet Inc.	223	12 448	11 893	
SolarEdge Technologies Inc.	53	16 790	20 342	
SolarWinds Corp.	406	5 977	5 149	
Splunk Inc.	112	13 290	13 065	
Super Micro Computer Inc.	3	378	334	
Tenable Holdings Inc.	88	6 070	4 549	
Teradyne Inc.	14	1 641	1 657	
Unity Software Inc.	31	1 200	1 201	
Varonis Systems Inc.	86	4 270	2 790	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Verint Systems Inc.	13	638	639	
VeriSign Inc.	2	550	557	
VimnetX Holding Corp.	670	1 070	1 180	
Visa Inc.	7	1 969	1 971	
Wolfspeed Inc.	48	5 322	4 490	
Workday Inc.	42	8 956	9 522	
Workiva Inc.	21	1 949	2 389	
Zuora Inc.	317	5 524	2 732	
		465 490	432 245	2,34
Services de communication (31 décembre 2021 : 0,69 %)				
Altice USA Inc.	505	5 406	3 148	
Angi Inc.	310	3 765	987	
Anterix Inc.	12	764	523	
Bandwidth Inc.	36	1 840	1 119	
DHI Group Inc.	777	3 874	5 569	
Fox Corp., cat. A	49	2 062	2 016	
Iridium Communications Inc.	70	4 903	4 875	
Liberty Media Corp-Liberty Formula One	10	825	810	
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	148	8 241	7 847	
Loyalty Ventures Inc.	2	106	7	
Lumen Technologies Inc.	1 773	13 418	12 540	
NII Holdings Inc.	992	2 791	349	
Paramount Global	51	1 205	1 166	
Pinterest Inc.	230	6 934	7 567	
ROBLOX Corp.	442	18 344	17 044	
Roku Inc.	391	28 606	21 562	
Snap Inc.	140	1 637	1 698	
Spok Holdings Inc.	107	1 067	1 187	
Take-Two Interactive Software Inc.	92	12 783	12 980	
T-Mobile US Inc.	229	45 507	43 440	
TripAdvisor Inc.	120	4 194	2 923	
TrueCar Inc.	72	354	245	
Walt Disney Co.	507	64 381	59 683	
World Wrestling Entertainment Inc.	20	1 995	1 857	
Yelp Inc.	63	2 686	2 334	
ZoomInfo Technologies Inc.	20	695	816	
		238 383	214 292	1,16
Services publics (31 décembre 2021 : 0,01 %)				
CenterPoint Energy Inc.	10	358	406	
Chesapeake Utilities Corp.	2	348	320	
Clearway Energy Inc., cat. C	18	736	777	
NextEra Energy Partners LP	3	319	285	
Northwest Natural Holding Co.	5	336	322	
OGE Energy Corp.	7	374	375	
ONE Gas Inc.	3	339	308	
Otter Tail Corp.	9	731	716	
Sempra Energy	10	2 134	2 094	
Southern Co.	4	354	387	
Star Group LP	40	570	653	
Sunnova Energy International Inc.	379	9 371	9 249	
		15 970	15 892	0,09
Immobilier (31 décembre 2021 : 0,15 %)				
Boston Properties Inc.	11	977	1 007	
Braemar Hotels & Resorts Inc.	941	6 734	5 240	
CubeSmart	10	654	545	
Digital Realty Trust Inc.	6	831	815	
Extra Space Storage Inc.	7	1 484	1 396	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Healthcare Realty Trust Inc.	10	343	261	
Medical Properties Trust Inc.	1 115	17 363	16 830	
Retail Opportunity Investments Corp.	38	750	774	
SL Green Realty Corp.	38	1 876	1 736	
Ventas Inc.	6	384	366	
VICI Properties Inc.	399	18 332	17 516	
Vornado Realty Trust	45	1 313	1 269	
		<u>51 041</u>	<u>47 755</u>	0,26
Total des actions américaines – position acheteur		<u>2 457 090</u>	<u>2 282 908</u>	12,36
Actions américaines – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2021 : -1,43 %)				
Alto Ingredients Inc.	(2)	(14)	(8)	
Antero Resources Corp.	(65)	(2 968)	(2 729)	
APA Corp.	(812)	(37 809)	(51 359)	
Chesapeake Energy Corp.	(4)	(534)	(511)	
Comstock Resources Inc.	(195)	(3 791)	(3 622)	
EOG Resources Inc.	(35)	(6 101)	(6 142)	
EQT Corp.	(1 384)	(67 363)	(63 440)	
Gevo Inc.	(791)	(2 279)	(2 036)	
Halliburton Co.	(178)	(9 381)	(9 491)	
Helmerich & Payne Inc.	(78)	(4 969)	(5 239)	
Laredo Petroleum Inc.	(47)	(3 496)	(3 275)	
Marathon Oil Corp.	(1 072)	(28 791)	(39 320)	
NexTier Oilfield Solutions Inc.	(651)	(8 242)	(8 150)	
PDC Energy Inc.	(15)	(1 481)	(1 290)	
Permian Resources Corp.	(1 296)	(15 591)	(16 507)	
Phillips 66	(25)	(3 523)	(3 526)	
Range Resources Corp.	(1 446)	(57 280)	(49 021)	
RPC Inc.	(1 069)	(8 129)	(12 877)	
Southwestern Energy Co.	(307)	(2 553)	(2 433)	
TETRA Technologies Inc.	(197)	(905)	(924)	
Tidewater Inc.	(49)	(2 306)	(2 447)	
W&T Offshore Inc.	(1 014)	(8 920)	(7 667)	
		<u>(276 426)</u>	<u>(292 014)</u>	(1,58)
Matières premières (31 décembre 2021 : -0,14 %)				
Albemarle Corp.	(9)	(3 063)	(2 645)	
Alpha Metallurgical Resources Inc.	(4)	(773)	(793)	
Amyris Inc.	(1 630)	(5 205)	(3 379)	
Aspen Aerogels Inc.	(72)	(1 274)	(1 150)	
Avery Dennison Corp.	(2)	(486)	(490)	
Avient Corp.	(6)	(359)	(274)	
Cabot Corp.	(4)	(377)	(362)	
Celanese Corp.	(3)	(442)	(416)	
Century Aluminum Co.	(80)	(903)	(887)	
CF Industries Holdings Inc.	(36)	(4 766)	(4 156)	
Coeur Mining Inc.	(84)	(401)	(382)	
Dow Inc.	(46)	(3 195)	(3 141)	
Flotek Industries Inc.	(578)	(948)	(877)	
Freeport-McMoRan Inc.	(39)	(2 015)	(2 008)	
Greif Inc.	(6)	(536)	(545)	
Huntsman Corp.	(74)	(2 810)	(2 755)	
LSB Industries Inc.	(21)	(385)	(378)	
Materion Corp.	(3)	(349)	(356)	
Mativ Holdings Inc.	(83)	(2 449)	(2 350)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
NewMarket Corp.	(3)	(1 243)	(1 265)	
Newmont Corp.	(100)	(6 491)	(6 383)	
Quaker Chemical Corp.	(35)	(8 825)	(7 915)	
Ranpak Holdings Corp.	(7)	(353)	(55)	
Reliance Steel & Aluminum Co.	(6)	(1 654)	(1 646)	
Royal Gold Inc.	(15)	(2 234)	(2 291)	
RPM International Inc.	(15)	(2 020)	(1 981)	
Southern Copper Corp.	(89)	(6 052)	(7 283)	
Stepan Co.	(17)	(2 575)	(2 452)	
Sylvamo Corp.	(5)	(358)	(329)	
Westlake Corp.	(19)	(2 509)	(2 640)	
		(65 050)	(61 584)	(0,33)
Industries (31 décembre 2021 : -0,80 %)				
AAON Inc.	(64)	(6 265)	(6 532)	
Advanced Drainage Systems Inc.	(63)	(7 693)	(6 997)	
Alamo Group Inc.	(2)	(371)	(384)	
Albany International Corp.	(13)	(1 296)	(1 737)	
Allegiant Travel Co.	(2)	(306)	(184)	
Allison Transmission Holdings Inc.	(58)	(3 433)	(3 269)	
Ameresco Inc.	(5)	(412)	(387)	
Apogee Enterprises Inc.	(56)	(3 131)	(3 374)	
Applied Industrial Technologies Inc.	(4)	(690)	(683)	
Argan Inc.	(16)	(793)	(800)	
Astec Industries Inc.	(40)	(3 584)	(2 204)	
Avis Budget Group Inc.	(77)	(23 441)	(17 103)	
Axon Enterprise Inc.	(16)	(3 947)	(3 597)	
AZEK Co Inc.	(53)	(1 511)	(1 459)	
Boise Cascade Co.	(9)	(879)	(837)	
Builders FirstSource Inc.	(229)	(19 903)	(20 131)	
BWX Technologies Inc.	(27)	(2 162)	(2 125)	
CACI International Inc.	(3)	(1 233)	(1 222)	
ChargePoint Holdings Inc.	(995)	(19 146)	(12 848)	
Clean Harbors Inc.	(3)	(483)	(464)	
Desktop Metal Inc.	(2 316)	(15 860)	(4 268)	
Dycom Industries Inc.	(18)	(2 177)	(2 283)	
Enerpac Tool Group Corp.	(17)	(441)	(586)	
ESS Tech Inc.	(553)	(1 865)	(1 821)	
FedEx Corp.	(19)	(4 518)	(4 459)	
Fortune Brands Innovations Inc.	(4)	(351)	(310)	
FTI Consulting Inc.	(106)	(22 968)	(22 808)	
FuelCell Energy Inc.	(603)	(2 476)	(2 271)	
GATX Corp.	(2)	(292)	(288)	
GEO Group Inc.	(30)	(450)	(445)	
Gibraltar Industries Inc.	(52)	(3 484)	(3 233)	
Gorman-Rupp Co.	(8)	(372)	(278)	
Graham Corp.	(257)	(4 016)	(3 350)	
Helios Technologies Inc.	(3)	(417)	(221)	
Hub Group Inc.	(3)	(338)	(323)	
Huntington Ingalls Industries Inc.	(25)	(7 976)	(7 814)	
Hyllion Holdings Corp.	(736)	(4 075)	(2 334)	
Hyster-Yale Materials Handling Inc.	(4)	(482)	(137)	
Ideanomics Inc.	(4 010)	(9 565)	(891)	
Illinois Tool Works Inc.	(9)	(2 682)	(2 686)	
JELD-WEN Holding Inc.	(11)	(354)	(144)	
KAR Auction Services Inc.	(219)	(4 004)	(3 872)	
Masco Corp.	(28)	(1 924)	(1 771)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Masterbrand Inc.	(4)	(44)	(41)	
Matson Inc.	(51)	(5 871)	(4 320)	
MDU Resources Group Inc.	(50)	(2 090)	(2 055)	
MillerKnoll Inc.	(40)	(915)	(1 139)	
MSA Safety Inc.	(3)	(521)	(586)	
Norfolk Southern Corp.	(5)	(1 693)	(1 669)	
Northrop Grumman Corp.	(24)	(17 505)	(17 743)	
Otis Worldwide Corp.	(18)	(1 831)	(1 910)	
PACCAR Inc.	(178)	(24 816)	(23 870)	
Performant Financial Corp.	(111)	(360)	(543)	
Plug Power Inc.	(766)	(13 707)	(12 839)	
Regal Rexnord Corp.	(2)	(321)	(325)	
REV Group Inc.	(17)	(360)	(291)	
RXO Inc.	(21)	(580)	(489)	
Saia Inc.	(1)	(315)	(284)	
Shoals Technologies Group Inc.	(315)	(11 907)	(10 529)	
Snap-on Inc.	(16)	(5 033)	(4 954)	
SPX Technologies Inc.	(16)	(1 085)	(1 423)	
Stem Inc.	(354)	(5 791)	(4 288)	
Sun Country Airlines Holdings Inc.	(12)	(341)	(258)	
Sunrun Inc.	(46)	(1 731)	(1 497)	
Tennant Co.	(22)	(1 723)	(1 835)	
Textron Inc.	(1)	(47)	(96)	
Titan International Inc.	(249)	(3 644)	(5 169)	
TPI Composites Inc.	(7)	(388)	(96)	
Trex Co Inc.	(12)	(725)	(688)	
Trinity Industries Inc.	(31)	(1 286)	(1 242)	
Uber Technologies Inc.	(328)	(12 048)	(10 991)	
UFP Industries Inc.	(4)	(344)	(430)	
UniFirst Corp.	(1)	(259)	(261)	
United Parcel Service Inc., cat. B	(4)	(1 017)	(942)	
Univar Solutions Inc.	(15)	(679)	(646)	
Universal Logistics Holdings Inc.	(83)	(4 264)	(3 761)	
Willdan Group Inc.	(25)	(1 012)	(605)	
XPO Inc.	(61)	(3 248)	(2 752)	
Zurn Elkay Water Solutions Corp.	(18)	(528)	(516)	
		(319 795)	(274 013)	(1,48)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -1,08 %)				
Abercrombie & Fitch Co.	(53)	(1 720)	(1 645)	
Acushnet Holdings Corp.	(38)	(2 478)	(2 186)	
American Eagle Outfitters Inc.	(289)	(5 893)	(5 467)	
AMMO Inc.	(1 238)	(9 694)	(2 902)	
Autoliv Inc.	(3)	(318)	(311)	
AutoNation Inc.	(16)	(2 560)	(2 326)	
Boot Barn Holdings Inc.	(6)	(535)	(508)	
Brinker International Inc.	(12)	(579)	(519)	
Buckle Inc.	(202)	(10 762)	(12 412)	
Caleres Inc.	(24)	(837)	(725)	
Canoo Inc.	(1 290)	(3 235)	(2 150)	
Carter's Inc.	(3)	(367)	(303)	
Carvana Co.	(515)	(6 198)	(3 308)	
Chico's FAS Inc.	(875)	(5 544)	(5 833)	
Clarus Corp.	(28)	(1 020)	(297)	
Columbia Sportswear Co.	(15)	(1 435)	(1 780)	
Crocs Inc.	(236)	(16 539)	(34 673)	
Deckers Outdoor Corp.	(14)	(6 822)	(7 572)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Designer Brands Inc.	(27)	(400)	(358)	
Ethan Allen Interiors Inc.	(366)	(11 876)	(13 102)	
Flexsteel Industries Inc.	(13)	(442)	(271)	
Funko Inc.	(194)	(4 389)	(2 868)	
Genesco Inc.	(13)	(1 061)	(811)	
Gentherm Inc.	(25)	(2 424)	(2 212)	
G-III Apparel Group Ltd.	(201)	(3 721)	(3 734)	
Graham Holdings Co.	(3)	(2 192)	(2 456)	
Grand Canyon Education Inc.	(14)	(2 035)	(2 004)	
GrowGeneration Corp.	(375)	(13 215)	(1 992)	
Guess? Inc.	(14)	(413)	(392)	
Hasbro Inc.	(6)	(492)	(496)	
Haverty Furniture Cos Inc.	(236)	(8 554)	(9 561)	
Helen of Troy Ltd.	(2)	(321)	(301)	
Inspired Entertainment Inc.	(39)	(588)	(670)	
Johnson Outdoors Inc.	(3)	(379)	(269)	
Kontoor Brands Inc.	(95)	(5 259)	(5 148)	
La-Z-Boy Inc.	(23)	(741)	(711)	
Lazydays Holdings Inc.	(20)	(379)	(324)	
Lear Corp.	(2)	(435)	(336)	
Light & Wonder Inc.	(13)	(1 109)	(1 032)	
Lordstown Motors Corp.	(360)	(747)	(556)	
Lovesac Co.	(183)	(13 921)	(5 458)	
Luminar Technologies Inc.	(242)	(3 873)	(1 623)	
MercadoLibre Inc.	(47)	(52 350)	(53 891)	
Meritage Homes Corp.	(10)	(1 230)	(1 249)	
Modine Manufacturing Co.	(19)	(381)	(511)	
Mohawk Industries Inc.	(10)	(1 319)	(1 385)	
Motorcar Parts of America Inc.	(450)	(11 345)	(7 231)	
Mullen Automotive Inc.	(11 008)	(3 770)	(4 266)	
NIKE Inc., cat. B	(3)	(436)	(476)	
Oxford Industries Inc.	(3)	(438)	(379)	
Peloton Interactive Inc.	(494)	(8 223)	(5 315)	
Penske Automotive Group Inc.	(3)	(425)	(467)	
Pool Corp.	(3)	(1 374)	(1 229)	
PulteGroup Inc.	(5)	(338)	(308)	
Purple Innovation Inc.	(943)	(26 401)	(6 120)	
PVH Corp.	(28)	(2 764)	(2 678)	
RH	(7)	(2 420)	(2 534)	
Six Flags Entertainment Corp.	(50)	(1 573)	(1 575)	
Sonos Inc.	(385)	(9 053)	(8 816)	
Spruce Power Holding Corp.	(1 329)	(10 746)	(1 655)	
Stoneridge Inc.	(15)	(372)	(438)	
Tapestry Inc.	(61)	(3 087)	(3 147)	
Target Hospitality Corp.	(188)	(3 123)	(3 857)	
Tempur Sealy International Inc.	(125)	(5 731)	(5 814)	
TJX Cos Inc.	(17)	(1 836)	(1 834)	
Topgolf Callaway Brands Corp.	(489)	(12 734)	(13 086)	
Under Armour Inc., cat. A	(825)	(11 398)	(11 357)	
Urban Outfitters Inc.	(19)	(725)	(614)	
Vail Resorts Inc.	(1)	(349)	(323)	
Victoria's Secret & Co.	(31)	(1 854)	(1 503)	
Vinco Ventures Inc.	(680)	(673)	(428)	
Visteon Corp.	(62)	(8 340)	(10 991)	
Whirlpool Corp.	(1)	(270)	(192)	
XPEL Inc.	(110)	(8 394)	(8 952)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
		(348 974)	(304 223)	(1,64)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -0,62 %)				
Calavo Growers Inc.	(141)	(6 653)	(5 617)	
Cal-Maine Foods Inc.	(56)	(4 387)	(4 132)	
Central Garden & Pet Co.	(18)	(1 084)	(873)	
Freshpet Inc.	(96)	(7 171)	(6 864)	
General Mills Inc.	(14)	(1 638)	(1 591)	
Hain Celestial Group Inc.	(92)	(2 565)	(2 017)	
J M Smucker Co.	(33)	(6 781)	(7 085)	
Kraft Heinz Co.	(217)	(11 602)	(11 970)	
LifeMD Inc.	(107)	(848)	(281)	
Mission Produce Inc.	(70)	(1 492)	(1 102)	
Molson Coors Beverage Co.	(5)	(371)	(349)	
Pilgrim's Pride Corp.	(14)	(476)	(450)	
Rite Aid Corp.	(110)	(727)	(498)	
SpartanNash Co.	(15)	(655)	(615)	
United Natural Foods Inc.	(21)	(1 109)	(1 101)	
Vector Group Ltd.	(20)	(383)	(321)	
Walgreens Boots Alliance Inc.	(5)	(338)	(253)	
		(48 280)	(45 119)	(0,24)
Soins de santé (31 décembre 2021 : -1,61 %)				
ADMA Biologics Inc.	(29)	(63)	(152)	
Alaunos Therapeutics Inc.	(516)	(2 412)	(454)	
Allakos Inc.	(47)	(436)	(536)	
Allogene Therapeutics Inc.	(199)	(2 024)	(1 696)	
Alphatec Holdings Inc.	(607)	(7 674)	(10 157)	
Anavex Life Sciences Corp.	(84)	(996)	(1 054)	
ANI Pharmaceuticals Inc.	(49)	(2 307)	(2 671)	
Arcus Biosciences Inc.	(18)	(831)	(504)	
Asensus Surgical Inc.	(956)	(1 491)	(450)	
Avidity Biosciences Inc.	(95)	(2 454)	(2 856)	
Azenta Inc.	(6)	(496)	(473)	
Becton Dickinson and Co.	(40)	(13 673)	(13 783)	
BioLife Solutions Inc.	(299)	(7 799)	(7 373)	
Bio-Techne Corp.	(70)	(7 958)	(7 861)	
Bluebird Bio Inc.	(353)	(3 257)	(3 310)	
Boston Scientific Corp.	(44)	(2 773)	(2 759)	
Bristol-Myers Squibb Co.	(4)	(384)	(390)	
Cano Health Inc.	(255)	(407)	(473)	
Cassava Sciences Inc.	(91)	(4 203)	(3 642)	
Catalent Inc.	(750)	(46 985)	(45 740)	
Celcuity Inc.	(27)	(807)	(513)	
Certara Inc.	(15)	(359)	(327)	
Checkpoint Therapeutics Inc.	(32)	(733)	(224)	
Citius Pharmaceuticals Inc.	(813)	(1 057)	(870)	
CTI BioPharma Corp.	(186)	(1 360)	(1 515)	
Dexcom Inc.	(48)	(7 653)	(7 365)	
DocGo Inc.	(49)	(474)	(469)	
Dynavax Technologies Corp.	(239)	(3 916)	(3 446)	
Eagle Pharmaceuticals Inc.	(1)	(39)	(40)	
Editas Medicine Inc.	(46)	(582)	(553)	
Elanco Animal Health Inc.	(55)	(902)	(911)	
Encompass Health Corp.	(5)	(393)	(405)	
Enzo Biochem Inc.	(325)	(999)	(630)	
Evelo Biosciences Inc.	(308)	(811)	(672)	
Evolus Inc.	(25)	(376)	(254)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Fulgent Genetics Inc.	(129)	(9 487)	(5 205)	
G1 Therapeutics Inc.	(155)	(1 295)	(1 140)	
Harvard Bioscience Inc.	(117)	(336)	(439)	
HCA Healthcare Inc.	(20)	(6 647)	(6 503)	
Hologic Inc.	(62)	(6 304)	(6 285)	
IDEXX Laboratories Inc.	(3)	(1 747)	(1 658)	
ImmunityBio Inc.	(355)	(2 577)	(2 439)	
Inotiv Inc.	(263)	(1 461)	(1 760)	
Inovio Pharmaceuticals Inc.	(376)	(1 260)	(795)	
Intellia Therapeutics Inc.	(27)	(1 333)	(1 276)	
Invitae Corp.	(1 722)	(17 385)	(4 340)	
iTeos Therapeutics Inc.	(16)	(449)	(423)	
Lantheus Holdings Inc.	(22)	(1 571)	(1 519)	
LeMaitre Vascular Inc.	(6)	(408)	(374)	
Maravai LifeSciences Holdings Inc.	(72)	(1 392)	(1 396)	
Marinus Pharmaceuticals Inc.	(110)	(1 350)	(593)	
Masimo Corp.	(3)	(598)	(601)	
MediciNova Inc.	(65)	(575)	(181)	
MiMedx Group Inc.	(452)	(2 644)	(1 703)	
Moderna Inc.	(197)	(41 258)	(47 945)	
Natera Inc.	(143)	(7 762)	(7 783)	
Neogen Corp.	(272)	(5 556)	(5 613)	
Novavax Inc.	(221)	(5 705)	(3 078)	
Oak Street Health Inc.	(352)	(9 720)	(10 259)	
Ocugen Inc.	(112)	(347)	(197)	
Omeros Corp.	(91)	(346)	(279)	
Oramed Pharmaceuticals Inc.	(235)	(1 407)	(3 831)	
Organon & Co.	(32)	(1 211)	(1 211)	
Outlook Therapeutics Inc.	(1 724)	(3 000)	(2 523)	
Pacific Biosciences of California Inc.	(747)	(10 059)	(8 279)	
PAVmed Inc.	(801)	(2 056)	(521)	
Pennant Group Inc.	(43)	(1 416)	(640)	
Penumbra Inc.	(17)	(5 039)	(5 124)	
Personalis Inc.	(30)	(365)	(80)	
Premier Inc.	(159)	(7 173)	(7 536)	
Progyny Inc.	(20)	(814)	(844)	
Provention Bio Inc.	(586)	(6 676)	(8 393)	
QuidelOrtho Corp.	(260)	(29 045)	(30 181)	
R1 RCM Inc.	(2 085)	(23 883)	(30 935)	
RAPT Therapeutics Inc.	(63)	(1 519)	(1 690)	
Reata Pharmaceuticals Inc.	(27)	(1 387)	(1 390)	
Relay Therapeutics Inc.	(18)	(368)	(364)	
ResMed Inc.	(5)	(1 505)	(1 410)	
REVOLUTION Medicines Inc.	(70)	(2 093)	(2 259)	
Rhythm Pharmaceuticals Inc.	(148)	(4 532)	(5 840)	
Rigel Pharmaceuticals Inc.	(10)	(43)	(20)	
Rocket Pharmaceuticals Inc.	(98)	(2 660)	(2 599)	
SCYNEXIS Inc.	(148)	(719)	(313)	
Seelos Therapeutics Inc.	(378)	(720)	(348)	
Senseonics Holdings Inc.	(346)	(756)	(483)	
Societal CDMO Inc.	(159)	(355)	(321)	
Solid Biosciences Inc.	(2)	(343)	(13)	
Spectrum Pharmaceuticals Inc.	(585)	(840)	(292)	
Standard BioTools Inc.	(345)	(807)	(547)	
Stereotaxis Inc.	(52)	(429)	(146)	
Stryker Corp.	(21)	(7 133)	(6 957)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Surgery Partners Inc.	(54)	(2 062)	(2 038)	
Surmodics Inc.	(25)	(1 122)	(1 156)	
Teleflex Inc.	(1)	(336)	(338)	
TG Therapeutics Inc.	(714)	(5 965)	(11 445)	
TransMedics Group Inc.	(6)	(446)	(502)	
Twist Bioscience Corp.	(15)	(494)	(484)	
Universal Health Services Inc., cat. B	(42)	(7 792)	(8 018)	
Vaxcyte Inc.	(12)	(748)	(780)	
Veradigm Inc.	(303)	(7 582)	(7 242)	
West Pharmaceutical Services Inc.	(1)	(440)	(319)	
Xeris Biopharma Holdings Inc.	(381)	(883)	(687)	
Zimmer Biomet Holdings Inc.	(24)	(4 096)	(4 146)	
Zoetis Inc.	(13)	(2 558)	(2 581)	
		(411 474)	(403 138)	(2,18)
Services financiers (31 décembre 2021 : -0,28 %)				
AG Mortgage Investment Trust Inc.	(214)	(2 062)	(1 540)	
AGNC Investment Corp.	(309)	(3 885)	(4 333)	
Ambac Financial Group Inc.	(107)	(1 131)	(2 528)	
American National Bankshares Inc.	(11)	(557)	(550)	
Ameriprise Financial Inc.	(8)	(3 532)	(3 375)	
Apollo Commercial Real Estate Finance Inc.	(21)	(361)	(306)	
Apollo Global Management Inc.	(5)	(363)	(432)	
Arlington Asset Investment Corp.	(269)	(1 958)	(1 068)	
ARMOUR Residential REIT Inc.	(510)	(4 599)	(3 890)	
Associated Banc-Corp	(367)	(11 551)	(11 482)	
Bank of Hawaii Corp.	(8)	(831)	(841)	
Bank OZK	(6)	(333)	(326)	
BOK Financial Corp.	(6)	(830)	(844)	
BrightSpire Capital Inc.	(122)	(1 324)	(1 030)	
Cherry Hill Mortgage Investment Corp.	(100)	(715)	(786)	
Citizens & Northern Corp.	(105)	(3 401)	(3 252)	
Comerica Inc.	(3)	(381)	(272)	
Commerce Bancshares Inc.	(4)	(380)	(369)	
Credit Acceptance Corp.	(1)	(672)	(643)	
Cullen/Frost Bankers Inc.	(2)	(394)	(362)	
Dynex Capital Inc.	(445)	(7 203)	(7 670)	
Enterprise Financial Services Corp.	(18)	(1 162)	(1 194)	
First American Financial Corp.	(96)	(6 879)	(6 808)	
First Bank	(100)	(1 948)	(1 864)	
First Republic Bank	(50)	(8 338)	(8 258)	
Flywire Corp.	(16)	(446)	(530)	
Franklin BSP Realty Trust Inc.	(276)	(5 376)	(4 824)	
Fulton Financial Corp.	(15)	(369)	(342)	
FVCBankcorp Inc.	(14)	(370)	(362)	
Heritage Financial Corp.	(334)	(14 313)	(13 866)	
Hope Bancorp Inc.	(18)	(363)	(312)	
Houlihan Lokey Inc.	(3)	(314)	(354)	
Invesco Mortgage Capital Inc.	(103)	(1 667)	(1 777)	
Ladder Capital Corp.	(28)	(397)	(381)	
Lakeland Financial Corp.	(6)	(616)	(593)	
MBIA Inc.	(67)	(1 151)	(1 167)	
Moelis & Co.	(7)	(409)	(364)	
National Bank Holdings Corp.	(24)	(1 367)	(1 368)	
NBT Bancorp Inc.	(37)	(2 346)	(2 177)	
New York Community Bancorp Inc.	(367)	(4 451)	(4 277)	
Old Republic International Corp.	(70)	(2 285)	(2 291)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Penns Woods Bancorp Inc.	(100)	(3 555)	(3 607)	
Perella Weinberg Partners	(100)	(1 251)	(1 328)	
Piper Sandler Cos	(4)	(775)	(706)	
Preferred Bank	(4)	(403)	(404)	
Provident Financial Services Inc.	(14)	(404)	(405)	
Republic Bancorp Inc.	(7)	(423)	(388)	
Republic First Bancorp Inc.	(597)	(2 311)	(1 739)	
Riverview Bancorp Inc.	(160)	(1 503)	(1 665)	
Southern First Bancshares Inc.	(40)	(2 480)	(2 480)	
StoneX Group Inc.	(5)	(395)	(646)	
TriCo Bancshares	(79)	(6 094)	(5 458)	
United Bankshares Inc.	(73)	(4 072)	(4 005)	
Walker & Dunlop Inc.	(3)	(385)	(319)	
Washington Federal Inc.	(7)	(352)	(318)	
Westamerica BanCorp	(5)	(364)	(400)	
Western Alliance Bancorp	(55)	(4 681)	(4 439)	
WisdomTree Inc.	(1 227)	(9 009)	(9 061)	
World Acceptance Corp.	(10)	(2 775)	(893)	
		(142 262)	(137 269)	(0,74)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -1,55 %)				
8x8 Inc.	(85)	(538)	(495)	
A10 Networks Inc.	(107)	(2 476)	(2 411)	
ACV Auctions Inc.	(66)	(793)	(734)	
Advanced Micro Devices Inc.	(741)	(76 185)	(65 031)	
Aeva Technologies Inc.	(38)	(369)	(70)	
Amphenol Corp.	(3)	(336)	(310)	
Arista Networks Inc.	(2)	(375)	(329)	
Asana Inc.	(69)	(1 281)	(1 287)	
Atlassian Corp.	(1)	(495)	(174)	
Avaya Holdings Corp.	(231)	(438)	(61)	
Bill.com Holdings Inc.	(207)	(32 840)	(30 561)	
Block Inc.	(44)	(4 041)	(3 746)	
Broadcom Inc.	(14)	(10 546)	(10 606)	
Broadridge Financial Solutions Inc.	(22)	(4 297)	(3 998)	
C3.ai Inc.	(68)	(1 184)	(1 031)	
CCC Intelligent Solutions Holdings Inc.	(69)	(812)	(813)	
CDW Corp.	(1)	(264)	(242)	
Cisco Systems Inc.	(13)	(833)	(839)	
Cleantalk Inc.	(425)	(7 238)	(1 175)	
Clearfield Inc.	(6)	(865)	(765)	
Cloudflare Inc.	(143)	(9 519)	(8 760)	
Corning Inc.	(285)	(12 794)	(12 334)	
CTS Corp.	(21)	(959)	(1 122)	
Diebold Nixdorf Inc.	(59)	(528)	(114)	
Digital Turbine Inc.	(658)	(34 367)	(13 587)	
Dropbox Inc.	(20)	(638)	(606)	
DXC Technology Co.	(41)	(1 477)	(1 472)	
Eastman Kodak Co.	(116)	(579)	(479)	
Entegris Inc.	(4)	(367)	(355)	
EPAM Systems Inc.	(20)	(10 414)	(8 881)	
Fair Isaac Corp.	(10)	(8 160)	(8 111)	
Fastly Inc.	(77)	(940)	(854)	
Fiserv Inc.	(3)	(408)	(411)	
Gen Digital Inc.	(444)	(14 010)	(12 892)	
Grid Dynamics Holdings Inc.	(155)	(3 951)	(2 356)	
International Business Machines Corp.	(301)	(60 587)	(57 461)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
IonQ Inc.	(174)	(1 018)	(813)	
Jack Henry & Associates Inc.	(13)	(3 261)	(3 092)	
Keysight Technologies Inc.	(7)	(1 711)	(1 623)	
Kimball Electronics Inc.	(100)	(3 314)	(3 061)	
Kopin Corp.	(111)	(361)	(187)	
Kyndryl Holdings Inc.	(34)	(517)	(512)	
LivePerson Inc.	(73)	(1 187)	(1 003)	
Marathon Digital Holdings Inc.	(761)	(9 347)	(3 526)	
Marqeta Inc.	(54)	(458)	(447)	
Marvell Technology Inc.	(6)	(382)	(301)	
Microsoft Corp.	(193)	(64 848)	(62 715)	
MICT Inc.	(738)	(1 352)	(830)	
Mitek Systems Inc.	(191)	(2 553)	(2 508)	
MKS Instruments Inc.	(47)	(5 160)	(5 396)	
Napco Security Technologies Inc.	(50)	(721)	(1 862)	
NCR Corp.	(17)	(532)	(539)	
NVIDIA Corp.	(330)	(68 002)	(65 345)	
Okta Inc.	(24)	(2 195)	(2 222)	
Onto Innovation Inc.	(4)	(436)	(369)	
Oracle Corp.	(31)	(3 430)	(3 433)	
OSI Systems Inc.	(6)	(637)	(646)	
PAR Technology Corp.	(39)	(2 323)	(1 378)	
Paylocity Holding Corp.	(1)	(339)	(263)	
PC Connection Inc.	(8)	(540)	(508)	
PDF Solutions Inc.	(26)	(551)	(1 005)	
PFSweb Inc.	(82)	(1 265)	(683)	
QUALCOMM Inc.	(205)	(33 293)	(30 538)	
Qualys Inc.	(5)	(900)	(760)	
Quantum Corp.	(546)	(805)	(806)	
Rackspace Technology Inc.	(137)	(897)	(548)	
Rambus Inc.	(26)	(1 316)	(1 262)	
Repay Holdings Corp.	(131)	(3 073)	(1 429)	
Riot Platforms Inc.	(972)	(19 193)	(4 465)	
Sanmina Corp.	(7)	(349)	(543)	
Shift4 Payments Inc.	(52)	(3 164)	(3 941)	
ShotSpotter Inc.	(75)	(4 358)	(3 438)	
SiTime Corp.	(13)	(3 275)	(1 790)	
Smith Micro Software Inc.	(73)	(283)	(208)	
Snowflake Inc.	(129)	(25 409)	(25 089)	
Synaptics Inc.	(14)	(1 725)	(1 805)	
TD SYNNEX Corp.	(454)	(57 542)	(58 261)	
Telos Corp.	(74)	(408)	(510)	
Turtle Beach Corp.	(100)	(3 846)	(972)	
Twilio Inc.	(106)	(6 831)	(7 032)	
Tyler Technologies Inc.	(1)	(431)	(437)	
Universal Display Corp.	(6)	(948)	(878)	
Velodyne Lidar Inc.	(2 351)	(20 674)	(2 353)	
Viasat Inc.	(33)	(1 412)	(1 415)	
Wrap Technologies Inc.	(85)	(331)	(195)	
Xerox Holdings Corp.	(52)	(1 180)	(1 029)	
Zebra Technologies Corp.	(14)	(4 894)	(4 864)	
Zoom Video Communications Inc.	(12)	(1 158)	(1 101)	
		(680 039)	(574 409)	(3,11)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Services de communication (31 décembre 2021 : -0,19 %)			
Alphabet Inc., cat. A	(488)	(63 506)	(58 339)
Alphabet Inc., cat. C	(48)	(5 892)	(5 771)
AMC Entertainment Holdings Inc.	(408)	(5 654)	(2 250)
AMC Entertainment Holdings Inc., actions priv.	(133)	(1 206)	(254)
Bumble Inc.	(34)	(1 078)	(970)
Cable One Inc.	(4)	(3 839)	(3 858)
Cardlytics Inc.	(13)	(491)	(102)
Cinedigm Corp.	(825)	(1 670)	(433)
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	(1 151)	(3 754)	(1 638)
CuriosityStream Inc.	(193)	(778)	(298)
Daily Journal Corp.	(1)	(479)	(339)
DISH Network Corp.	(8)	(360)	(152)
Entravision Communications Corp.	(152)	(917)	(989)
Eventbrite Inc.	(21)	(386)	(167)
EW Scripps Co.	(61)	(1 006)	(1 090)
FuboTV Inc.	(986)	(3 610)	(2 325)
Globalstar Inc.	(4 764)	(8 084)	(8 585)
Interpublic Group of Cos Inc.	(115)	(5 218)	(5 190)
John Wiley & Sons Inc.	(24)	(1 674)	(1 303)
Liberty Broadband Corp.	(51)	(6 169)	(5 270)
Madison Square Garden Entertainment Corp.	(6)	(381)	(366)
Magnite Inc.	(456)	(6 098)	(6 543)
Marchex Inc., cat. B	(146)	(343)	(311)
Marcus Corp.	(37)	(740)	(721)
Match Group Inc.	(17)	(1 051)	(956)
Skillz Inc.	(265)	(349)	(182)
TechTarget Inc.	(11)	(971)	(657)
Trade Desk Inc.	(381)	(26 001)	(23 143)
Ziff Davis Inc.	(10)	(1 183)	(1 072)
		(152 888)	(133 274)
			(0,72)
Services publics (31 décembre 2021 : -0,01 %)			
American Electric Power Co Inc.	(224)	(29 821)	(28 818)
American States Water Co.	(48)	(6 236)	(6 019)
Avista Corp.	(349)	(19 792)	(20 968)
Black Hills Corp.	(45)	(4 031)	(4 289)
Cadiz Inc.	(254)	(752)	(860)
California Water Service Group	(4)	(330)	(329)
Consolidated Edison Inc.	(102)	(13 181)	(13 172)
DTE Energy Co.	(99)	(16 232)	(15 766)
Duke Energy Corp.	(194)	(26 692)	(27 072)
Entergy Corp.	(7)	(1 118)	(1 067)
Essential Utilities Inc.	(89)	(5 726)	(5 756)
Eversource Energy	(8)	(910)	(909)
IDACORP Inc.	(3)	(442)	(438)
Middlesex Water Co.	(3)	(301)	(320)
NextEra Energy Inc.	(4)	(456)	(453)
NorthWestern Corp.	(13)	(905)	(1 045)
PG&E Corp.	(33)	(715)	(727)
Pinnacle West Capital Corp.	(66)	(6 993)	(6 800)
Public Service Enterprise Group Inc.	(194)	(15 989)	(16 106)
SJW Group	(32)	(3 328)	(3 520)
Southwest Gas Holdings Inc.	(55)	(4 768)	(4 611)
Spire Inc.	(14)	(1 356)	(1 306)
		(160 074)	(160 351)
			(0,87)

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Immobilier (31 décembre 2021 : -0,16 %)

Agree Realty Corp.	(23)	(2 224)	(2 210)	
Alexandria Real Estate Equities Inc.	(14)	(2 768)	(2 763)	
American Tower Corp.	(20)	(5 900)	(5 741)	
Americold Realty Trust Inc.	(9)	(348)	(345)	
Anywhere Real Estate Inc.	(44)	(424)	(381)	
Apartment Income REIT Corp.	(13)	(613)	(604)	
Apartment Investment and Management Co.	(142)	(1 059)	(1 370)	
Armada Hoffer Properties Inc.	(286)	(4 838)	(4 456)	
AvalonBay Communities Inc.	(5)	(1 106)	(1 094)	
City Office REIT Inc.	(193)	(2 799)	(2 191)	
Community Healthcare Trust Inc.	(58)	(2 786)	(2 813)	
Douglas Elliman Inc.	(10)	(128)	(55)	
Equinix Inc.	(6)	(5 426)	(5 325)	
Equity Commonwealth	(399)	(13 698)	(13 499)	
Equity Residential	(17)	(1 372)	(1 359)	
Essential Properties Realty Trust Inc.	(78)	(2 456)	(2 480)	
Essex Property Trust Inc.	(7)	(1 994)	(2 010)	
eXp World Holdings Inc.	(931)	(25 762)	(13 977)	
Farmland Partners Inc.	(100)	(1 744)	(1 688)	
Five Point Holdings LLC	(401)	(1 329)	(1 266)	
Franklin Street Properties Corp.	(723)	(2 789)	(2 674)	
Getty Realty Corp.	(11)	(510)	(505)	
Highwoods Properties Inc.	(8)	(346)	(303)	
Host Hotels & Resorts Inc.	(172)	(4 145)	(3 741)	
Howard Hughes Corp.	(3)	(314)	(311)	
Independence Realty Trust Inc.	(29)	(720)	(662)	
Invitation Homes Inc.	(42)	(1 704)	(1 687)	
iStar Inc.	(48)	(1 027)	(496)	
JBG SMITH Properties	(101)	(2 770)	(2 597)	
Life Storage Inc.	(2)	(376)	(267)	
LXP Industrial Trust	(345)	(4 808)	(4 684)	
Marcus & Millichap Inc.	(5)	(353)	(233)	
Maui Land & Pineapple Co Inc.	(100)	(1 478)	(1 276)	
Mid-America Apartment Communities Inc.	(24)	(5 143)	(5 105)	
National Health Investors Inc.	(6)	(458)	(425)	
NETSTREIT Corp.	(177)	(4 619)	(4 396)	
Opendoor Technologies Inc.	(1 127)	(2 695)	(1 771)	
Paramount Group Inc.	(43)	(369)	(346)	
Physicians Realty Trust	(262)	(5 178)	(5 137)	
RPT Realty	(24)	(361)	(326)	
Safehold Inc.	(3)	(115)	(116)	
Simon Property Group Inc.	(12)	(1 914)	(1 910)	
SITE Centers Corp.	(44)	(808)	(814)	
STAG Industrial Inc.	(156)	(7 260)	(6 829)	
Stratus Properties Inc.	(100)	(3 858)	(2 614)	
Tejon Ranch Co.	(100)	(1 964)	(2 553)	
Terreno Realty Corp.	(5)	(393)	(385)	
Veris Residential Inc.	(173)	(3 284)	(3 734)	
Zillow Group Inc.	(41)	(2 119)	(1 789)	
		<u>(140 652)</u>	<u>(123 313)</u>	(0,67)
Total des actions américaines – position vendeur		<u>(2 745 914)</u>	<u>(2 508 707)</u>	(13,56)

Actions étrangères – position acheteur

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Énergie (31 décembre 2021 : 0,91 %)

Aker BP ASA	95	4 140	3 974	
Aker Solutions ASA	2 608	7 291	13 416	
Ardmore Shipping Corp.	75	349	1 464	
Borr Drilling Ltd.	217	866	1 592	
Boss Energy Ltd.	1 087	2 299	2 127	
BW Energy Ltd.	132	487	456	
BW LPG Ltd.	113	823	1 178	
BW Offshore Ltd.	256	1 057	875	
Core Laboratories NV	13	370	357	
DHT Holdings Inc.	707	6 466	8 507	
DNO ASA	871	1 567	1 415	
Dorian LPG Ltd.	309	6 018	7 934	
Ecopetrol SA	543	7 128	7 703	
Elixir Energy Ltd.	2 578	345	355	
FLEX LNG Ltd.	307	7 760	13 546	
Frontline Ltd., NYSE	1 017	13 804	16 729	
Hafnia Ltd.	317	2 151	2 198	
International Seaways Inc.	388	8 474	19 462	
Ithaca Energy PLC	377	1 446	1 124	
MOL Hungarian Oil & Gas PLC	265	2 658	2 490	
Nabors Industries Ltd.	47	7 986	9 863	
Nabors Industries Ltd., bons de souscriptions, éch. le 11 juin 2026	26	–	1 159	
Nippon Coke & Engineering Co., Ltd.	300	454	262	
Nordic American Tankers Ltd.	1 954	6 307	8 102	
Oil Refineries Ltd.	3 823	1 902	1 807	
Panoro Energy ASA	68	209	262	
PGS ASA	815	820	786	
Saipem SpA	7 613	11 096	12 413	
Santos Ltd.	591	3 914	3 877	
Saras SpA	3 914	3 793	6 503	
Scorpio Tankers Inc.	86	6 166	6 266	
Semirara Mining & Power Corp.	6 600	6 086	5 536	
SFL Corp. Ltd.	1 882	18 245	23 511	
Subsea 7 SA	189	2 607	2 939	
Teekay Corp.	268	1 136	1 649	
TORM PLC	55	1 121	2 122	
Transocean Ltd.	3 651	15 477	22 558	
Valaris Ltd.	17	1 525	1 558	
Whitehaven Coal Ltd.	727	6 336	6 293	
YPF SA	4 256	25 185	52 996	
		195 864	277 364	1,50

Matières premières (31 décembre 2021 : 0,81 %)

Allkem Ltd.	689	8 724	7 116	
Aluminum Corp. of China Ltd.	2 000	1 053	1 153	
BHP Group Ltd.	15	1 279	1 261	
Borregaard ASA	12	369	251	
Cemex SAB de CV	1	7	5	
Core Lithium Ltd.	3 728	4 018	3 511	
CRH PLC	395	19 162	21 296	
Dai Nippon Toryo Co., Ltd.	300	2 250	2 314	
Dottikon Es Holding AG	1	405	368	
DRDGOLD Ltd.	100	695	1 003	
Elkem ASA	74	326	358	
Evonik Industries AG	17	429	441	
Ferroglobe PLC	38	398	198	
Fortescue Metals Group Ltd.	198	3 701	3 731	
Fujikura Kasei Co., Ltd.	200	1 390	832	
Gerdau SA	1 440	11 356	10 809	
Grange Resources Ltd.	3 917	998	3 041	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Harmony Gold Mining Co., Ltd.	3	21	14
Hexpol AB	25	403	361
IGO Ltd.	458	5 750	5 665
Israel Corp. Ltd.	18	10 453	8 571
JCU Corp.	100	3 218	3 163
Kurimoto Ltd.	100	1 499	1 791
Kyowa Leather Cloth Co., Ltd.	100	464	511
Linde PLC	1	448	442
Macmahon Holdings Ltd.	2 589	354	345
Mineral Resources Ltd.	152	11 668	10 782
Newcrest Mining Ltd., ASX	277	5 194	5 253
Nissan Chemical Corp.	100	7 490	5 936
Norsk Hydro ASA	1 608	16 750	16 216
Norske Skog ASA	647	5 025	5 985
Northern Star Resources Ltd.	476	4 859	4 772
Novozymes A/S	169	12 194	11 565
Pilbara Minerals Ltd.	3 205	13 243	11 044
POSCO Holdings Inc.	146	10 789	10 775
Regis Resources Ltd.	377	711	714
Sandfire Resources Ltd.	1 795	8 864	8 973
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	98	11 902	10 602
South32 Ltd.	297	1 117	1 092
Ten Sixty Four Ltd.	1 777	1 048	1 045
Tokuyama Corp.	500	11 516	9 222
Tokyo Rope Manufacturing Co., Ltd.	100	856	875
Trinseo PLC	15	529	462
Tsaker New Energy Tech Co., Ltd.	2 500	587	560
Vale SA	1 880	41 015	43 228
Venator Materials PLC	993	3 375	726
		<u>247 902</u>	<u>238 378</u>
Industries (31 décembre 2021 : 3,11 %)			1,29
2020 Bulkers Ltd.	79	1 427	1 006
Aalberts NV	32	1 538	1 677
AddTech AB	159	4 263	3 075
Alfa Laval AB	115	4 210	4 503
Belimo Holding AG	7	3 784	4 511
Bossard Holding AG	4	1 681	1 170
Cargotec Oyj	15	771	896
CNH Industrial NV	346	6 226	7 488
Coor Service Management Holding AB	49	551	410
Corp America Airports SA	625	3 587	7 393
D/S Norden A/S	32	2 183	2 601
Deutsche Lufthansa AG	15	139	168
Dfds A/S	5	371	249
Elbit Systems Ltd.	29	7 583	6 374
Embraer SA	397	5 618	5 879
Endo Lighting Corp.	100	831	736
Ferguson PLC, NYSE	26	4 472	4 473
FLSmidth & Co A/S	180	6 447	8 810
Flughafen Zurich AG	34	7 818	7 125
FNM SpA	1 461	1 017	897
FSE Lifestyle Services Ltd.	994	650	939
Golden Ocean Group Ltd., NASD	879	11 068	10 350
H+H International A/S	7	355	140
Hexatronic Group AB	932	11 744	17 156
Hino Motors Ltd.	100	1 093	517
Huber + Suhner AG	3	365	379
International Container Terminal Services Inc.	160	571	778
Interpump Group SpA	7	372	427
Investment AB Latour	8	360	205

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Inwido AB	8	72	115	
ISS A/S	178	4 048	5 099	
Japan Transcity Corp.	400	2 050	2 099	
JGC Holdings Corp.	100	1 782	1 723	
JK Holdings Co., Ltd.	100	1 025	1 053	
KION Group AG	267	8 398	10 336	
Kongsberg Gruppen ASA	82	3 563	4 687	
Kornit Digital Ltd.	6	1 193	187	
Leonardo SpA	460	6 107	5 362	
Lifco AB	236	7 562	5 345	
Matsui Construction Co., Ltd.	200	1 023	1 150	
Monadelphous Group Ltd.	156	1 966	1 915	
Munters Group AB	75	506	1 004	
Nakano Corp.	100	575	321	
Nibe Industrier AB	1 263	19 478	15 948	
Nice Corp.	100	1 289	1 403	
Nilfisk Holding A/S	8	345	228	
Nippon Sheet Glass Co., Ltd.	100	679	582	
Nitto Kogyo Corp.	200	4 926	4 839	
NKT A/S	207	12 783	15 755	
Nordex SE	192	2 442	3 665	
Okabe Co., Ltd.	200	1 480	1 427	
Pegasus Sewing Machine Manufacturing Co., Ltd.	200	1 079	1 592	
Per Aarsleff Holding A/S, cat. B	50	2 108	2 547	
Pronexus Inc.	100	1 057	986	
Prysmian SpA	16	649	802	
RELX PLC, CAAE	28	987	1 052	
Rheinmetall AG	1	257	269	
Safe Bulkers Inc.	1 426	2 373	5 623	
Sansha Electric Manufacturing Co., Ltd.	300	3 178	2 659	
Sanyo Trading Co., Ltd.	100	1 111	1 155	
Sato Shoji Corp.	100	1 185	1 249	
Scope Metals Group Ltd.	44	2 355	2 215	
Sensata Technologies Holding PLC	20	1 089	1 094	
Seven Group Holdings Ltd.	19	362	366	
Shikun & Binui Ltd.	6	28	23	
Shinwa Co., Ltd.	100	2 952	2 063	
Sinfonia Technology Co., Ltd.	100	1 474	1 514	
SKF AB	18	401	373	
Solar A/S	3	378	362	
Stolt-Nielsen Ltd.	100	3 354	3 707	
Systemair AB	160	798	1 494	
Tobishima Corp.	100	1 007	1 035	
Toli Corp.	600	1 647	1 405	
TOMRA Systems ASA	246	6 487	5 603	
Toyo Engineering Corp.	200	2 321	1 154	
Trelleborg AB	18	490	564	
Troax Group AB	13	697	309	
Wallenius Wilhelmsen ASA	1 588	11 301	21 198	
Wilh Wilhelmsen Holding ASA	34	1 074	1 281	
Will Group Inc.	200	2 697	2 460	
Yasuda Logistics Corp.	100	987	950	
Yushin Precision Equipment Co., Ltd.	100	664	684	
		230 934	252 363	1,36
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 2,32 %)				
Aeffe SpA	261	758	467	
After You PCL	2	1	1	
Arcos Dorados Holdings Inc.	918	7 182	10 399	
Aristocrat Leisure Ltd.	160	4 607	4 487	
BAIC Motor Corp. Ltd.	494	311	178	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Baroque Japan Ltd.	100	776	844
Bloomberry Resorts Corp.	2 400	358	446
Byggnax Group AB	33	353	213
Carnival Corp.	1 626	19 125	17 757
China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd.	2 000	2 679	2 014
China ZhengTong Auto Services Holdings Ltd.	4 500	438	555
Clas Ohlson AB	50	881	468
Cleanup Corp.	300	2 091	1 990
Collins Foods Ltd.	460	4 163	3 039
Continental AG	11	792	890
Delek Automotive Systems Ltd.	244	3 333	3 861
Edvantage Group Holdings Ltd.	4 000	1 312	2 451
Elica SpA	100	420	429
Farfetch Ltd.	308	1 847	1 974
Fox Wizel Ltd.	2	434	247
Geox SpA	216	373	251
Grand Baoxin Auto Group Ltd.	7 000	582	541
H & M Hennes & Mauritz AB	18	250	263
Hamee Corp.	100	703	731
H-One Co., Ltd.	400	3 435	2 526
HUGO BOSS AG	6	401	470
IJTT Co., Ltd.	100	607	514
IMMSI SpA	700	359	415
International Game Technology PLC	15	397	461
International Housewares Retail Co., Ltd.	2 000	956	1 017
InvoCare Ltd.	36	368	365
JVCKenwood Corp.	200	665	758
Komatsu Matere Co., Ltd.	100	1 107	795
Lastminute.com NV	36	1 208	1 070
MIPS AB	9	729	503
Mitchells & Butlers PLC	29	135	65
Moncler SpA	51	3 869	3 651
Nissan Motor Co., Ltd.	100	673	429
Nissan Tokyo Sales Holdings Co., Ltd.	800	2 368	2 407
Niu Technologies	602	16 369	4 266
Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	571	11 945	9 470
Oriental Land Co., Ltd.	100	19 846	19 676
OVS SpA	1 361	2 689	4 145
Pandora A/S	271	30 434	25 722
Playa Hotels & Resorts NV	593	4 827	5 247
Playtech PLC	114	843	946
Propel Funeral Partners Ltd.	288	1 166	1 146
Rakuten Group Inc.	600	3 817	3 672
Royal Caribbean Cruises Ltd.	242	18 097	16 208
Sabaf SpA	9	355	217
Salvatore Ferragamo SpA	173	3 916	4 125
Sanden Corp.	200	452	401
Sanlorenzo SpA	7	348	374
Scandic Hotels Group AB	293	1 632	1 228
Sekisui Chemical Co., Ltd.	100	2 080	1 895
Super Retail Group Ltd.	278	2 786	2 736
Webjet Ltd.	975	5 601	5 537
Xingda International Holdings Ltd.	1 000	285	273
Yachiyo Industry Co., Ltd.	800	5 324	11 493
Yakiniku Sakai Holdings Inc.	500	339	359
		<u>204 197</u>	<u>189 078</u>
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 0,43 %)			1,02
A2 Milk Co., Ltd.	539	2 272	3 409
Ambev SA	223	774	822
Anheuser-Busch InBev SA, CAAE	242	17 420	19 687

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Axfood AB	37	1 380	1 376	
BRF SA, CAAE	2 522	5 354	5 399	
Bunge Ltd.	30	3 912	4 056	
Carlsberg AS	6	1 025	1 077	
Cloetta AB	89	359	241	
Coca-Cola Femsa SAB de CV, NYSE	6	373	552	
CP ALL PCL	200	473	534	
Davide Campari-Milano NV	207	2 803	2 839	
Eco's Co., Ltd.	200	4 226	3 869	
Fancl Corp.	400	9 756	11 041	
Lucas Bols NV	100	1 395	1 489	
Rami Levy Chain Stores Hashikma Marketing 2006 Ltd.	8	751	756	
Rock Field Co., Ltd.	100	1 320	1 549	
Scandinavian Tobacco Group A/S	48	1 318	1 140	
Synlait Milk Ltd.	148	369	448	
Weilong Delicious Global Holdings Ltd.	70	131	128	
Yamaya Corp.	100	2 437	2 566	
Yatsen Holding Ltd.	372	648	736	
		58 496	63 714	0,34
Soins de santé (31 décembre 2021 : 1,11 %)				
Affimed NV	59	353	99	
Alcon Inc., NYSE	5	399	464	
Alkermes PLC	195	6 013	6 904	
Ambu A/S	367	5 682	6 352	
Argenx SE, CAAE	19	8 927	9 753	
Arjo AB	44	588	223	
Austar Lifesciences Ltd.	2 000	461	701	
Chemometec A/S	57	8 159	7 654	
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	4 000	6 012	5 694	
Demant A/S	7	449	262	
El.En. SpA	325	5 907	6 697	
Elekta AB	57	733	466	
Essex Bio-technology Ltd.	1 000	706	729	
France Bed Holdings Co., Ltd.	200	1 694	1 931	
Galenica AG	9	823	996	
Genmab A/S	8	4 822	4 575	
Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc.	100	4 496	4 031	
Humana AB	25	250	125	
HUTCHMED China Ltd., NASD	33	534	661	
Inmode Ltd.	75	3 634	3 628	
Jazz Pharmaceuticals PLC	152	30 721	32 810	
Koninklijke Philips NV, NYSE	149	4 020	3 026	
Nano-X Imaging Ltd.	51	492	510	
Neuren Pharmaceuticals Ltd.	902	6 131	6 589	
Novartis AG, CAAE	139	17 460	17 086	
Novo Nordisk A/S	238	33 472	43 412	
Novo Nordisk A/S, CAAE	119	17 564	21 822	
Oceania Healthcare Ltd.	585	388	381	
Prothena Corp. PLC	22	1 735	1 796	
Richter Gedeon Nyrt	20	596	599	
Sectra AB	72	–	9	
Sino Biopharmaceutical Ltd.	1 000	787	793	
WuXi AppTec Co., Ltd., HKG	300	3 462	4 294	
Xvivo Perfusion AB	13	400	309	
Ypsomed Holding AG	2	503	494	
Zai Lab Ltd.	208	17 784	8 652	
		196 157	204 527	1,11
Services financiers (31 décembre 2021 : 0,30 %)				
ABG Sundal Collier Holding ASA	1 308	1 113	1 013	
AIA Group Ltd.	400	5 885	6 027	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Akita Bank Ltd.	100	1 465	1 964	
Assicurazioni Generali SpA	683	16 549	16 410	
AUB Group Ltd.	53	1 032	1 097	
Avanza Bank Holding AB	137	5 127	3 984	
Axis Capital Holdings Ltd.	34	2 577	2 496	
B2Holding ASA	1 437	1 597	1 554	
Banca Generali SpA	72	3 277	3 338	
Banca IFIS SpA	386	7 473	7 430	
Banco Bradesco SA	100	471	390	
Bank of Chongqing Co., Ltd.	1 000	717	707	
BFF Bank SpA	1 035	10 875	11 091	
BPER Banca	1 698	4 346	4 711	
Burford Capital Ltd., NYSE	184	2 071	2 032	
Chiba Kogyo Bank Ltd.	200	741	934	
China Pacific Insurance Group Co., Ltd., HKG	200	629	603	
Credit Suisse Group AG	304	1 357	1 252	
CSSC Hong Kong Shipping Co., Ltd.	2 000	386	403	
DNB Bank ASA	15	364	401	
Entrust Inc.	100	660	840	
Everest Re Group Ltd.	1	300	449	
FIBI Holdings Ltd.	56	3 238	3 153	
FinecoBank Banca Fineco SpA	233	4 047	5 229	
First International Bank Of Israel Ltd.	14	771	747	
Futu Holdings Ltd.	53	4 499	2 919	
Gjensidige Forsikring ASA	12	374	317	
Grupo Aval Acciones y Valores SA	106	713	363	
Helvetia Holding AG	7	1 077	1 105	
Humm Group Ltd.	275	426	143	
IDI Insurance Co., Ltd.	18	818	525	
Intesa Sanpaolo SpA	9 241	25 686	27 769	
ISX Financial EU Ltd.	118	–	–	
Itau Unibanco Holding SA	67	358	428	
JMT Network Services PCL	100	303	270	
Macquarie Group Ltd.	10	1 573	1 534	
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	145	1 957	1 884	
Mizrahi Tefahot Bank Ltd.	7	361	306	
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	3	1 089	1 319	
OTP Bank Nyrt	215	9 501	7 849	
PICC Property & Casualty Co., Ltd.	2 000	2 661	2 573	
QBE Insurance Group Ltd.	502	6 035	6 195	
RenaissanceRe Holdings Ltd.	4	1 016	998	
Sparebank 1 Oestlandet	100	1 573	1 667	
Steadfast Group Ltd.	3 309	16 378	16 632	
Swiss Re AG	3	306	380	
Swissquote Group Holding SA	1	249	196	
Sydbank AS	30	1 464	1 707	
Tamburi Investment Partners SpA	67	835	708	
Tochigi Bank Ltd.	1 400	3 375	4 486	
TOMONY Holdings Inc.	400	1 713	1 520	
Tryg A/S	802	23 586	25 787	
UniCredit SpA	2 465	33 085	47 310	
Willis Towers Watson PLC	1	254	331	
Zenkoku Hoshu Co., Ltd.	100	4 725	5 186	
		223 058	240 662	1,30
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 1,57 %)				
A&D HOLON Holdings Co., Ltd.	100	1 223	1 044	
Aichi Tokei Denki Co., Ltd.	100	1 310	1 371	
AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	18	371	833	
Axell Corp.	400	4 020	6 868	
Canon Marketing Japan Inc.	100	3 069	3 069	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

China Aerospace International Holdings Ltd.	11 983	939	874	
Comet Holding AG	2	926	574	
CyberArk Software Ltd.	167	34 389	29 337	
Daitron Co., Ltd.	100	1 526	2 343	
Datalogic SpA	33	760	397	
HMS Networks AB	8	458	353	
Hochiki Corp.	300	5 719	4 316	
ID Holdings Corp.	100	847	964	
ISB Corp.	600	9 176	6 944	
JinkoSolar Holding Co., Ltd.	242	14 651	13 405	
Kyowa Electronic Instruments Co., Ltd.	1 000	5 020	3 574	
Lagercrantz Group AB	77	1 271	1 034	
LG Display Co., Ltd.	28	359	188	
Maxeon Solar Technologies Ltd.	34	1 030	740	
Netbay PCL	1	1	1	
Nordic Semiconductor ASA	65	1 418	1 465	
Nova Ltd.	96	3 984	10 528	
NXP Semiconductors NV	83	18 505	17 772	
Praemium Ltd.	792	583	582	
Radware Ltd.	63	2 523	1 686	
Renesas Electronics Corp.	600	7 992	7 292	
Reply SpA	46	9 750	7 118	
Ryoden Corp.	100	1 478	1 740	
SAP SE, CAAE	322	42 237	45 021	
Southern Cross Payments Ltd.	3 745	3 967	1 841	
SUMCO Corp.	300	6 128	5 413	
Sun-Wa Technos Corp.	200	2 875	3 280	
Technology One Ltd.	362	3 979	4 371	
Thine Electronics Inc.	100	988	898	
Tobii AB	489	4 009	1 063	
Truly International Holdings Ltd.	4 000	809	847	
WiiT SpA	16	781	416	
Wix.com Ltd.	155	17 029	16 136	
Xunlei Ltd.	526	1 896	1 297	
Yokogawa Electric Corp	400	9 678	8 647	
		<u>227 674</u>	<u>215 642</u>	1,17
Services de communication (31 décembre 2021 : 1,36 %)				
Asahi Net Inc.	300	1 893	1 759	
Avex Inc.	100	1 721	1 729	
Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd.	406	904	946	
Cairo Communication SpA	511	1 294	1 100	
CITIC Telecom International Holdings Ltd.	1 000	472	460	
G5 Entertainment AB	31	1 138	848	
Inkeverse Group Ltd.	1 994	416	336	
Mediaset Espana Comunicacion SA	25	258	120	
Nexon Co., Ltd.	100	2 452	3 042	
Paradox Interactive AB	17	437	469	
Schibsted ASA	97	2 699	2 475	
SK Telecom Co., Ltd.	316	11 557	8 816	
Sohu.com Ltd.	17	361	316	
TX Group AG	8	1 458	1 734	
		<u>27 060</u>	<u>24 150</u>	0,13
Services publics (31 décembre 2021 : 1,13 %)				
Brookfield Infrastructure Partners LP	3 599	170 543	150 937	
Brookfield Renewable Partners LP	500	17 891	17 140	
China Oil & Gas Group Ltd.	20 000	1 211	1 042	
Cia Energetica de Minas Gerais	423	1 122	1 163	
Hiroshima Gas Co., Ltd.	300	1 007	1 060	
Infratil Ltd.	460	3 191	3 410	
Iren SpA	93	357	197	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Kenon Holdings Ltd.	315	16 550	14 097	
Korea Electric Power Corp.	28	360	328	
National Grid PLC, CAAE	17	1 395	1 389	
Origin Energy Ltd.	704	4 813	4 994	
		218 440	195 757	1,06
Immobilier (31 décembre 2021 : 0,42 %)				
Airport City Ltd.	492	14 495	10 624	
Charter Hall Retail REIT	143	523	503	
China Vanke Co., Ltd., HKG	400	878	1 097	
CK Asset Holdings Ltd.	500	3 995	4 171	
Dios Fastigheter AB	31	441	304	
Garda Property Group	306	399	366	
Goodman Property Trust	169	362	293	
GPT Group	393	1 611	1 517	
Hankyu Hanshin REIT Inc.	4	5 970	6 264	
Israel Land Development Co., Ltd.	18	389	268	
Isras Investment Co., Ltd.	1	335	259	
Japan Excellent Inc.	1	1 551	1 345	
Lendlease Corp. Ltd.	102	707	735	
Longfor Group Holdings Ltd.	1 500	4 261	6 328	
Lotus's Retail Growth Freehold And Leasehold Property Fund	800	373	397	
Nisshin Group Holdings Co., Ltd.	400	2 439	1 766	
Olav Thon Eiendomsselskap ASA	13	355	314	
Reit 1 Ltd.	5	42	33	
Rural Funds Group	436	980	966	
SC Asset Corp. PCL	7 600	1 055	1 255	
Selvaag Bolig ASA	412	2 906	1 816	
Swire Properties Ltd.	1 400	4 166	4 822	
Tokyo Rakutenchi Co., Ltd.	100	3 979	4 180	
Wihlborgs Fastigheter AB	30	436	306	
		52 648	49 929	0,27
Total des actions étrangères – position acheteur		1 882 430	1 951 564	10,55
Actions étrangères – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2021 : -0,88 %)				
Akastor ASA	(6 035)	(9 633)	(7 653)	
Aker BP ASA	(100)	(4 436)	(4 183)	
Beach Energy Ltd.	(416)	(457)	(610)	
Cooper Energy Ltd.	(10 491)	(3 388)	(1 783)	
CropEnergies AG	(318)	(5 486)	(5 987)	
D'Amico International Shipping SA	(9)	(1)	(5)	
Deutsche Rohstoff AG	(102)	(3 687)	(3 835)	
Eni SpA, MIL	(596)	(11 600)	(11 451)	
Eni SpA, NYSE	(352)	(13 670)	(13 669)	
Euronav NV	(147)	(2 031)	(3 335)	
Galp Energia SGPS SA	(1 145)	(18 290)	(20 879)	
Paz Oil Co., Ltd.	(4)	(657)	(673)	
PGS ASA	(177)	(85)	(171)	
PGS ASA, droits	(14)	–	(1)	
Reliance Industries Ltd., CIAE	(26)	(2 258)	(2 167)	
Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	(33)	(2 149)	(2 777)	
Shell PLC, CAAE	(712)	(53 722)	(54 941)	
TechnipFMC PLC	(1 244)	(19 914)	(20 547)	
Tenaris SA	(444)	(17 776)	(21 152)	
TGS ASA	(606)	(12 478)	(11 003)	
Weatherford International PLC	(63)	(4 275)	(4 347)	
Woodside Energy Group Ltd., CAAE	(71)	(2 058)	(2 329)	
Worley Ltd.	(24)	(260)	(331)	
		(188 311)	(193 829)	(1,05)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Matières premières (31 décembre 2021 : -1,89 %)

Akzo Nobel NV	(4)	(338)	(362)	
Altri SGPS SA	(44)	(373)	(318)	
AngloGold Ashanti Ltd.	(466)	(11 336)	(12 262)	
Asahi Kasei Corp.	(100)	(957)	(967)	
Bellevue Gold Ltd.	(34 120)	(26 126)	(35 427)	
Buzzi Unicem SpA	(80)	(1 950)	(2 082)	
Cementir Holding NV	(294)	(2 509)	(2 610)	
Champion Iron Ltd.	(100)	(421)	(675)	
Chr Hansen Holding A/S	(155)	(13 268)	(15 062)	
Cia de Minas Buenaventura SAA	(2 050)	(22 638)	(20 694)	
Cia Siderurgica Nacional SA	(2 320)	(8 552)	(8 676)	
Covestro AG	(5)	(287)	(264)	
CSR Ltd.	(719)	(3 259)	(3 112)	
Daicel Corp.	(800)	(7 959)	(7 846)	
Daiki Aluminium Industry Co., Ltd.	(100)	(1 278)	(1 274)	
GCC SAB de CV	(15)	(106)	(136)	
Gold Fields Ltd.	(63)	(882)	(884)	
Gold Road Resources Ltd.	(1 102)	(1 656)	(1 711)	
Hokuetsu Corp.	(100)	(698)	(783)	
K+S AG	(15)	(456)	(399)	
LANXESS AG	(8)	(417)	(436)	
Loma Negra Cia Industrial Argentina SA	(334)	(2 588)	(3 100)	
LyondellBasell Industries NV	(5)	(552)	(563)	
Nippon Denko Co., Ltd.	(100)	(358)	(361)	
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	(5 100)	(82 034)	(54 415)	
Nippon Steel Corp.	(600)	(13 741)	(14 122)	
Nufarm Ltd.	(75)	(364)	(422)	
Oji Holdings Corp.	(300)	(1 859)	(1 636)	
Orora Ltd.	(109)	(359)	(289)	
Perenti Ltd.	(1 354)	(996)	(1 636)	
Red 5 Ltd.	(1 675)	(433)	(316)	
Rengo Co., Ltd.	(600)	(5 147)	(5 595)	
SOL SpA	(29)	(678)	(742)	
Solvay SA	(4)	(495)	(546)	
SSAB AB, série B	(846)	(5 489)	(5 963)	
Sumitomo Chemical Co., Ltd.	(100)	(633)	(487)	
Syrah Resources Ltd.	(690)	(845)	(1 306)	
Tata Steel Ltd.	(14)	(354)	(257)	
W-Scope Corp.	(100)	(1 052)	(1 363)	
Yara International ASA	(27)	(1 619)	(1 599)	
Zignago Vetro SpA	(100)	(2 310)	(2 039)	
		(227 372)	(212 737)	(1,15)

Industries (31 décembre 2021 : -2,04 %)

Adecco Group AG	(1)	(73)	(45)	
AerCap Holdings NV	(592)	(38 116)	(46 781)	
Aéroports de Paris	(30)	(5 550)	(5 432)	
AGC Inc.	(100)	(4 679)	(4 513)	
Air France-KLM	(14)	(25)	(25)	
Air New Zealand Ltd.	(791)	(653)	(505)	
Aker Carbon Capture ASA	(12)	(8)	(19)	
Amada Co., Ltd.	(100)	(1 102)	(1 062)	
AP Moller - Maersk A/S	(15)	(41 246)	(45 562)	
Avon Protection PLC	(175)	(2 861)	(3 066)	
Benefit One Inc.	(200)	(6 064)	(3 970)	
Bpost SA	(149)	(1 301)	(1 035)	
Central Japan Railway Co.	(100)	(16 474)	(16 641)	
Chugai Ro Co., Ltd.	(100)	(1 557)	(1 662)	
Controladora Vuela Cia de Aviacion SAB de CV, NYSE	(1 118)	(18 981)	(12 664)	
Copa Holdings SA	(19)	(1 532)	(2 141)	
Daifuku Co., Ltd.	(100)	(6 902)	(6 346)	
DSV A/S	(72)	(12 706)	(15 352)	
Ebara Jitsugyo Co., Ltd.	(100)	(2 107)	(2 263)	
EHang Holdings Ltd.	(48)	(529)	(558)	
Elco Ltd.	(85)	(6 186)	(5 875)	
Electro Optic Systems Holdings Ltd.	(231)	(1 147)	(103)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Enav SpA	(1 259)	(6 543)	(7 210)
Endur ASA	(76)	(361)	(361)
Eolus Vind AB	(15)	(368)	(206)
FDK Corp.	(200)	(1 875)	(1 885)
Fila SpA	(50)	(484)	(503)
Fletcher Building Ltd.	(116)	(628)	(469)
Fluidra SA	(955)	(16 914)	(20 052)
Forum Engineering Inc.	(100)	(860)	(870)
Freightways Ltd.	(156)	(1 672)	(1 291)
Fujitec Co., Ltd.	(100)	(3 189)	(3 078)
Grafton Group PLC	(22)	(444)	(283)
Hexagon Composites ASA	(157)	(582)	(592)
Idec Corp.	(400)	(12 587)	(11 994)
Ilika PLC	(380)	(357)	(150)
Instalco AB	(110)	(735)	(567)
Japan Foundation Engineering Co., Ltd.	(100)	(652)	(497)
JET2 PLC	(265)	(5 393)	(4 140)
Johns Lyng Group Ltd.	(259)	(1 457)	(1 473)
Kajima Corp.	(100)	(1 442)	(1 577)
Kawasaki Heavy Industries Ltd.	(500)	(14 058)	(15 866)
Kelsian Group Ltd.	(56)	(351)	(296)
King Jim Co., Ltd.	(100)	(888)	(913)
Komatsu Wall Industry Co., Ltd.	(100)	(1 684)	(1 865)
Komax Holding AG	(8)	(2 726)	(3 017)
Kuehne + Nagel International AG	(1)	(385)	(315)
Link And Motivation Inc.	(300)	(1 630)	(1 987)
Mainfreight Ltd.	(8)	(564)	(463)
Makita Corp.	(300)	(10 984)	(9 489)
Midac Holdings Co., Ltd.	(100)	(4 767)	(2 639)
Mitsui & Co., Ltd.	(800)	(31 319)	(31 654)
Nakabayashi Co., Ltd.	(100)	(711)	(493)
NCC AB	(17)	(377)	(215)
NEL ASA	(7 705)	(17 306)	(14 683)
NHOA	(30)	(623)	(412)
Nippon Thompson Co., Ltd.	(100)	(689)	(530)
Nisshinbo Holdings Inc.	(100)	(1 086)	(1 000)
OC Oerlikon Corp. AG	(36)	(356)	(319)
Oesterreichische Post AG	(8)	(380)	(340)
OHB SE	(89)	(4 489)	(4 151)
Okamura Corp.	(200)	(4 014)	(2 923)
Okumura Corp.	(100)	(2 941)	(3 065)
OSG Corp.	(500)	(9 684)	(9 329)
Peab AB	(24)	(368)	(184)
PeopleIN Ltd.	(121)	(357)	(354)
Pilot Corp.	(200)	(9 583)	(9 869)
PNE AG	(886)	(10 480)	(27 354)
Prosegur Cia de Seguridad SA	(50)	(292)	(128)
PS Mitsubishi Construction Co., Ltd.	(700)	(3 868)	(4 399)
Reece Ltd.	(272)	(4 730)	(3 537)
Reliance Worldwide Corp. Ltd.	(2 352)	(9 544)	(6 397)
Rheon Automatic Machinery Co., Ltd.	(100)	(1 090)	(1 102)
Sankyu Inc.	(100)	(4 990)	(4 960)
SATS Ltd.	(300)	(1 117)	(861)
SBS Holdings Inc.	(100)	(2 971)	(2 856)
Shapir Engineering and Industry Ltd.	(89)	(840)	(949)
Stabilus SE	(5)	(465)	(455)
Taisei Corp.	(600)	(24 340)	(26 186)
Talenom Oyj	(65)	(993)	(855)
Textainer Group Holdings Ltd.	(140)	(5 768)	(5 882)
THK Co., Ltd.	(100)	(3 233)	(2 583)
Tinexta SpA	(96)	(3 051)	(3 165)
Tobu Railway Co., Ltd.	(100)	(3 183)	(3 163)
Toyota Industries Corp.	(100)	(7 845)	(7 435)
Trane Technologies PLC	(24)	(5 681)	(5 466)
Traton SE	(17)	(392)	(347)
Tsugami Corp.	(200)	(4 563)	(2 389)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Vow ASA	(73)	(344)	(178)	
West Japan Railway Co.	(200)	(11 782)	(11 766)	
Yamashina Corp.	(400)	(327)	(263)	
		(460 551)	(471 865)	(2,55)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -2,93 %)				
AB Dynamics PLC	(11)	(347)	(287)	
Accent Group Ltd.	(423)	(559)	(653)	
AOKI Holdings Inc.	(100)	(655)	(702)	
Aptiv PLC	(48)	(6 030)	(6 057)	
ARB Corp. Ltd.	(35)	(1 365)	(826)	
ASKUL Corp.	(200)	(3 564)	(3 510)	
Autoneum Holding AG	(2)	(321)	(299)	
Azorim-Investment Development & Construction Co., Ltd.	(609)	(2 831)	(2 640)	
Baby Bunting Group Ltd.	(98)	(430)	(244)	
Bapcor Ltd.	(1 072)	(6 811)	(6 363)	
Benesse Holdings Inc.	(300)	(8 187)	(6 180)	
BHG Group AB	(432)	(6 384)	(1 043)	
Bic Camera Inc.	(300)	(3 433)	(3 950)	
Boozt AB	(16)	(376)	(250)	
Brembo SpA	(144)	(1 921)	(2 176)	
Capri Holdings Ltd.	(28)	(2 171)	(2 175)	
Chargeurs SA	(175)	(3 158)	(3 563)	
Cie Financière Richemont SA	(1)	(143)	(176)	
CIR SpA-Compagnie Industriali	(2 696)	(1 769)	(1 694)	
Corporate Travel Management Ltd.	(18)	(345)	(244)	
Create Restaurants Holdings Inc.	(200)	(1 461)	(1 869)	
Daido Metal Co., Ltd.	(300)	(1 464)	(1 470)	
De' Longhi SpA	(97)	(2 501)	(2 943)	
Demae-Can Co., Ltd.	(300)	(5 850)	(1 325)	
Eagers Automotive Ltd.	(808)	(9 873)	(8 056)	
ES-Con Japan Ltd.	(800)	(6 758)	(6 424)	
Europris ASA	(37)	(366)	(349)	
Fielmann AG	(28)	(1 945)	(1 499)	
Fuji Corp. Ltd.	(600)	(3 688)	(4 054)	
Garmin Ltd.	(16)	(2 054)	(2 001)	
Gfoot Co., Ltd.	(100)	(448)	(302)	
GreenTree Hospitality Group Ltd.	(66)	(351)	(332)	
GUD Holdings Ltd.	(282)	(3 088)	(1 964)	
Harvey Norman Holdings Ltd.	(75)	(367)	(285)	
Hella GmbH & Co KGaA	(29)	(2 542)	(3 189)	
Henry Boot PLC	(100)	(373)	(383)	
Hoosiers Holdings Co., Ltd.	(100)	(818)	(764)	
Isuzu Motors Ltd.	(600)	(10 447)	(9 532)	
Iveco Group NV	(18)	(291)	(145)	
JM AB	(114)	(5 420)	(2 551)	
JTEKT Corp.	(300)	(3 411)	(2 862)	
Just Eat Takeaway.com NV	(18)	(1 540)	(514)	
Kanzhun Ltd.	(638)	(16 362)	(17 609)	
KMD Brands Ltd.	(840)	(955)	(741)	
Kojima Co., Ltd.	(300)	(1 750)	(1 824)	
K's Holdings Corp.	(400)	(5 190)	(4 633)	
KYB Corp.	(100)	(3 337)	(3 497)	
Leifheit AG	(200)	(3 961)	(3 910)	
Maytronics Ltd.	(126)	(3 294)	(1 693)	
Minor International PCL, bons de souscription, éch. le 31 juillet 2023	(45)	-	(19)	
Mitsuba Corp.	(100)	(512)	(485)	
Mitsubishi Motors Corp.	(900)	(3 814)	(4 714)	
Musti Group Oyj	(51)	(1 641)	(1 151)	
Nissan Shatai Co., Ltd.	(400)	(3 267)	(3 389)	
Nokian Renkaat Oyj	(492)	(10 240)	(6 816)	
Open House Group Co., Ltd.	(200)	(11 095)	(9 899)	
Restaurant Group PLC	(1)	(2)	(1)	
Riso Kyoiku Co., Ltd.	(500)	(2 053)	(1 879)	
Sanoh Industrial Co., Ltd.	(100)	(660)	(628)	
Shimajima Co., Ltd.	(100)	(1 257)	(958)	
SKYCITY Entertainment Group Ltd.	(145)	(381)	(294)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Sony Group Corp., CAAE	(11)	(1 198)	(1 137)	
Sumitomo Riko Co., Ltd.	(200)	(1 189)	(1 245)	
Tata Motors Ltd.	(1 027)	(35 044)	(32 159)	
Technogym SpA	(34)	(372)	(352)	
Tokmanni Group Corp.	(175)	(4 258)	(2 857)	
Tokyo Individualized Educational Institute Inc.	(100)	(582)	(542)	
Toyota Boshoku Corp.	(100)	(2 278)	(1 814)	
Toyota Motor Corp.	(200)	(3 932)	(3 723)	
Toyota Motor Corp., CAAE	(17)	(3 356)	(3 146)	
Uxin Ltd.	(255)	(4 472)	(996)	
Verkkokauppa.com Oyj	(100)	(578)	(410)	
Zensho Holdings Co., Ltd.	(400)	(11 787)	(13 596)	
ZOZO Inc.	(100)	(4 098)	(3 348)	
		(258 771)	(225 310)	(1,22)

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -1,52 %)

Acomo NV	(33)	(937)	(908)	
Agrana Beteiligungs AG	(25)	(657)	(540)	
Ajinomoto Co Inc.	(100)	(4 555)	(4 139)	
Anora Group Oyj	(100)	(1 064)	(1 064)	
Atlantic Sapphire ASA	(156)	(2 123)	(159)	
Bakkafrost P/F	(136)	(11 219)	(11 523)	
BrasilAgro - Co Brasileira de Propriedades Agricolas	(609)	(5 045)	(4 695)	
Cia Brasileira de Distribuicao	(63)	(339)	(265)	
Coca-Cola Europacific Partners PLC	(467)	(28 378)	(35 005)	
Cranswick PLC	(92)	(4 301)	(4 615)	
Ebro Foods SA	(42)	(934)	(890)	
ForFarmers NV	(77)	(375)	(326)	
Fuji Oil Holdings Inc.	(100)	(2 476)	(2 093)	
HelloFresh SE	(39)	(1 068)	(1 158)	
Humble Group AB	(611)	(1 500)	(776)	
Italian Wine Brands SpA	(100)	(3 746)	(3 970)	
Japan Tobacco Inc.	(400)	(11 266)	(10 930)	
Kagome Co., Ltd.	(100)	(3 204)	(3 137)	
Kirin Holdings Co., Ltd.	(300)	(6 393)	(6 195)	
Kobe Bussan Co., Ltd.	(400)	(16 894)	(15 568)	
MARR SpA	(65)	(1 141)	(1 072)	
Mowi ASA	(1 064)	(22 008)	(24 469)	
Nissui Corp.	(500)	(3 093)	(2 819)	
Prima Meat Packers Ltd.	(400)	(8 217)	(9 033)	
Rohto Pharmaceutical Co., Ltd.	(200)	(3 695)	(4 765)	
Salmar ASA	(372)	(16 645)	(19 689)	
Schouw & Co A/S	(146)	(15 014)	(14 877)	
Select Harvests Ltd.	(69)	(429)	(247)	
Suominen Oyj	(100)	(376)	(433)	
United Malt Grp Ltd.	(1 259)	(3 812)	(4 014)	
Welcia Holdings Co., Ltd.	(100)	(3 251)	(3 158)	
Woolworths Group Ltd.	(71)	(2 238)	(2 189)	
Zur Rose Group AG	(44)	(9 411)	(1 647)	
		(195 804)	(196 368)	(1,06)

Soins de santé (31 décembre 2021 : -2,03 %)

AddLife AB	(13)	(389)	(184)	
Amplifon SpA	(97)	(3 684)	(3 902)	
Amvis Holdings Inc.	(200)	(5 081)	(6 860)	
Atrys Health SA	(183)	(2 656)	(1 641)	
Basilea Pharmaceutica AG	(12)	(761)	(805)	
BeiGene Ltd.	(1)	(254)	(298)	
Bergbio ASA	(399)	(1 119)	(410)	
Boiron SA	(50)	(3 032)	(3 666)	
Carasent ASA	(148)	(354)	(346)	
Collectis SA	(244)	(743)	(701)	
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	(300)	(10 765)	(10 376)	
Clinuvel Pharmaceuticals Ltd.	(262)	(8 902)	(5 217)	
Coloplast A/S	(137)	(22 673)	(21 632)	
Compugen Ltd.	(285)	(1 205)	(276)	
CompuGroup Medical SE & Co KGaA	(17)	(1 105)	(885)	
CRISPR Therapeutics AG	(32)	(1 949)	(1 763)	
CSL Ltd.	(2)	(494)	(529)	
DiaSorin SpA	(95)	(16 571)	(17 914)	
Eurofins Scientific SE	(9)	(1 215)	(873)	
FINDEX Inc.	(100)	(1 032)	(507)	
Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.	(46)	(935)	(891)	
Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, CAAE	(326)	(6 670)	(7 218)	
GN Store Nord AS	(14)	(414)	(435)	
Grifols SA	(579)	(6 073)	(6 668)	
GSK PLC	(26)	(1 238)	(1 238)	
Healius Ltd.	(268)	(1 189)	(756)	
hVIVO PLC	(1 549)	(357)	(252)	
Imugene Ltd.	(1 003)	(461)	(134)	
Japan Hospice Holdings Inc.	(100)	(2 123)	(2 654)	
JCR Pharmaceuticals Co., Ltd.	(100)	(3 349)	(1 726)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

JMDC Inc.	(200)	(12 945)	(7 763)	
JMS Co., Ltd.	(100)	(999)	(519)	
Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA	(4)	(353)	(209)	
Legend Biotech Corp.	(52)	(3 766)	(3 517)	
Mayne Pharma Group Ltd.	(3 722)	(765)	(684)	
Medacta Group SA	(2)	(358)	(302)	
Molecular Partners AG	(114)	(2 464)	(1 028)	
MorphoSys AG	(93)	(3 011)	(1 777)	
Orion Oyj	(75)	(4 210)	(5 557)	
Perrigo Co PLC	(30)	(1 388)	(1 386)	
Pharma Foods International Co., Ltd.	(200)	(6 554)	(2 715)	
PolyNovo Ltd.	(812)	(2 171)	(1 507)	
QIAGEN NV	(20)	(1 179)	(1 360)	
Raffles Medical Group Ltd.	(1 213)	(1 078)	(1 716)	
Ryman Healthcare Ltd.	(462)	(2 623)	(2 114)	
Scancell Holdings PLC	(1 620)	(381)	(654)	
Sonic Healthcare Ltd.	(13)	(374)	(358)	
Summerset Group Holdings Ltd.	(30)	(332)	(228)	
Theravance Biopharma Inc.	(32)	(349)	(486)	
Tsumura & Co.	(100)	(4 006)	(2 976)	
Vetoquinol SA	(100)	(10 465)	(12 668)	
		(166 564)	(150 281)	(0,81)
Services financiers (31 décembre 2021 : -1,55 %)				
Aegon NV, NYSE	(707)	(2 634)	(4 828)	
Alm Brand A/S	(360)	(705)	(788)	
AMP Ltd.	(9 590)	(10 480)	(11 588)	
Anima Holding SpA	(500)	(3 195)	(2 706)	
Australian Finance Group Ltd.	(2 442)	(3 633)	(3 265)	
Axactor ASA	(291)	(348)	(235)	
Azimut Holding SpA	(13)	(362)	(393)	
Banca Popolare di Sondrio SpA	(219)	(937)	(1 197)	
Banco Macro SA	(501)	(8 144)	(11 146)	
Banco Santander Chile	(1 277)	(28 336)	(27 408)	
Banco Santander SA, CAAE	(3 479)	(13 685)	(13 906)	
Bank Hapoalim BM	(2 359)	(29 059)	(28 734)	
Bank Leumi Le-Israel BM	(47)	(532)	(529)	
Barclays PLC	(35)	(353)	(370)	
Challenger Ltd.	(784)	(4 477)	(5 489)	
Clal Insurance Enterprises Holdings Ltd.	(97)	(2 576)	(2 204)	
Commonwealth Bank of Australia	(243)	(23 938)	(22 909)	
Dai-ichi Life Holdings Inc.	(200)	(6 066)	(6 149)	
Danske Bank A/S	(27)	(655)	(721)	
Eclix Group Ltd.	(431)	(778)	(790)	
Fanhua Inc.	(315)	(3 636)	(3 158)	
Flow Traders	(250)	(10 847)	(7 823)	
Fukuoka Financial Group Inc.	(200)	(5 228)	(6 172)	
GAM Holding AG	(1 744)	(3 830)	(2 401)	
Greenlight Capital Re Ltd.	(56)	(587)	(618)	
Grupo Financiero Galicia SA	(1 515)	(17 047)	(19 973)	
Grupo Financiero Inbursa SAB de CV	(20)	(31)	(46)	
Grupo Supervielle SA	(588)	(1 096)	(1 721)	
Gruppo MutuiOnline SpA	(43)	(1 327)	(1 637)	
Harel Insurance Investments & Financial Services Ltd.	(170)	(2 222)	(2 024)	
HDFC Bank Ltd.	(230)	(19 756)	(21 319)	
Heartland Group Holdings Ltd.	(1 139)	(1 765)	(1 757)	
Hirogin Holdings Inc.	(100)	(672)	(679)	
Hokkoku Financial Holdings Inc.	(100)	(4 321)	(4 662)	
HSBC Holdings PLC	(1 458)	(54 544)	(61 558)	
Illimity Bank SpA	(137)	(2 288)	(1 367)	
Insignia Financial Ltd.	(128)	(404)	(394)	
Itau CorpBanca Chile SA	(164)	(981)	(718)	
Japan Post Bank Co., Ltd.	(100)	(1 008)	(1 158)	
Japan Post Holdings Co., Ltd.	(100)	(1 125)	(1 139)	
Jyske Bank A/S	(135)	(9 225)	(11 847)	
Lifenet Insurance Co.	(400)	(4 598)	(4 831)	
Lloyds Banking Group PLC	(1 161)	(860)	(859)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Lloyds Banking Group PLC, CAAE	(243)	(720)	(724)	
MA Financial Group Ltd.	(1 324)	(5 611)	(5 523)	
Migdal Insurance & Financial Holdings Ltd.	(710)	(1 011)	(1 093)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	(2 500)	(21 258)	(22 823)	
Mizuho Financial Group Inc., CAAE	(537)	(1 804)	(2 066)	
NatWest Group PLC	(46)	(380)	(403)	
Nomura Holdings Inc.	(200)	(942)	(1 004)	
Premium Group Co., Ltd.	(100)	(1 854)	(1 784)	
Protector Forsikring ASA	(31)	(503)	(536)	
Prudential PLC, CAAE	(26)	(921)	(968)	
Resona Holdings Inc.	(400)	(2 955)	(2 971)	
SBI Shinsei Bank Ltd.	(100)	(2 418)	(2 206)	
Shinhan Financial Group Co., Ltd.	(15)	(628)	(568)	
SiriusPoint Ltd.	(647)	(5 763)	(5 172)	
SpareBank 1 SMN	(24)	(496)	(421)	
SpareBank 1 SR-Bank ASA	(590)	(11 670)	(9 795)	
Sparx Group Co., Ltd.	(260)	(3 726)	(4 467)	
Storebrand ASA	(1 886)	(24 865)	(22 154)	
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.	(900)	(41 864)	(48 947)	
Suruga Bank Ltd.	(100)	(461)	(434)	
Tokai Tokyo Financial Holdings Inc.	(200)	(868)	(725)	
Topdanmark AS	(110)	(7 062)	(7 816)	
Zip Co., Ltd.	(271)	(3 051)	(127)	
Zurich Insurance Group AG	(2)	(1 189)	(1 295)	
		(430 311)	(447 238)	(2,42)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -1,52 %)				
Addnode Group AB	(348)	(3 586)	(4 453)	
ADVA Optical Networking SE	(16)	(395)	(510)	
Alpha & Omega Semiconductor Ltd.	(20)	(1 128)	(774)	
Amdocs Ltd.	(67)	(8 093)	(8 252)	
Amper SA	(2 958)	(783)	(638)	
Appen Ltd.	(384)	(3 263)	(879)	
Audinate Group Ltd.	(164)	(1 178)	(1 127)	
AudioCodes Ltd.	(124)	(3 549)	(2 959)	
Barco NV	(11)	(372)	(367)	
Bravura Solutions Ltd.	(124)	(347)	(100)	
CAICA DIGITAL Inc.	(490)	(1 345)	(428)	
Canaan Inc.	(159)	(542)	(444)	
Canon Inc.	(100)	(3 028)	(2 932)	
Canon Inc., CAAE	(290)	(8 869)	(8 519)	
Check Point Software Technologies Ltd.	(5)	(907)	(855)	
Codan Ltd.	(903)	(4 862)	(3 402)	
Cognyte Software Ltd.	(70)	(2 509)	(295)	
Crayon Group Holding ASA	(103)	(2 140)	(1 418)	
Elastic NV	(15)	(1 056)	(1 047)	
Feedforce Group Inc.	(100)	(441)	(401)	
Ferrotec Holdings Corp.	(300)	(9 403)	(8 586)	
Fortnox AB	(217)	(1 488)	(1 334)	
GB Group PLC	(2 918)	(17 641)	(14 972)	
Hansen Technologies Ltd.	(123)	(494)	(581)	
Hilan Ltd.	(7)	(567)	(469)	
Ituran Location and Control Ltd.	(100)	(2 516)	(2 863)	
Japan Cash Machine Co., Ltd.	(200)	(1 309)	(2 204)	
Kapsch TrafficCom AG	(21)	(421)	(343)	
Konica Minolta Inc.	(1 100)	(6 011)	(5 953)	
Logitech International SA	(11)	(757)	(919)	
Matrix IT Ltd.	(221)	(6 462)	(6 249)	
Meyer Burger Technology AG	(21 220)	(10 849)	(16 641)	
Netcompany Group A/S	(219)	(16 779)	(12 529)	
Nexi SpA	(5 412)	(78 584)	(57 648)	
Nice Ltd., CAAE	(25)	(6 573)	(6 514)	
Optim Corp.	(100)	(2 190)	(1 040)	
Pexip Holding ASA	(298)	(1 548)	(525)	
Pricer AB	(473)	(1 291)	(1 006)	
Pushpay Holdings Ltd.	(266)	(348)	(292)	
PVA TePla AG	(10)	(346)	(268)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

SAES Getters SpA	(17)	(507)	(580)	
Samsung Electronics Co., Ltd., CIAE	(17)	(25 320)	(25 453)	
Sapiens International Corp. NV, NASD	(24)	(706)	(601)	
Secunet Security Networks AG	(1)	(821)	(284)	
Seiko Epson Corp.	(100)	(1 997)	(1 978)	
SEMITEC Corp.	(100)	(9 290)	(8 831)	
SimCorp A/S	(300)	(33 964)	(27 897)	
Sinch AB	(1 933)	(29 868)	(9 610)	
Smart Eye AB	(38)	(1 028)	(227)	
SMART Global Holdings Inc.	(16)	(354)	(323)	
Softwareone Holding AG	(98)	(1 618)	(1 882)	
System Information Co., Ltd.	(100)	(876)	(891)	
Tamura Corp.	(200)	(1 362)	(1 464)	
TietoEVRY Oyj	(583)	(21 266)	(22 358)	
Traffic Systems SE	(100)	(6 838)	(3 680)	
Wipro Ltd.	(623)	(3 955)	(3 934)	
Xero Ltd.	(24)	(1 621)	(1 550)	
		(355 361)	(292 279)	(1,58)
Services de communication (31 décembre 2021 : -1,71 %)				
Adevinta ASA	(2 217)	(25 809)	(20 004)	
Arnoldo Mondadori Editore SpA	(709)	(1 512)	(1 854)	
Bambuser AB	(287)	(381)	(138)	
Chorus Ltd.	(1 941)	(11 340)	(13 573)	
Domain Holdings Australia Ltd.	(263)	(1 047)	(655)	
Drecom Co., Ltd.	(100)	(789)	(825)	
FAN Communications Inc.	(400)	(1 609)	(1 672)	
Fuji Media Holdings Inc.	(100)	(1 144)	(1 103)	
Gree Inc.	(200)	(2 154)	(1 429)	
Grupo Televisa SAB	(4 733)	(46 238)	(29 243)	
Gurunavi Inc.	(300)	(1 190)	(1 208)	
I-mobile Co., Ltd.	(200)	(2 419)	(2 393)	
Infrastrutture Wireless Italiane SpA	(579)	(7 323)	(7 882)	
Japan Communications Inc.	(400)	(911)	(900)	
Kadokawa Corp.	(200)	(7 200)	(4 929)	
Kahoot! ASA	(1 811)	(9 284)	(4 841)	
KLab Inc.	(400)	(1 966)	(1 775)	
Members Co., Ltd.	(100)	(2 035)	(2 053)	
MFE-MediaForEurope NV, cat. A	(5 558)	(2 784)	(2 905)	
MFE-MediaForEurope NV, cat. B	(308)	(369)	(250)	
Millicom International Cellular SA	(31)	(469)	(533)	
Mobile TeleSystems PJSC	(911)	(8 419)	-	
MTI Ltd.	(100)	(504)	(528)	
Nippon BS Broadcasting Corp.	(100)	(908)	(929)	
Nippon Television Holdings Inc.	(100)	(1 176)	(1 070)	
NOS SGPS SA	(2 439)	(11 858)	(13 346)	
Orange SA	(1 051)	(14 220)	(14 070)	
ProSiebenSat.1 Media SE	(26)	(392)	(314)	
RAI Way SpA	(1 101)	(7 065)	(8 614)	
Remedy Entertainment Oyj	(27)	(644)	(853)	
RPA Holdings Inc.	(800)	(3 137)	(2 202)	
RTL Group SA	(86)	(3 882)	(4 905)	
Sea Ltd.	(409)	(32 059)	(28 834)	
SEEK Ltd.	(11)	(309)	(212)	
Septeni Holdings Co., Ltd.	(400)	(2 266)	(1 413)	
SKY Network Television Ltd.	(178)	(685)	(351)	
Southern Cross Media Group Ltd.	(1 688)	(1 529)	(1 652)	
Spark New Zealand Ltd.	(917)	(3 699)	(4 243)	
Stillfront Group AB	(592)	(2 343)	(1 349)	
Storytel AB	(301)	(8 373)	(1 731)	
TBS Holdings Inc.	(100)	(1 656)	(1 573)	
Telecom Argentina SA	(581)	(3 655)	(4 290)	
Telenor ASA	(1 856)	(28 241)	(23 384)	
TIM SA	(181)	(2 987)	(2 860)	
Tow Co., Ltd.	(1 000)	(2 939)	(2 978)	
TV Asahi Holdings Corp.	(100)	(1 382)	(1 376)	
Vivendi SE	(14)	(156)	(180)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Vodafone Group PLC	(2 104)	(41 913)	(28 850)	
XLMedia PLC	(755)	(354)	(200)	
Z Holdings Corp.	(600)	(3 864)	(2 046)	
		(318 588)	(254 518)	(1,38)
Services publics (31 décembre 2021 : -0,32 %)				
Ascopiave SpA	(486)	(1 591)	(1 683)	
Audax Renewables SA	(192)	(372)	(208)	
BKW AG	(2)	(320)	(371)	
Central Puerto SA	(1 039)	(4 509)	(8 362)	
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	(82)	(1 191)	(1 184)	
Elmera Group ASA	(125)	(363)	(275)	
Empresa Distribuidora Y Comercializadora Norte	(100)	(957)	(1 083)	
Fortum Oyj	(26)	(509)	(584)	
Genesis Energy Ltd.	(390)	(876)	(862)	
Greenvolt-Energias Renovaveis SA	(41)	(474)	(462)	
Grenergy Renewables SA	(9)	(377)	(361)	
Hera SpA	(494)	(2 394)	(1 799)	
Kyushu Electric Power Co Inc.	(300)	(2 720)	(2 292)	
Meridian Energy Ltd.	(196)	(860)	(880)	
Naturgy Energy Group SA	(23)	(769)	(809)	
Nippon Gas Co., Ltd.	(1 100)	(22 882)	(23 518)	
Orsted AS	(165)	(23 555)	(20 256)	
RWE AG	(4)	(210)	(241)	
Scatec ASA	(407)	(7 792)	(4 400)	
		(72 721)	(69 630)	(0,38)
Immobilier (31 décembre 2021 : -0,34 %)				
Abacus Property Group	(11 392)	(28 614)	(27 530)	
Adgar Investment and Development Ltd.	(145)	(355)	(291)	
AFI Properties Ltd.	(8)	(392)	(319)	
Alony Hetz Properties & Investments Ltd.	(23)	(438)	(316)	
Altisource Portfolio Solutions SA	(29)	(473)	(372)	
Amot Investments Ltd.	(74)	(737)	(587)	
Argosy Property Ltd.	(1 754)	(2 141)	(1 751)	
Assura PLC	(1 346)	(1 179)	(1 197)	
Atenor	(116)	(9 958)	(8 119)	
Atrium Ljungberg AB	(31)	(560)	(689)	
Big Shopping Centers Ltd.	(36)	(7 269)	(4 977)	
BWP Trust	(1 844)	(6 642)	(6 625)	
CA Immobilien Anlagen AG	(7)	(365)	(287)	
CapitaLand China Trust	(317)	(372)	(359)	
CapitaLand Integrated Commercial Trust	(199)	(371)	(410)	
Castellum AB	(17)	(278)	(279)	
CBo Territoria	(282)	(1 463)	(1 472)	
Centuria Industrial REIT	(3 727)	(11 092)	(10 685)	
Charter Hall Group	(2 126)	(23 048)	(23 404)	
Charter Hall Long Wale REIT	(206)	(952)	(839)	
Charter Hall Social Infrastructure REIT	(1 187)	(3 634)	(3 708)	
Cofinimmo SA	(2)	(356)	(242)	
Cresud SACIF y A	(88)	(725)	(798)	
Cromwell Property Group	(687)	(560)	(423)	
Daiwa Securities Living Investments Corp.	(1)	(1 215)	(1 180)	
Dear Life Co., Ltd.	(100)	(629)	(631)	
Deutsche Wohnen SE	(113)	(6 022)	(3 249)	
Dexus	(1 270)	(9 220)	(9 044)	
Dexus Industria REIT	(156)	(362)	(416)	
Empiric Student Property PLC	(2 509)	(3 657)	(3 443)	
Entra ASA	(85)	(1 409)	(1 237)	
ESR-LOGOS REIT	(10 562)	(4 319)	(3 948)	
Frasers Centrepoint Trust	(600)	(1 303)	(1 273)	
Hamborner REIT AG	(125)	(1 413)	(1 217)	
Hufvudstaden AB	(285)	(4 696)	(5 496)	
Ichigo Inc.	(400)	(1 474)	(1 171)	
Immobil SA	(83)	(8 723)	(5 401)	
Ingenia Communities Group	(502)	(2 099)	(2 062)	
IRSA Inversiones y Representaciones SA	(236)	(1 185)	(1 529)	
IRSA Inversiones y Representaciones SA, bons de souscription, éch. le 5 mars 2026	(290)	-	(97)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Kenedix Residential Next Investment Corp.	(1)	(2 155)	(2 111)	
Keppel DC REIT	(500)	(1 134)	(894)	
LEG Immobilien SE	(15)	(1 381)	(1 320)	
Lippo Malls Indonesia Retail Trust	(10 700)	(1 204)	(324)	
Mapletree Pan Asia Commercial Trust	(165)	(284)	(278)	
Melisron Ltd.	(5)	(504)	(483)	
Mirvac Group	(656)	(1 398)	(1 284)	
Mivne Real Estate KD Ltd.	(214)	(1 033)	(920)	
Miyakoshi Holdings Inc.	(100)	(833)	(745)	
Mobimo Holding AG	(5)	(1 610)	(1 728)	
Nextensa SA	(106)	(9 418)	(7 956)	
Nomura Real Estate Holdings Inc.	(1 100)	(35 327)	(31 968)	
OUE Commercial REIT	(1 200)	(415)	(406)	
Precinct Properties New Zealand Ltd.	(672)	(686)	(728)	
Relo Group Inc.	(400)	(8 539)	(8 725)	
Star Asia Investment Corp.	(2)	(1 300)	(1 134)	
Stendorren Fastigheter AB	(15)	(374)	(374)	
Stride Property Group	(203)	(357)	(247)	
Takara Leben Real Estate Investment Corp.	(1)	(1 265)	(1 021)	
VIB Vermoegen AG	(100)	(3 889)	(2 936)	
Wallenstam AB	(89)	(423)	(508)	
YH Dimri Construction & Development Ltd.	(50)	(4 368)	(4 197)	
		<u>(227 597)</u>	<u>(207 360)</u>	(1,11)
Total des actions étrangères – position vendeur		<u>(2 901 951)</u>	<u>(2 721 415)</u>	(14,71)
Commissions de courtage intégrées (note 3)		<u>(5 475)</u>		
Total des placements		<u>16 447 913</u>	<u>17 343 154</u>	93,78
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			22 253	0,12
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			(1 727)	(0,01)
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			320 991	1,73
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			(320 346)	(1,73)
Autres actifs, moins les passifs			<u>1 130 139</u>	6,11
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			<u>18 494 464</u>	100,00

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Contrats de change à terme (Annexe 1)

Au 31 décembre 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	(150 000)	USD	110 789	15 mars 2023	21
Banque Royale du Canada	HKD	(638 000)	USD	82 020	15 mars 2023	218
Banque Royale du Canada	SEK	(554 000)	USD	54 040	15 mars 2023	857
Banque Royale du Canada	USD	(139 472)	EUR	131 000	15 mars 2023	1 427
Banque Royale du Canada	USD	(358 794)	JPY	48 782 000	15 mars 2023	19 730
						22 253
Banque Royale du Canada	CAD	(329 000)	USD	241 873	15 mars 2023	(1 461)
Banque Royale du Canada	USD	(62 868)	GBP	52 000	15 mars 2023	(266)
						(1 727)
						20 526

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

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 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				
Swaps d'actions – position acheteur				
Dollar australien – taux de swap des acceptations bancaires (BBSW) à 1 mois				
752	31 juill. 2023	Agl Energy Ltd, swap sur rendement total	5 576	63
317	31 juill. 2023	Allkem Ltd, swap sur rendement total	3 274	(713)
68	31 juill. 2023	Als Ltd, swap sur rendement total	764	1
148	31 juill. 2023	Ampol Ltd, swap sur rendement total	3 846	(70)
116	31 juill. 2023	Apa Group, swap sur rendement total	1 175	(22)
3 225	31 juill. 2023	Ardent Leisure Group Ltd, swap sur rendement total	1 793	25
70	31 juill. 2023	Aristocrat Leisure Ltd, swap sur rendement total	1 963	(280)
1 079	31 juill. 2023	Atlas Arteria, swap sur rendement total	6 553	(434)
82	31 juill. 2023	Aub Group Ltd, swap sur rendement total	1 698	(42)
109	31 juill. 2023	Aurizon Holdings Ltd, swap sur rendement total	374	(8)
14	31 juill. 2023	Aust And Nz Banking Group, swap sur rendement total	306	(13)
3 367	31 juill. 2023	Base Resources Ltd, swap sur rendement total	696	75
181	31 juill. 2023	Beacon Lighting Group Ltd, swap sur rendement total	354	32
154	31 juill. 2023	Bendigo And Adelaide Bank, swap sur rendement total	1 388	85
595	31 juill. 2023	Boss Energy Ltd, swap sur rendement total	1 165	(174)
70	31 juill. 2023	Brickworks Ltd, swap sur rendement total	1 426	(19)
2 000	31 juill. 2023	Capitol Health Ltd, swap sur rendement total	588	17
689	31 juill. 2023	Capricorn Metals Ltd, swap sur rendement total	2 912	163
1 169	31 juill. 2023	Chalice Mining Ltd, swap sur rendement total	6 767	779
658	31 juill. 2023	Computershare Ltd, swap sur rendement total	15 841	(1 025)
95	31 juill. 2023	Downer Edi Ltd, swap sur rendement total	324	(127)
44	31 juill. 2023	Elders Ltd, swap sur rendement total	410	(6)
2 989	31 juill. 2023	Elixir Energy Ltd, swap sur rendement total	412	(97)
408	31 juill. 2023	Estia Health Ltd, swap sur rendement total	776	(16)
309	31 juill. 2023	Event Hospitality And Entert, swap sur rendement total	3 614	(268)
5 340	31 juill. 2023	Firefinch Ltd, swap sur rendement total	981	(2)
81	31 juill. 2023	Gpt Group, swap sur rendement total	322	(6)
1 874	31 juill. 2023	Grange Resources Ltd, swap sur rendement total	1 455	143
3 098	31 juill. 2023	Horizon Oil Ltd, swap sur rendement total	370	(15)
675	31 juill. 2023	Infomedia Ltd, swap sur rendement total	741	54
113	31 juill. 2023	Invocare Ltd, swap sur rendement total	1 145	(19)
1 621	31 juill. 2023	Ive Group Ltd, swap sur rendement total	3 500	(96)
379	31 juill. 2023	Jumbo Interactive Ltd, swap sur rendement total	4 869	(26)
1 033	31 juill. 2023	Karoon Energy Ltd, swap sur rendement total	2 079	(121)
614	31 juill. 2023	Lendlease Group, swap sur rendement total	4 423	121
12 666	31 juill. 2023	Liontown Resources Ltd, swap sur rendement total	15 363	(7 210)
38	31 juill. 2023	Lynas Corp Ltd, swap sur rendement total	274	(30)
500	31 juill. 2023	Maca Ltd, swap sur rendement total	489	(1)
83	31 juill. 2023	Metcash Ltd, swap sur rendement total	316	(8)
111	31 juill. 2023	Mineral Resources Ltd, swap sur rendement total	7 874	(1 094)
105	31 juill. 2023	Monadelphous Group Ltd, swap sur rendement total	1 289	(32)
1 260	31 juill. 2023	Musgrave Minerals Ltd, swap sur rendement total	243	17
712	31 juill. 2023	Nanosonics Ltd, swap sur rendement total	2 807	(296)
1 428	31 juill. 2023	Nearmap Ltd, swap sur rendement total	2 755	(6)
1 003	31 juill. 2023	Neometals Ltd, swap sur rendement total	737	(187)
150	31 juill. 2023	Neuren Pharmaceuticals Ltd, swap sur rendement total	1 096	(8)
176	31 juill. 2023	New Century Resources Ltd, swap sur rendement total	137	(30)
5 446	31 juill. 2023	New Hope Corp Ltd, swap sur rendement total	31 826	1 953
238	31 juill. 2023	Newerest Mining Ltd, swap sur rendement total	4 514	129
103	31 juill. 2023	Nib Holdings Ltd, swap sur rendement total	733	29
8 904	31 juill. 2023	Nickel Mines Ltd, swap sur rendement total	7 936	(64)
157	31 juill. 2023	Nitro Software Ltd, swap sur rendement total	320	14
400	31 juill. 2023	Opthea Ltd, swap sur rendement total	336	(17)
5 453	31 juill. 2023	Origin Energy Ltd, swap sur rendement total	38 681	(407)
2 607	31 juill. 2023	Panoramic Resources Ltd, swap sur rendement total	419	(1)
686	31 juill. 2023	Peet Ltd, swap sur rendement total	712	(8)
826	31 juill. 2023	Perseus Mining Ltd, swap sur rendement total	1 601	(97)
1 162	31 juill. 2023	Pinnacle Investment Manageme, swap sur rendement total	9 321	36
94	31 juill. 2023	Platinum Asset Management, swap sur rendement total	155	(1)
139	31 juill. 2023	Premier Investments Ltd, swap sur rendement total	3 173	(69)
93	31 juill. 2023	Pro Medicus Ltd, swap sur rendement total	4 722	(364)
103	31 juill. 2023	Pwr Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 019	(85)
3 885	31 juill. 2023	Qantas Airways Ltd, swap sur rendement total	21 454	(879)
1 115	31 juill. 2023	Qbe Insurance Group Ltd, swap sur rendement total	13 759	533

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
179	31 juill. 2023	Regis Healthcare Ltd, swap sur rendement total	310	(12)
1 952	31 juill. 2023	Resolute Mining Ltd, swap sur rendement total	359	66
559	31 juill. 2023	Ridley Corp Ltd, swap sur rendement total	1 017	25
4 184	31 juill. 2023	Sandfire Resources NI, swap sur rendement total	20 914	911
3 895	31 juill. 2023	Santos Ltd, swap sur rendement total	25 554	(985)
6 026	31 juill. 2023	Seven West Media Ltd, swap sur rendement total	2 187	(89)
1 178	31 juill. 2023	Sg Fleet Group Ltd, swap sur rendement total	1 981	65
352	31 juill. 2023	Smartgroup Corp Ltd, swap sur rendement total	1 650	90
2 367	31 juill. 2023	Srg Global Ltd, swap sur rendement total	1 501	(3)
1 026	31 juill. 2023	Steadfast Group Ltd, swap sur rendement total	5 157	124
155	31 juill. 2023	Tabcorp Holdings Ltd, swap sur rendement total	153	2
4 171	31 juill. 2023	Ten Sixty Four Ltd, swap sur rendement total	2 453	320
5 242	31 juill. 2023	Warrego Energy Ltd, swap sur rendement total	1 493	262
110	31 juill. 2023	Webjet Ltd, swap sur rendement total	625	(21)
619	31 juill. 2023	West African Resources Ltd, swap sur rendement total	668	9
401	31 juill. 2023	Westgold Resources Ltd, swap sur rendement total	322	34
19	31 juill. 2023	Westpac Banking Corp, swap sur rendement total	408	(7)
4 613	31 juill. 2023	Whitehaven Coal Ltd, swap sur rendement total	39 929	(2 839)
				(12 272)
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
181	31 juill. 2023	888 Holdings Plc, swap sur rendement total	257	(38)
1 478	31 juill. 2023	Airtel Africa Plc, swap sur rendement total	2 693	(284)
392	31 juill. 2023	Alfa Financial Software Hold, swap sur rendement total	1 061	26
975	31 juill. 2023	Anglo American Plc, swap sur rendement total	51 432	(2 832)
937	31 juill. 2023	Antofagasta Plc, swap sur rendement total	23 603	2 031
338	31 juill. 2023	Ashmore Group Plc, swap sur rendement total	1 319	72
393	31 juill. 2023	Ashtead Group Plc, swap sur rendement total	30 233	(1 227)
1 017	31 juill. 2023	Auto Trader Group Plc, swap sur rendement total	8 546	(822)
57	31 juill. 2023	Aviva Plc, swap sur rendement total	411	(5)
1 621	31 juill. 2023	Babcock Intl Group Plc, swap sur rendement total	7 456	(61)
699	31 juill. 2023	Bakkavor Group Plc, swap sur rendement total	1 095	46
657	31 juill. 2023	Balfour Beatty Plc, swap sur rendement total	3 615	139
231	31 juill. 2023	Bank Of Georgia Group Plc, swap sur rendement total	9 808	260
32	31 juill. 2023	Barratt Developments Plc, swap sur rendement total	207	(5)
327	31 juill. 2023	Bodycote Plc, swap sur rendement total	3 030	(121)
483	31 juill. 2023	Britvic Plc, swap sur rendement total	6 284	(71)
2 254	31 juill. 2023	Brown (N) Group Plc, swap sur rendement total	918	35
373	31 juill. 2023	Burberry Group Plc, swap sur rendement total	12 442	(624)
1 680	31 juill. 2023	Cairn Energy Plc, swap sur rendement total	7 169	321
4 447	31 juill. 2023	Card Factory Plc, swap sur rendement total	5 668	234
587	31 juill. 2023	Centamin Plc, swap sur rendement total	1 080	55
256	31 juill. 2023	Ceres Power Holdings Plc, swap sur rendement total	1 463	(144)
441	31 juill. 2023	Cls Holdings Plc, swap sur rendement total	1 141	(12)
121	31 juill. 2023	Cmc Markets Plc, swap sur rendement total	449	(9)
2 046	31 juill. 2023	Compass Group Plc, swap sur rendement total	63 943	1 343
85	31 juill. 2023	Cvs Group Plc, swap sur rendement total	2 682	(126)
116	31 juill. 2023	Diploma Plc, swap sur rendement total	5 248	(60)
170	31 juill. 2023	Discoverie Group Plc, swap sur rendement total	2 035	(268)
2 367	31 juill. 2023	Drax Group Plc, swap sur rendement total	27 121	3 626
325	31 juill. 2023	Eckoh Plc, swap sur rendement total	217	(3)
2 344	31 juill. 2023	Enquest Plc, swap sur rendement total	818	(113)
1 114	31 juill. 2023	Entain Plc, swap sur rendement total	23 994	(1 467)
248	31 juill. 2023	Equals Group Plc, swap sur rendement total	362	(7)
211	31 juill. 2023	Ferguson Plc, swap sur rendement total	35 906	3 585
654	31 juill. 2023	Finsbury Food Group Plc, swap sur rendement total	981	43
556	31 juill. 2023	Firstgroup Plc, swap sur rendement total	915	(12)
53	31 juill. 2023	Frontier Developments Plc, swap sur rendement total	830	(159)
437	31 juill. 2023	Galliford Try Plc, swap sur rendement total	1 132	9
8	31 juill. 2023	Games Workshop Group Plc, swap sur rendement total	1 117	63
11	31 juill. 2023	Gamma Communications Plc, swap sur rendement total	194	(2)
194	31 juill. 2023	Greggs Plc, swap sur rendement total	7 418	56
1 954	31 juill. 2023	Gulf Keystone Petroleum Ltd, swap sur rendement total	6 401	(367)
532	31 juill. 2023	H&T Group Plc, swap sur rendement total	4 162	(236)
267	31 juill. 2023	Halma Plc, swap sur rendement total	8 625	(830)
28 185	31 juill. 2023	Hammerson Plc, swap sur rendement total	10 933	(154)
5 913	31 juill. 2023	Harbour Energy Plc, swap sur rendement total	29 336	(1 409)
706	31 juill. 2023	Hargreaves Lansdown Plc, swap sur rendement total	9 852	120
1 204	31 juill. 2023	Hiscox Ltd, swap sur rendement total	21 380	1 670
339	31 juill. 2023	Hostelworld Group Plc, swap sur rendement total	637	67
82	31 juill. 2023	Hunting Plc, swap sur rendement total	445	75

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
197	31 juill. 2023	Impact Healthcare Reit Plc, swap sur rendement total	337	6
802	31 juill. 2023	Inchcape Plc, swap sur rendement total	10 719	(158)
568	31 juill. 2023	Indivior Plc, swap sur rendement total	17 145	1 216
3 363	31 juill. 2023	Informa Plc, swap sur rendement total	33 962	219
59	31 juill. 2023	Integrafin Holdings Plc, swap sur rendement total	297	15
444	31 juill. 2023	Intercontinental Hotels Grou, swap sur rendement total	34 331	(483)
317	31 juill. 2023	International Personal Finan, swap sur rendement total	378	(26)
45	31 juill. 2023	Investec Plc, swap sur rendement total	385	8
88	31 juill. 2023	Johnson Matthey Plc, swap sur rendement total	3 082	79
208	31 juill. 2023	Kainos Group Plc, swap sur rendement total	5 231	(195)
38	31 juill. 2023	Keller Group Plc, swap sur rendement total	495	40
48	31 juill. 2023	Keywords Studios Plc, swap sur rendement total	2 131	(183)
172	31 juill. 2023	Kin And Carta Plc, swap sur rendement total	600	(64)
211	31 juill. 2023	Lancashire Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 235	185
9	31 juill. 2023	Liontrust Asset Management, swap sur rendement total	168	4
9	31 juill. 2023	London Stock Exchange Group, swap sur rendement total	1 047	(189)
100	31 juill. 2023	Lsl Property Services Plc, swap sur rendement total	407	21
26	31 juill. 2023	Marlowe Plc, swap sur rendement total	199	9
483	31 juill. 2023	Marston'S Plc, swap sur rendement total	312	16
436	31 juill. 2023	Me Group International Plc, swap sur rendement total	817	66
4 203	31 juill. 2023	Mitchells & Butlers Plc, swap sur rendement total	9 453	(85)
1 190	31 juill. 2023	Mitie Group Plc, swap sur rendement total	1 460	(18)
100	31 juill. 2023	Morgan Advanced Materials Pl, swap sur rendement total	513	19
179	31 juill. 2023	Morgan Sindall Group Plc, swap sur rendement total	4 464	(258)
33	31 juill. 2023	National Grid Plc, swap sur rendement total	546	7
141	31 juill. 2023	Ncc Group Plc, swap sur rendement total	460	(29)
838	31 juill. 2023	Newriver Reit Plc, swap sur rendement total	1 113	23
340	31 juill. 2023	Oxford Metrics Plc, swap sur rendement total	610	106
4 731	31 juill. 2023	Pan African Resources Plc, swap sur rendement total	1 275	(93)
813	31 juill. 2023	Pearson Plc, swap sur rendement total	12 445	(737)
207	31 juill. 2023	Petrofac Ltd, swap sur rendement total	237	(5)
1 534	31 juill. 2023	Playtech Plc, swap sur rendement total	12 726	(1 066)
23	31 juill. 2023	Polar Capital Holdings Plc, swap sur rendement total	184	1
623	31 juill. 2023	Primary Health Properties, swap sur rendement total	1 125	(9)
223	31 juill. 2023	Provident Financial Plc, swap sur rendement total	695	(24)
2 306	31 juill. 2023	Rank Group Plc, swap sur rendement total	3 078	(333)
58	31 juill. 2023	Reach Plc, swap sur rendement total	90	(14)
39	31 juill. 2023	Redrow Plc, swap sur rendement total	288	(4)
117	31 juill. 2023	Renishaw Plc, swap sur rendement total	6 995	(57)
39	31 juill. 2023	Rightmove Plc, swap sur rendement total	325	(30)
8 033	31 juill. 2023	Rolls-Royce Holdings Plc, swap sur rendement total	12 202	339
61	31 juill. 2023	Rotork Plc, swap sur rendement total	305	7
858	31 juill. 2023	Royal Mail Plc, swap sur rendement total	2 979	(196)
426	31 juill. 2023	Sanderson Design Group Plc, swap sur rendement total	802	(72)
37	31 juill. 2023	Savills Plc, swap sur rendement total	498	(75)
906	31 juill. 2023	Schroders Plc, swap sur rendement total	6 438	(114)
855	31 juill. 2023	Senior Plc, swap sur rendement total	1 745	29
4 883	31 juill. 2023	Serco Group Plc, swap sur rendement total	12 368	(1 246)
254	31 juill. 2023	Sig Plc, swap sur rendement total	123	-
410	31 juill. 2023	Sirius Real Estate Ltd, swap sur rendement total	495	(49)
161	31 juill. 2023	Somero Enterprises Inc- actions ord., swap sur rendement total	984	(2)
317	31 juill. 2023	Speedy Hire Plc, swap sur rendement total	210	6
59	31 juill. 2023	Spire Healthcare Group Plc, swap sur rendement total	219	(2)
380	31 juill. 2023	Sse Plc, swap sur rendement total	10 603	(4)
2 452	31 juill. 2023	Ssp Group Plc, swap sur rendement total	9 152	583
181	31 juill. 2023	Sthree Plc, swap sur rendement total	1 189	(10)
131	31 juill. 2023	Taylor Wimpey Plc, swap sur rendement total	217	(1)
2 389	31 juill. 2023	Tesco Plc, swap sur rendement total	8 730	(119)
359	31 juill. 2023	Tt Electronics Plc, swap sur rendement total	1 018	39
10 640	31 juill. 2023	Tullow Oil Plc, swap sur rendement total	6 403	(1 213)
464	31 juill. 2023	Tyman Plc, swap sur rendement total	1 705	18
32	31 juill. 2023	Unite Group Plc/The, swap sur rendement total	475	(9)
521	31 juill. 2023	United Utilities Group Plc, swap sur rendement total	8 547	(221)
123	31 juill. 2023	Virgin Money Uk Plc, swap sur rendement total	365	16
43	31 juill. 2023	Vistry Group Plc, swap sur rendement total	438	7
63	31 juill. 2023	Volex Plc, swap sur rendement total	257	(13)
434	31 juill. 2023	Volution Group Plc, swap sur rendement total	2 582	128
371	31 juill. 2023	Watches Of Switzerland Group, swap sur rendement total	4 961	(1 246)
426	31 juill. 2023	Weir Group Plc/The, swap sur rendement total	11 588	(668)
450	31 juill. 2023	Wetherspoon (J.D.) Plc, swap sur rendement total	3 258	(2)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
46	31 juill. 2023	Wh Smith Plc, swap sur rendement total	1 113	50
48	31 juill. 2023	Wincanton Plc, swap sur rendement total	264	(28)
11	31 juill. 2023	Wizz Air Holdings Plc, swap sur rendement total	341	(74)
217	31 juill. 2023	Xp Power Ltd, swap sur rendement total	7 272	342
				<u>(3 412)</u>
Euro – taux à court terme (€STR)				
325	31 juill. 2023	Aalberts Nv, swap sur rendement total	17 027	(666)
86	31 juill. 2023	Abn Amro Bank Nv-Cva, swap sur rendement total	1 607	(14)
3	31 juill. 2023	Adesso Se, swap sur rendement total	572	(17)
72	31 juill. 2023	Adidas Ag, swap sur rendement total	13 271	653
17	31 juill. 2023	Adyen Nv, swap sur rendement total	31 673	(4 461)
7	31 juill. 2023	Ageas, swap sur rendement total	419	1
541	31 juill. 2023	Aib Group Plc, swap sur rendement total	2 829	371
218	31 juill. 2023	Air Liquide Sa, swap sur rendement total	41 738	(1 895)
301	31 juill. 2023	Airbus Se, swap sur rendement total	48 323	346
92	31 juill. 2023	Akwel, swap sur rendement total	2 315	120
17	31 juill. 2023	Allianz Se, actions ord., swap sur rendement total	4 939	(83)
130	31 juill. 2023	Alma Media Corp, swap sur rendement total	1 767	(96)
1 267	31 juill. 2023	Alstom, swap sur rendement total	41 810	(3 269)
14	31 juill. 2023	Amg Advanced Metallurgical, swap sur rendement total	696	(59)
64	31 juill. 2023	Andritz Ag, swap sur rendement total	4 956	141
28	31 juill. 2023	Argan, swap sur rendement total	3 069	(57)
19	31 juill. 2023	Argenx Se, swap sur rendement total	9 570	(1 100)
51	31 juill. 2023	Ascencio, swap sur rendement total	3 872	32
200	31 juill. 2023	Aspo Oyj, swap sur rendement total	2 372	66
64	31 juill. 2023	Austria Technologie & System, swap sur rendement total	2 962	(245)
914	31 juill. 2023	Axa Sa, swap sur rendement total	34 437	(1 266)
3 565	31 juill. 2023	Banco Comercial Portugues-R, swap sur rendement total	755	8
18 168	31 juill. 2023	Banco De Sabadell Sa, swap sur rendement total	23 141	(252)
3 190	31 juill. 2023	Bankinter Sa, swap sur rendement total	28 914	(143)
7	31 juill. 2023	Basic-Fit Nv, swap sur rendement total	248	9
97	31 juill. 2023	Bawag Group Ag, swap sur rendement total	6 985	96
105	31 juill. 2023	Befesa Sa, swap sur rendement total	6 842	677
3	31 juill. 2023	Beiersdorf Ag, swap sur rendement total	465	9
105	31 juill. 2023	Bertrandt Ag, swap sur rendement total	6 066	761
28	31 juill. 2023	Bijou Brigitte Modi Access, swap sur rendement total	1 725	183
6	31 juill. 2023	Bnp Paribas, swap sur rendement total	462	(24)
26	31 juill. 2023	Brenntag Ag, swap sur rendement total	2 245	61
36	31 juill. 2023	Bureau Veritas Sa, swap sur rendement total	1 281	(22)
5 479	31 juill. 2023	Caixabank Sa, swap sur rendement total	29 093	1 166
7	31 juill. 2023	Cancom Se, swap sur rendement total	277	(13)
4	31 juill. 2023	Capgemini Se, swap sur rendement total	902	(9)
17	31 juill. 2023	Cargotec Oyj, actions, B, swap sur rendement total	1 016	43
40	31 juill. 2023	Carl Zeiss Meditec Ag, Br, swap sur rendement total	6 820	(657)
207	31 juill. 2023	Ceconomy Ag, swap sur rendement total	556	(111)
13	31 juill. 2023	Cia De Distribucion Integral, swap sur rendement total	444	18
146	31 juill. 2023	Cie Automotive Sa, swap sur rendement total	5 080	(57)
32	31 juill. 2023	Citycon Oyj, swap sur rendement total	289	(10)
176	31 juill. 2023	Coface Sa, swap sur rendement total	3 090	105
147	31 juill. 2023	Commerzbank Ag, swap sur rendement total	1 878	169
238	31 juill. 2023	Compagnie De Saint Gobain, swap sur rendement total	15 711	534
618	31 juill. 2023	Continental Ag, swap sur rendement total	50 028	(1 221)
3	31 juill. 2023	Covivio, swap sur rendement total	241	-
53	31 juill. 2023	Dassault Aviation Sa, swap sur rendement total	12 125	522
376	31 juill. 2023	Delivery Hero Se, swap sur rendement total	24 348	1 856
6	31 juill. 2023	Dermapharm Holding Se, swap sur rendement total	326	(36)
1 301	31 juill. 2023	Deutsche Bank Ag, actions nominatives, swap sur rendement total	19 920	869
18	31 juill. 2023	Deutsche Boerse Ag, swap sur rendement total	4 201	(148)
1 932	31 juill. 2023	Deutsche Lufthansa- actions ord., swap sur rendement total	21 694	275
272	31 juill. 2023	Deutsche Post Ag, actions ord., swap sur rendement total	13 837	(719)
110	31 juill. 2023	D'Ieteren Sa/Nv, swap sur rendement total	28 505	(274)
311	31 juill. 2023	Duerr Ag, swap sur rendement total	14 175	(343)
24	31 juill. 2023	Eckert & Ziegler Strahlen Un, swap sur rendement total	1 610	(232)
574	31 juill. 2023	Edp Renovaveis Sa, swap sur rendement total	17 082	(1 240)
328	31 juill. 2023	Edreams Odigeo Sl, swap sur rendement total	1 874	(113)
219	31 juill. 2023	Elior Group, swap sur rendement total	1 045	125
11	31 juill. 2023	Elmos Semiconductor Ag, swap sur rendement total	853	(98)
146	31 juill. 2023	Enagas Sa, swap sur rendement total	3 278	(364)
372	31 juill. 2023	Ence Energia Y Celulosa Sa, swap sur rendement total	1 512	(174)
216	31 juill. 2023	Ercros Sa, swap sur rendement total	1 012	(32)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
152	31 juill. 2023	Erste Group Bank Ag, swap sur rendement total	6 572	130
28	31 juill. 2023	Esker Sa, swap sur rendement total	6 369	251
89	31 juill. 2023	Evn Ag, swap sur rendement total	2 175	(104)
174	31 juill. 2023	Evonik Industries Ag, swap sur rendement total	4 513	(116)
353	31 juill. 2023	Evotec Se, swap sur rendement total	7 790	(855)
25	31 juill. 2023	Evs Broadcast Equipment S.A., swap sur rendement total	804	44
146	31 juill. 2023	Exmar Nv, swap sur rendement total	1 672	(209)
720	31 juill. 2023	Faurecia, swap sur rendement total	14 712	(1 716)
960	31 juill. 2023	Ferrovial Sa, swap sur rendement total	33 970	(1 610)
423	31 juill. 2023	Flatex Ag, swap sur rendement total	3 870	(2 317)
100	31 juill. 2023	Fnac Darty Sa, swap sur rendement total	4 980	(178)
21	31 juill. 2023	Fraport Ag Frankfurt Airport, swap sur rendement total	1 155	(104)
8	31 juill. 2023	Fresenius Se & Co Kga, swap sur rendement total	304	(4)
416	31 juill. 2023	F-Secure Corp, swap sur rendement total	1 702	(128)
583	31 juill. 2023	Fugro Nv-Cva, swap sur rendement total	9 442	(3 260)
22	31 juill. 2023	Gea Group Ag, swap sur rendement total	1 215	5
11	31 juill. 2023	Gesco Ag, swap sur rendement total	383	(23)
272	31 juill. 2023	Getlink Se, swap sur rendement total	5 890	(355)
36	31 juill. 2023	Glanbia Plc, swap sur rendement total	621	16
11	31 juill. 2023	Grand City Properties, swap sur rendement total	146	(5)
100	31 juill. 2023	Groupe Guillin, swap sur rendement total	3 145	400
180	31 juill. 2023	Heidelbergcement Ag, swap sur rendement total	13 868	282
3 067	31 juill. 2023	Heidelberger Druckmaschinen, swap sur rendement total	6 546	(798)
23	31 juill. 2023	Hermès International, swap sur rendement total	48 060	(3 329)
27	31 juill. 2023	Hochtief Ag, swap sur rendement total	2 057	(98)
6	31 juill. 2023	Hornbach Holding Ag & Co Kga, swap sur rendement total	670	13
59	31 juill. 2023	Hugo Boss Ag, actions ord., swap sur rendement total	4 621	63
113	31 juill. 2023	Indra Sistemas Sa, swap sur rendement total	1 740	132
264	31 juill. 2023	Industria De Diseno Textil, swap sur rendement total	9 487	(15)
831	31 juill. 2023	Infineon Technologies Ag, swap sur rendement total	34 164	(3 685)
11	31 juill. 2023	Ipsen, swap sur rendement total	1 599	(62)
191	31 juill. 2023	Irish Continental Group Plc, swap sur rendement total	1 182	20
100	31 juill. 2023	Jacquet Metal Service Sa, swap sur rendement total	2 418	81
708	31 juill. 2023	Jeronimo Martins, swap sur rendement total	20 661	(1 064)
4	31 juill. 2023	Jost Werke Ag, swap sur rendement total	304	(3)
12	31 juill. 2023	Kbc Ancora, swap sur rendement total	731	10
270	31 juill. 2023	Kbc Group Nv, swap sur rendement total	23 458	2 729
37	31 juill. 2023	Kering, swap sur rendement total	25 441	(2 078)
31	31 juill. 2023	Kesko Oyj-actions, B, swap sur rendement total	924	3
100	31 juill. 2023	Kloekner & Co Se, swap sur rendement total	1 335	34
7	31 juill. 2023	Kone Oyj-B, swap sur rendement total	489	5
23	31 juill. 2023	Konecranes Oyj, swap sur rendement total	957	22
1 421	31 juill. 2023	Koninklijke Ahold Delhaize N, swap sur rendement total	55 153	(2 058)
1 089	31 juill. 2023	Koninklijke Bam Groep Nv, swap sur rendement total	3 417	(93)
2	31 juill. 2023	Koninklijke Dsm Nv, swap sur rendement total	331	(23)
1 694	31 juill. 2023	Koninklijke Philips Nv, swap sur rendement total	34 305	(251)
25	31 juill. 2023	Ksb Se & Co Kga-Vorzug, swap sur rendement total	12 111	(594)
240	31 juill. 2023	Lar Espana Real Estate Socim, swap sur rendement total	1 466	(136)
100	31 juill. 2023	Leoni Ag, swap sur rendement total	796	(114)
123	31 juill. 2023	Linea Directa Aseguradora Sa, swap sur rendement total	184	5
1 431	31 juill. 2023	Mapfre Sa, swap sur rendement total	3 745	(21)
615	31 juill. 2023	Maurel Et Prom, swap sur rendement total	3 571	(102)
718	31 juill. 2023	Melia Hotels International, swap sur rendement total	4 753	(650)
100	31 juill. 2023	Mensch Und Maschine Software, swap sur rendement total	6 594	107
1 026	31 juill. 2023	Metso Outotec Oyj, swap sur rendement total	14 261	968
425	31 juill. 2023	Mip Se, swap sur rendement total	3 159	(100)
2	31 juill. 2023	Muenchener Rueckver Ag, actions ord., swap sur rendement total	879	17
239	31 juill. 2023	Nemetschek Se, swap sur rendement total	16 482	345
11	31 juill. 2023	Neopost Sa, swap sur rendement total	219	(33)
31	31 juill. 2023	Nexans Sa, swap sur rendement total	3 786	10
100	31 juill. 2023	Nh Hotel Group Sa, swap sur rendement total	429	(11)
572	31 juill. 2023	Nokia Oyj, swap sur rendement total	3 579	(257)
509	31 juill. 2023	Nordex Se, swap sur rendement total	9 716	858
859	31 juill. 2023	Obrascon Huarte Lain S.A., swap sur rendement total	557	(18)
196	31 juill. 2023	Ontex Group Nv, swap sur rendement total	1 769	(41)
121	31 juill. 2023	Ordina Nv, swap sur rendement total	678	(17)
518	31 juill. 2023	Origin Enterprises Plc, swap sur rendement total	3 228	288
2 704	31 juill. 2023	Outokumpu Oyj, swap sur rendement total	18 499	(223)
1	31 juill. 2023	Pfeiffer Vacuum Technology, swap sur rendement total	248	(4)
1 613	31 juill. 2023	Pharming Group Nv, swap sur rendement total	2 528	(330)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
140	31 juill. 2023	Porsche Automobil Hldg, actions priv., swap sur rendement total	10 374	(1 440)
1 265	31 juill. 2023	Postnl Nv, swap sur rendement total	3 111	(127)
100	31 juill. 2023	Prodways Group Sa, swap sur rendement total	479	(60)
451	31 juill. 2023	Prosus Nv, swap sur rendement total	42 033	1 230
16	31 juill. 2023	Proximus, swap sur rendement total	208	(18)
8	31 juill. 2023	Puma Se, swap sur rendement total	656	10
1 134	31 juill. 2023	Raiffeisen Bank Internationa, swap sur rendement total	25 172	494
691	31 juill. 2023	Red Electrica Corporacion Sa, swap sur rendement total	16 248	(553)
19	31 juill. 2023	Rheinmetall Ag, swap sur rendement total	5 112	(388)
45	31 juill. 2023	Rovio Entertainment Oy, swap sur rendement total	395	13
341	31 juill. 2023	Rubis, swap sur rendement total	12 131	180
9	31 juill. 2023	Salzgitter Ag, swap sur rendement total	371	10
46	31 juill. 2023	Sanoma Oyj, swap sur rendement total	653	(97)
133	31 juill. 2023	Sap Se, swap sur rendement total	18 538	(1 223)
10	31 juill. 2023	Schneider Electric Se, swap sur rendement total	1 890	(43)
251	31 juill. 2023	Scor Se, swap sur rendement total	7 800	1 155
100	31 juill. 2023	Sgl Carbon Se, swap sur rendement total	1 002	(79)
31	31 juill. 2023	Siemens Energy Ag	788	62
64	31 juill. 2023	Siltronic Ag, swap sur rendement total	6 307	(752)
296	31 juill. 2023	Sma Solar Technology Ag, swap sur rendement total	28 614	1 595
401	31 juill. 2023	Smcp Sa, swap sur rendement total	3 763	(170)
386	31 juill. 2023	Sonae, swap sur rendement total	522	(16)
2	31 juill. 2023	Sopra Steria Group, swap sur rendement total	408	(9)
658	31 juill. 2023	Stmicroelectronics Nv, swap sur rendement total	31 395	(2 978)
2	31 juill. 2023	Sto Se & Co. Kga-a-actions priv., swap sur rendement total	435	(17)
43	31 juill. 2023	Suess Microtec Se, swap sur rendement total	941	-
112	31 juill. 2023	Teamviewer Ag, swap sur rendement total	1 951	(43)
6	31 juill. 2023	Teleperformance, swap sur rendement total	1 932	18
7	31 juill. 2023	Tessenderlo Group, swap sur rendement total	338	13
150	31 juill. 2023	Thyssenkrupp Ag, swap sur rendement total	1 236	(13)
5	31 juill. 2023	Tkh Group Nv, cert. d'actions néerlandaises, swap sur rendement total	269	(2)
538	31 juill. 2023	Tomtom, swap sur rendement total	5 045	(907)
391	31 juill. 2023	Tubacex Sa, swap sur rendement total	1 130	(16)
280	31 juill. 2023	Ubisoft Entertainment, swap sur rendement total	10 693	(135)
131	31 juill. 2023	Umicore, swap sur rendement total	6 501	23
929	31 juill. 2023	Unicaja Banco Sa, swap sur rendement total	1 385	51
1 205	31 juill. 2023	Valeo Sa, swap sur rendement total	29 100	(1 870)
461	31 juill. 2023	Vallourec Sa, swap sur rendement total	8 180	770
431	31 juill. 2023	Valneva Se, swap sur rendement total	3 879	(31)
727	31 juill. 2023	Veolia Environnement, swap sur rendement total	25 231	(689)
52	31 juill. 2023	Vgp, swap sur rendement total	5 850	74
49	31 juill. 2023	Vinci Sa, swap sur rendement total	6 610	(234)
100	31 juill. 2023	Vitesco Technologies Group, A, swap sur rendement total	7 845	362
34	31 juill. 2023	Wacker Neuson Se, swap sur rendement total	803	(31)
2 546	31 juill. 2023	Wartsila Oyj Abp, swap sur rendement total	28 968	(1 399)
167	31 juill. 2023	Wienerberger Ag, swap sur rendement total	5 448	(616)
125	31 juill. 2023	Zumtobel Group Ag, swap sur rendement total	1 231	73
				<u>(38 481)</u>
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
12 000	31 juill. 2023	Agile Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	4 812	(544)
400	31 juill. 2023	Aia Group Ltd, swap sur rendement total	6 027	323
2 000	31 juill. 2023	Aluminum Corp Of China Ltd-H, swap sur rendement total	1 153	13
600	31 juill. 2023	Anta Sports Products Ltd, swap sur rendement total	10 656	1 153
22 506	31 juill. 2023	Baic Motor Corp Ltd-H, swap sur rendement total	8 088	(265)
1 000	31 juill. 2023	Byd Co Ltd-H, swap sur rendement total	33 436	(38)
2 000	31 juill. 2023	Cabbeen Fashion Ltd, swap sur rendement total	354	(64)
5 000	31 juill. 2023	Chaowei Power Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 467	18
17	31 juill. 2023	China Aerospace Intl Hldg, swap sur rendement total	1	-
8 000	31 juill. 2023	China Bluechemical Ltd - H, swap sur rendement total	2 569	60
745	31 juill. 2023	China Datang Corp Renewabl-H, swap sur rendement total	299	9
19 000	31 juill. 2023	China Dongxiang Group Co, swap sur rendement total	1 023	(37)
4 000	31 juill. 2023	China Electronics Huada Tech, swap sur rendement total	951	430
2 000	31 juill. 2023	China Evergrande New Energy, swap sur rendement total	1 111	(4)
6 000	31 juill. 2023	China Foods Ltd, swap sur rendement total	2 916	142
5 000	31 juill. 2023	China Hongqiao Group Ltd, swap sur rendement total	6 397	101
500	31 juill. 2023	China Overseas Land & Invest, swap sur rendement total	1 788	(50)
1 800	31 juill. 2023	China Pacific Insurance Gr-H, swap sur rendement total	5 431	(147)
1 000	31 juill. 2023	China Pioneer Pharma Holding, swap sur rendement total	387	49
8 000	31 juill. 2023	China Shineway Pharmaceutica, swap sur rendement total	10 541	690
400	31 juill. 2023	China Taiping Insurance Hold, swap sur rendement total	675	123

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
4 300	31 juill. 2023	China Vanke Co Ltd-H, swap sur rendement total	11 794	(254)
2 000	31 juill. 2023	China Water Affairs Group, swap sur rendement total	2 239	32
18 500	31 juill. 2023	China Yongda Automobiles Ser, swap sur rendement total	18 627	3 027
9 500	31 juill. 2023	China Zhengtong Auto Service, swap sur rendement total	1 171	352
2 000	31 juill. 2023	Chinasoft International Ltd, swap sur rendement total	2 358	40
17 000	31 juill. 2023	Citic Dameng Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 889	(66)
14 000	31 juill. 2023	Citic Resources Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 009	(15)
1 000	31 juill. 2023	Ck Asset Holdings Ltd, swap sur rendement total	8 342	234
1 000	31 juill. 2023	Clp Holdings Ltd, swap sur rendement total	9 887	27
5 000	31 juill. 2023	Cogobuy Group, swap sur rendement total	1 545	168
30 000	31 juill. 2023	Concord New Energy Group Ltd, swap sur rendement total	3 594	(12)
3 000	31 juill. 2023	Consun Pharmaceutical Group, swap sur rendement total	2 109	314
11 000	31 juill. 2023	Country Garden Holdings Co, swap sur rendement total	5 099	(620)
2 500	31 juill. 2023	Crystal International Group, swap sur rendement total	1 055	79
1 000	31 juill. 2023	Csc Financial Co Ltd-H, swap sur rendement total	1 186	(13)
2 800	31 juill. 2023	Dah Sing Banking Group Ltd, swap sur rendement total	2 722	74
400	31 juill. 2023	Dah Sing Financial Holdings, swap sur rendement total	1 255	45
800	31 juill. 2023	Dfzq-H, swap sur rendement total	519	-
4 000	31 juill. 2023	Dongfeng Motor Grp Co Ltd-H, swap sur rendement total	3 111	63
13 000	31 juill. 2023	Dongyue Group, swap sur rendement total	19 386	(74)
800	31 juill. 2023	Dynam Japan Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 169	453
6	31 juill. 2023	Fse Services Group Ltd, swap sur rendement total	6	1
14 000	31 juill. 2023	Fufeng Group Ltd, swap sur rendement total	11 544	(525)
25 000	31 juill. 2023	Geely Automobile Holdings Lt, swap sur rendement total	49 476	(411)
2 000	31 juill. 2023	Genscript Biotech Corp, swap sur rendement total	8 628	1 741
4 500	31 juill. 2023	Grand Baoxin Auto Group Ltd, swap sur rendement total	348	10
10 000	31 juill. 2023	Haichang Ocean Park Holdings, swap sur rendement total	2 778	(2 850)
1 100	31 juill. 2023	Haitong International Securi, swap sur rendement total	166	20
2 000	31 juill. 2023	Harbin Electric Co Ltd-H, swap sur rendement total	1 087	(56)
15 000	31 juill. 2023	Hi Sun Technology China Ltd, swap sur rendement total	2 213	149
516	31 juill. 2023	Hisense Home Appliances Gr-H, swap sur rendement total	771	48
300	31 juill. 2023	Hong Kong Exchanges & Clear, swap sur rendement total	17 561	1 569
1 000	31 juill. 2023	Huabao International Holding, swap sur rendement total	700	(13)
6	31 juill. 2023	Inke Ltd, swap sur rendement total	1	-
1 500	31 juill. 2023	Innovent Biologics Inc, swap sur rendement total	8 723	930
500	31 juill. 2023	Jnby Design Ltd, swap sur rendement total	810	102
2 500	31 juill. 2023	Kingboard Holdings Ltd, swap sur rendement total	10 915	(235)
30 000	31 juill. 2023	Kunlun Energy Co Ltd, swap sur rendement total	29 009	(2 350)
12 000	31 juill. 2023	Lenovo Group Ltd, swap sur rendement total	13 353	(403)
5 000	31 juill. 2023	Li Ning Co Ltd, swap sur rendement total	58 807	5 448
400	31 juill. 2023	Link Reit, swap sur rendement total	3 979	318
22 000	31 juill. 2023	Logan Property Holdings Co L, swap sur rendement total	4 774	1 207
600	31 juill. 2023	Microport Scientific Corp, swap sur rendement total	2 141	228
11 000	31 juill. 2023	Modern Dental Group Ltd, swap sur rendement total	4 602	1 012
200	31 juill. 2023	New China Life Insurance C-H, swap sur rendement total	663	30
5 000	31 juill. 2023	Nexteer Automotive Group Ltd, swap sur rendement total	4 436	(14)
1 000	31 juill. 2023	Pax Global Technology Ltd, swap sur rendement total	1 172	13
5 000	31 juill. 2023	Perfect Shape Medical Ltd, swap sur rendement total	3 559	326
3 000	31 juill. 2023	Ping An Insurance Group Co-H, swap sur rendement total	26 899	1 939
7 000	31 juill. 2023	Powerlong Real Estate Holdin, swap sur rendement total	1 908	337
4 000	31 juill. 2023	Shanghai Fosun Pharmaceuti-H, swap sur rendement total	17 360	(618)
200	31 juill. 2023	Shenzhou International Group, swap sur rendement total	3 048	619
6 500	31 juill. 2023	Shimao Property Holdings Ltd, swap sur rendement total	4 988	3 988
5 200	31 juill. 2023	Sisram Medical Ltd, swap sur rendement total	8 052	815
16 000	31 juill. 2023	Skyworth Group Ltd, swap sur rendement total	9 305	1 082
1 000	31 juill. 2023	Stella International, swap sur rendement total	1 276	11
15 000	31 juill. 2023	Sunac China Holdings Ltd, swap sur rendement total	11 926	5 577
5 000	31 juill. 2023	Swire Pacific Ltd – cat. A, swap sur rendement total	59 632	6 455
1 000	31 juill. 2023	Texhong Textile Group Ltd, swap sur rendement total	1 085	(27)
12 000	31 juill. 2023	Tianjin Development Hldgs Lt, swap sur rendement total	3 125	30
6 000	31 juill. 2023	Tianjin Port Dvlp Hlds Ltd, swap sur rendement total	594	18
4 000	31 juill. 2023	Tianneng Power Intl Ltd, swap sur rendement total	5 722	(105)
10 000	31 juill. 2023	Tongda Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	224	4
22 000	31 juill. 2023	Truly International Holdings, swap sur rendement total	4 659	(555)
4 000	31 juill. 2023	Vstees Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 125	184
4 000	31 juill. 2023	Wasion Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 805	(2)
4 000	31 juill. 2023	Weiqiao Textile Co Ltd-H, swap sur rendement total	1 111	212
50 000	31 juill. 2023	West China Cement Ltd, swap sur rendement total	7 986	494
300	31 juill. 2023	Wuxi Apptec Co Ltd-H, swap sur rendement total	4 294	280
1 500	31 juill. 2023	Wuxi Biologics Cayman Inc, swap sur rendement total	15 585	2 466

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
10 000	31 juill. 2023	Xinyi Glass Holdings Ltd, swap sur rendement total	25 242	(821)
4 000	31 juill. 2023	Yadea Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	9 069	(1 167)
2 000	31 juill. 2023	Zengame Technology Holding, swap sur rendement total	583	(5)
500	31 juill. 2023	Zhongsheng Group Holdings, swap sur rendement total	3 485	18
14 000	31 juill. 2023	Zijin Mining Group Co Ltd-H, swap sur rendement total	25 714	955
9 200	31 juill. 2023	Zte Corp-H, swap sur rendement total	27 471	319
				<u>34 614</u>
Yen japonais – taux moyen du financement à un jour offert à Tokyo (TONAR)				
100	31 juill. 2023	Advan Co Ltd, swap sur rendement total	882	(27)
100	31 juill. 2023	Aichi Tokei Denki Co Ltd, swap sur rendement total	1 371	(33)
200	31 juill. 2023	Airport Facilities Co Ltd, swap sur rendement total	1 068	(36)
170	31 juill. 2023	Ajis Co Ltd, swap sur rendement total	3 832	174
200	31 juill. 2023	Alconix Corp, swap sur rendement total	2 719	18
600	31 juill. 2023	Allied Telesis Holdings Kk, swap sur rendement total	653	35
200	31 juill. 2023	Amano Corp, swap sur rendement total	4 997	(81)
100	31 juill. 2023	Amiyaki Tei Co Ltd, swap sur rendement total	2 976	(3)
400	31 juill. 2023	Arakawa Chemical Industries, swap sur rendement total	3 980	(107)
100	31 juill. 2023	Artnature Inc, swap sur rendement total	775	(20)
600	31 juill. 2023	Asahi Net Inc, swap sur rendement total	3 518	1
400	31 juill. 2023	Asia Pile Holdings Corp, swap sur rendement total	2 226	25
900	31 juill. 2023	Astellas Pharma Inc, swap sur rendement total	18 544	(1 119)
200	31 juill. 2023	Bando Chemical Industries, swap sur rendement total	1 963	(88)
100	31 juill. 2023	Bank Of Saga Ltd/The, swap sur rendement total	1 824	168
100	31 juill. 2023	Carlit Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	801	63
100	31 juill. 2023	Carna Biosciences Inc, swap sur rendement total	534	(231)
100	31 juill. 2023	Central Automotive Products, swap sur rendement total	2 523	72
100	31 juill. 2023	Chikaranomoto Holdings Co Lt, swap sur rendement total	910	(24)
900	31 juill. 2023	Chiyoda Corp, swap sur rendement total	3 318	(155)
100	31 juill. 2023	Chiyoda Integre Co Ltd, swap sur rendement total	2 215	(247)
200	31 juill. 2023	Chuetsu Pulp & Paper Co Ltd, swap sur rendement total	1 970	23
100	31 juill. 2023	Ci Takiron Corp, swap sur rendement total	518	(4)
100	31 juill. 2023	Cleanup Corp, swap sur rendement total	663	(25)
300	31 juill. 2023	Computer Institute Of Japan, swap sur rendement total	2 751	(116)
300	31 juill. 2023	Dai Nippon Toryo Co Ltd, swap sur rendement total	2 314	(48)
100	31 juill. 2023	Daido Steel Co Ltd, swap sur rendement total	4 431	(102)
400	31 juill. 2023	Daiichi Sankyo Co Ltd, swap sur rendement total	17 457	(1 066)
100	31 juill. 2023	Dainichi Co Ltd, swap sur rendement total	678	(21)
1 100	31 juill. 2023	Ef-On Inc, swap sur rendement total	5 558	(632)
400	31 juill. 2023	Eisai Co Ltd, swap sur rendement total	35 753	(2 585)
100	31 juill. 2023	Endo Lighting Corp, swap sur rendement total	736	(31)
100	31 juill. 2023	Eri Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 314	205
100	31 juill. 2023	First Bank Of Toyama Ltd/The, swap sur rendement total	601	17
600	31 juill. 2023	Fujikura Kasei Co Ltd, swap sur rendement total	2 495	(24)
100	31 juill. 2023	Fukuda Corp, swap sur rendement total	4 554	(254)
100	31 juill. 2023	Fukui Bank Ltd/The, swap sur rendement total	1 545	45
300	31 juill. 2023	Furuno Electric Co Ltd, swap sur rendement total	2 985	(156)
100	31 juill. 2023	Globeride Inc, swap sur rendement total	2 625	(126)
100	31 juill. 2023	Godo Steel Ltd, swap sur rendement total	2 199	245
200	31 juill. 2023	Gun Ei Chemical Industry Co, swap sur rendement total	4 853	(121)
100	31 juill. 2023	Hagiwara Electric Holdings C, swap sur rendement total	2 513	(72)
500	31 juill. 2023	Healios Kk, swap sur rendement total	1 376	(32)
500	31 juill. 2023	Hino Motors Ltd, swap sur rendement total	2 583	(587)
100	31 juill. 2023	Hirakawa Hewtech Corp, swap sur rendement total	1 152	24
900	31 juill. 2023	Hiroshima Gas Co Ltd, swap sur rendement total	3 179	37
200	31 juill. 2023	Hochiki Corp, swap sur rendement total	2 877	(90)
100	31 juill. 2023	Hokko Chemical Industry Co, swap sur rendement total	835	(96)
200	31 juill. 2023	H-One Co Ltd, swap sur rendement total	1 263	(65)
300	31 juill. 2023	Icom Inc, swap sur rendement total	8 626	47
400	31 juill. 2023	Iino Kaiun Kaisha Ltd, swap sur rendement total	3 820	(12)
100	31 juill. 2023	Ijtt Co Ltd, swap sur rendement total	514	(10)
200	31 juill. 2023	Imagica Group Inc, swap sur rendement total	1 353	(195)
100	31 juill. 2023	Ishihara Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	1 261	(6)
200	31 juill. 2023	Ishihara Sangyo Kaisha Ltd, swap sur rendement total	2 183	(119)
500	31 juill. 2023	Itochu Enex Co Ltd, swap sur rendement total	5 391	155
100	31 juill. 2023	Itochu-Shokuhin Co Ltd, swap sur rendement total	5 073	(257)
100	31 juill. 2023	Itoki Corp, swap sur rendement total	603	37
100	31 juill. 2023	Iwasaki Electric Co Ltd, swap sur rendement total	2 338	(276)
100	31 juill. 2023	Japan Electronic Materials, swap sur rendement total	1 377	(188)
100	31 juill. 2023	Jfe Systems Inc, swap sur rendement total	2 369	123
100	31 juill. 2023	Jimoto Holdings Inc, swap sur rendement total	454	29

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	31 juill. 2023	Jp-Holdings Inc, swap sur rendement total	306	20
200	31 juill. 2023	Jvckenwood Corp, swap sur rendement total	758	(2)
100	31 juill. 2023	Kamei Corp, swap sur rendement total	1 254	21
100	31 juill. 2023	Kaneko Seeds Co Ltd, swap sur rendement total	1 471	3
100	31 juill. 2023	Kansai Paint Co Ltd, swap sur rendement total	1 663	(260)
100	31 juill. 2023	Kawai Musical Instruments Mf, swap sur rendement total	2 671	23
200	31 juill. 2023	Kayac Inc, swap sur rendement total	1 777	(1 009)
200	31 juill. 2023	Kimoto Co Ltd, swap sur rendement total	446	(43)
100	31 juill. 2023	Kitagawa Corp, swap sur rendement total	1 174	(45)
100	31 juill. 2023	Kohsoku Corp, swap sur rendement total	1 776	(40)
200	31 juill. 2023	Komatsu Matere Co Ltd, swap sur rendement total	1 590	(51)
100	31 juill. 2023	Kondotec Inc, swap sur rendement total	1 019	(10)
100	31 juill. 2023	Kyodo Printing Co Ltd, swap sur rendement total	2 822	(137)
100	31 juill. 2023	Kyoei Steel Ltd, swap sur rendement total	1 290	(37)
100	31 juill. 2023	Kyowa Electronic Instruments, swap sur rendement total	357	(11)
300	31 juill. 2023	Kyowa Leather Cloth Co Ltd, swap sur rendement total	1 534	(37)
600	31 juill. 2023	Maezawa Industries Inc, swap sur rendement total	3 783	13
200	31 juill. 2023	Maezawa Kyuso Industries Co, swap sur rendement total	1 879	(37)
100	31 juill. 2023	Matsui Construction Co Ltd, swap sur rendement total	575	(2)
100	31 juill. 2023	Medical System Network Co, swap sur rendement total	443	25
300	31 juill. 2023	Meiji Electric Industries Co, swap sur rendement total	3 247	43
300	31 juill. 2023	Meiji Shipping Co Ltd, swap sur rendement total	2 120	(102)
500	31 juill. 2023	Mie Kotsu Group Holdings Inc, swap sur rendement total	2 490	(35)
800	31 juill. 2023	Mikuni Corp, swap sur rendement total	2 637	(156)
300	31 juill. 2023	Mirai Industry Co Ltd, swap sur rendement total	4 458	(121)
100	31 juill. 2023	Mirai Co Ltd, swap sur rendement total	1 466	(296)
400	31 juill. 2023	Mitsubishi Paper Mills Ltd, swap sur rendement total	1 162	16
1 000	31 juill. 2023	Mitsui Osk Lines Ltd, swap sur rendement total	33 785	(768)
100	31 juill. 2023	Modec Inc, swap sur rendement total	1 399	(171)
100	31 juill. 2023	Morozoff Ltd, swap sur rendement total	3 610	(51)
100	31 juill. 2023	Mory Industries Inc, swap sur rendement total	2 824	(64)
200	31 juill. 2023	Mrmx Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 356	(3)
200	31 juill. 2023	Nafco Co Ltd, swap sur rendement total	3 196	13
100	31 juill. 2023	Nagano Bank Ltd/The, swap sur rendement total	1 376	94
300	31 juill. 2023	Naigai Trans Line Ltd, swap sur rendement total	6 500	(292)
300	31 juill. 2023	Nakayama Steel Works Ltd, swap sur rendement total	2 495	171
100	31 juill. 2023	Neturen Co Ltd, swap sur rendement total	676	(23)
200	31 juill. 2023	Nippon Beet Sugar Mfg Co Ltd, swap sur rendement total	3 420	78
100	31 juill. 2023	Nippon Seisen Co Ltd, swap sur rendement total	4 313	(169)
100	31 juill. 2023	Nishi-Nippon Financial Holdi, swap sur rendement total	989	90
100	31 juill. 2023	Nishio Rent All Co Ltd, swap sur rendement total	3 199	26
100	31 juill. 2023	Nissan Chemical Corp, swap sur rendement total	5 935	(985)
400	31 juill. 2023	Nissan Tokyo Sales Holdings, swap sur rendement total	1 204	(20)
200	31 juill. 2023	Nisso Corp, swap sur rendement total	1 185	(40)
100	31 juill. 2023	Nitto Kohki Co Ltd, swap sur rendement total	1 534	(33)
100	31 juill. 2023	Njs Co Ltd, swap sur rendement total	2 091	(33)
300	31 juill. 2023	Oenon Holdings Inc, swap sur rendement total	792	(68)
100	31 juill. 2023	Ohashi Technica Inc, swap sur rendement total	1 441	4
100	31 juill. 2023	Ohba Co Ltd, swap sur rendement total	672	(25)
100	31 juill. 2023	Okamoto Machine Tool Works, swap sur rendement total	4 477	(472)
100	31 juill. 2023	Oporun Co Ltd, swap sur rendement total	2 302	(294)
100	31 juill. 2023	Osaka Steel Co Ltd, swap sur rendement total	1 194	29
200	31 juill. 2023	Pasco Corp, swap sur rendement total	2 791	57
100	31 juill. 2023	Poletowin Pitcrew Holdings, swap sur rendement total	848	(111)
100	31 juill. 2023	Punch Industry Co Ltd, swap sur rendement total	396	(36)
200	31 juill. 2023	Quick Co Ltd, swap sur rendement total	4 338	60
1 800	31 juill. 2023	Rakuten Inc, swap sur rendement total	11 017	(1 010)
100	31 juill. 2023	Rasa Industries Ltd, swap sur rendement total	1 905	(263)
300	31 juill. 2023	Ryobi Ltd, swap sur rendement total	3 534	(296)
100	31 juill. 2023	Ryoden Corp, swap sur rendement total	1 740	10
100	31 juill. 2023	Saint-Care Holding Corp, swap sur rendement total	869	(8)
200	31 juill. 2023	Saizeriya Co Ltd, swap sur rendement total	6 141	323
100	31 juill. 2023	Sankyo Seiko Co Ltd, swap sur rendement total	489	(7)
300	31 juill. 2023	Sankyo Tateyama Inc, swap sur rendement total	1 627	(108)
100	31 juill. 2023	Santen Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	1 103	(41)
100	31 juill. 2023	Sanyo Trading Co Ltd, swap sur rendement total	1 155	(13)
100	31 juill. 2023	Sato Shoji Corp, swap sur rendement total	1 249	20
200	31 juill. 2023	Scala Inc, swap sur rendement total	1 464	(65)
200	31 juill. 2023	Sec Carbon Ltd, swap sur rendement total	14 582	309
100	31 juill. 2023	Seika Corp, swap sur rendement total	1 603	10

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
100	31 juill. 2023	Seiko Pmc Corp, swap sur rendement total	546	(25)
100	31 juill. 2023	Shikoku Bank Ltd/The, swap sur rendement total	1 006	63
100	31 juill. 2023	Shikoku Chemicals Corp, swap sur rendement total	1 338	(46)
500	31 juill. 2023	Shinnihon Corp, swap sur rendement total	3 825	(13)
200	31 juill. 2023	Sk-Electronics Ltd, swap sur rendement total	2 323	4
500	31 juill. 2023	Soda Nikka Co Ltd, swap sur rendement total	3 671	596
100	31 juill. 2023	Software Service Inc, swap sur rendement total	9 694	357
100	31 juill. 2023	St Corp, swap sur rendement total	1 555	(14)
100	31 juill. 2023	Sugimoto & Co Ltd, swap sur rendement total	2 019	(99)
200	31 juill. 2023	Sun-Wa Technos Corp, swap sur rendement total	3 280	146
100	31 juill. 2023	System Research Co Ltd, swap sur rendement total	2 174	83
200	31 juill. 2023	T&K Toka Co Ltd, swap sur rendement total	2 436	378
100	31 juill. 2023	Tachibana Eletech Co Ltd, swap sur rendement total	1 812	(11)
100	31 juill. 2023	Takashima & Co Ltd, swap sur rendement total	3 021	(29)
100	31 juill. 2023	Takebishi Corp, swap sur rendement total	1 592	43
400	31 juill. 2023	Teenos Japan Inc, swap sur rendement total	1 939	(70)
100	31 juill. 2023	Thine Electronics Inc, swap sur rendement total	898	(133)
900	31 juill. 2023	Tohoku Electric Power Co Inc, swap sur rendement total	6 386	359
100	31 juill. 2023	Tokai Corp/Gifu, swap sur rendement total	1 976	53
100	31 juill. 2023	Tokai Holdings Corp, swap sur rendement total	882	(7)
100	31 juill. 2023	Tokyo Century Corp, swap sur rendement total	4 601	(244)
100	31 juill. 2023	Tokyo Rope Mfg Co Ltd, swap sur rendement total	875	(37)
600	31 juill. 2023	Tokyo Sangyo Co Ltd, swap sur rendement total	4 633	(220)
500	31 juill. 2023	Toli Corp, swap sur rendement total	1 171	86
100	31 juill. 2023	Tomoe Corp, swap sur rendement total	416	24
200	31 juill. 2023	Tomony Holdings Inc, swap sur rendement total	760	43
200	31 juill. 2023	Topcon Corp, swap sur rendement total	3 144	(116)
100	31 juill. 2023	Topre Corp, swap sur rendement total	1 165	(128)
200	31 juill. 2023	Torigoe Co Ltd/The, swap sur rendement total	1 220	(54)
100	31 juill. 2023	Toukei Computer Co Ltd, swap sur rendement total	5 299	(724)
400	31 juill. 2023	Towa Bank Ltd/The, swap sur rendement total	2 308	62
400	31 juill. 2023	Tsukuba Bank Ltd, swap sur rendement total	974	102
100	31 juill. 2023	Tsuzuki Denki Co Ltd, swap sur rendement total	1 332	(30)
100	31 juill. 2023	Unipres Corp, swap sur rendement total	778	(118)
300	31 juill. 2023	Will Group Inc, swap sur rendement total	3 691	(499)
900	31 juill. 2023	Yamabiko Corp, swap sur rendement total	10 157	(323)
400	31 juill. 2023	Yasuda Logistics Corp, swap sur rendement total	3 800	(51)
100	31 juill. 2023	Yodogawa Steel Works Ltd, swap sur rendement total	2 608	(3)
200	31 juill. 2023	Yokogawa Electric Corp, swap sur rendement total	4 323	(923)
100	31 juill. 2023	Yomeishu Seizo Co Ltd, swap sur rendement total	1 855	16
100	31 juill. 2023	Yorozu Corp, swap sur rendement total	713	(107)
800	31 juill. 2023	Yushin Precision Equipment, swap sur rendement total	5 471	(180)
800	31 juill. 2023	Zeon Corp, swap sur rendement total	10 976	91
				(16 084)
Dollar néo-zélandais – taux du marché des acceptations bancaires (BKBM) à 1 mois				
1 171	31 juill. 2023	A2 Milk Co Ltd, swap sur rendement total	7 406	705
1 294	31 juill. 2023	Channel Infrastruct Nz Ltd, swap sur rendement total	1 586	17
745	31 juill. 2023	Contact Energy Ltd, swap sur rendement total	4 922	3
309	31 juill. 2023	Ebos Group Ltd, swap sur rendement total	11 624	594
2 006	31 juill. 2023	Infratil Ltd, swap sur rendement total	14 870	(397)
566	31 juill. 2023	Scales Corp Ltd, swap sur rendement total	1 989	(144)
848	31 juill. 2023	Tourism Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 514	(176)
				602
Dollar de Singapour – taux interbancaire offert à Singapour (SIBOR) à 1 mois				
300	31 juill. 2023	Aims Apac Reit, swap sur rendement total	376	11
300	31 juill. 2023	Brc Asia Ltd, swap sur rendement total	549	(5)
1 400	31 juill. 2023	Bumitama Agri Ltd, swap sur rendement total	834	(31)
1 000	31 juill. 2023	Delfi Ltd, swap sur rendement total	783	(8)
400	31 juill. 2023	First Resources Ltd, swap sur rendement total	598	(61)
400	31 juill. 2023	Hong Fok Corp Ltd, swap sur rendement total	384	(15)
1 500	31 juill. 2023	Hong Leong Finance Ltd, swap sur rendement total	3 622	3
1 100	31 juill. 2023	Hmetgroup Ltd, swap sur rendement total	872	(14)
800	31 juill. 2023	Lian Beng Group Ltd, swap sur rendement total	404	(9)
8 797	31 juill. 2023	Riverstone Holdings Ltd, swap sur rendement total	5 466	(153)
8 900	31 juill. 2023	Sembcorp Marine Ltd, swap sur rendement total	1 241	(13)
300	31 juill. 2023	Sheng Siong Group Ltd, swap sur rendement total	500	(2)
28 517	31 juill. 2023	Thomson Medical Group Ltd, swap sur rendement total	2 247	(36)
200	31 juill. 2023	Uol Group Ltd, swap sur rendement total	1 358	(7)
800	31 juill. 2023	Venture Corp Ltd, swap sur rendement total	13 788	(230)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
				(570)
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
1 183	31 juill. 2023	Advtech Ltd, swap sur rendement total	1 713	(45)
1 184	31 juill. 2023	Aeci Ltd, swap sur rendement total	8 259	(457)
303	31 juill. 2023	Afrimat Ltd, swap sur rendement total	1 219	76
1 260	31 juill. 2023	Allied Electronics Cor-A Shr, swap sur rendement total	925	(32)
1 210	31 juill. 2023	Alviva Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 617	248
165	31 juill. 2023	Anglo American Platinum Ltd, swap sur rendement total	18 722	(3 881)
986	31 juill. 2023	Arcelormittal South Africa, swap sur rendement total	372	9
2 839	31 juill. 2023	Arrowhead Properties Ltd-B, swap sur rendement total	708	(48)
24	31 juill. 2023	Astral Foods Ltd, swap sur rendement total	311	(10)
1 952	31 juill. 2023	Avi Ltd, swap sur rendement total	11 691	215
350	31 juill. 2023	Barloworld Ltd, swap sur rendement total	2 362	(53)
60	31 juill. 2023	Bid Corp Ltd, swap sur rendement total	1 576	(34)
39	31 juill. 2023	Bidvest Group Ltd, swap sur rendement total	666	(59)
3	31 juill. 2023	Capitec Bank Holdings Ltd, swap sur rendement total	444	(17)
313	31 juill. 2023	Cashbuild Ltd, swap sur rendement total	4 711	(174)
26	31 juill. 2023	Clicks Group Ltd, swap sur rendement total	559	(45)
690	31 juill. 2023	Coronation Fund Managers Ltd, swap sur rendement total	1 688	(239)
618	31 juill. 2023	Datatec Ltd, swap sur rendement total	1 526	23
479	31 juill. 2023	Discovery Ltd, swap sur rendement total	4 705	(184)
474	31 juill. 2023	Emira Property Fund Ltd, swap sur rendement total	388	6
361	31 juill. 2023	Firstrand Ltd, swap sur rendement total	1 786	(149)
627	31 juill. 2023	Grindrod Ltd, swap sur rendement total	499	(51)
484	31 juill. 2023	Hosken Cons Investments Ltd, swap sur rendement total	6 032	(541)
245	31 juill. 2023	Hudaco Industries Ltd, swap sur rendement total	2 751	6
1 345	31 juill. 2023	Investec Property Fund Ltd, swap sur rendement total	1 026	(4)
523	31 juill. 2023	Jse Ltd, swap sur rendement total	4 518	222
1 418	31 juill. 2023	Lewis Group Ltd, swap sur rendement total	5 533	(140)
1 508	31 juill. 2023	Life Healthcare Group Holdin, swap sur rendement total	2 027	(64)
166	31 juill. 2023	Metair Investments Ltd, swap sur rendement total	364	(9)
698	31 juill. 2023	Motus Holdings Ltd, swap sur rendement total	6 152	(364)
20	31 juill. 2023	Mr Price Group Ltd, swap sur rendement total	253	(49)
3 753	31 juill. 2023	Nampak Ltd, swap sur rendement total	311	(275)
47	31 juill. 2023	Nedbank Group Ltd, swap sur rendement total	796	(68)
908	31 juill. 2023	Netcare Ltd, swap sur rendement total	1 048	(14)
1 539	31 juill. 2023	Northam Platinum Ltd, swap sur rendement total	22 940	(1 212)
444	31 juill. 2023	Omnia Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 212	(302)
2 645	31 juill. 2023	Outsurance Group Ltd, swap sur rendement total	6 643	462
241	31 juill. 2023	Raubex Group Ltd, swap sur rendement total	531	(9)
87	31 juill. 2023	Sasol Ltd, swap sur rendement total	1 867	(162)
2 477	31 juill. 2023	Southern Sun Ltd, swap sur rendement total	890	47
167	31 juill. 2023	Sun International Ltd, swap sur rendement total	460	(19)
93	31 juill. 2023	The Foschini Group Ltd, swap sur rendement total	748	(88)
85	31 juill. 2023	Thungela Resources Ltd, swap sur rendement total	1 940	(206)
464	31 juill. 2023	Tiger Brands Ltd, swap sur rendement total	7 760	540
11 683	31 juill. 2023	Tsogo Sun Gaming Ltd, swap sur rendement total	10 894	(993)
				(8 143)
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
316	31 juill. 2023	Addtech Ab-actions, B, swap sur rendement total	6 110	(227)
55	31 juill. 2023	Alfa Laval Ab, swap sur rendement total	2 154	10
200	31 juill. 2023	Alimak Group Ab, swap sur rendement total	1 940	(132)
191	31 juill. 2023	Ambea Ab, swap sur rendement total	1 093	(153)
100	31 juill. 2023	Aq Group Ab, swap sur rendement total	4 025	200
56	31 juill. 2023	Arise Ab, swap sur rendement total	366	(4)
12	31 juill. 2023	Assa Abloy Ab-B, swap sur rendement total	349	(8)
1 238	31 juill. 2023	Avanza Bank Holding Ab, swap sur rendement total	35 997	2 110
36	31 juill. 2023	Axfood Ab, swap sur rendement total	1 338	15
121	31 juill. 2023	Beijer Alma Ab, swap sur rendement total	2 571	(66)
19	31 juill. 2023	Beijer Ref Ab, swap sur rendement total	363	(85)
156	31 juill. 2023	Bergman & Beving Aktiebolag, swap sur rendement total	2 256	321
525	31 juill. 2023	Betsson Ab, swap sur rendement total	5 787	(74)
34	31 juill. 2023	Billerudkorsnas Ab, swap sur rendement total	562	(54)
96	31 juill. 2023	Biotage Ab, swap sur rendement total	2 316	34
30	31 juill. 2023	Byggmax Group Ab, swap sur rendement total	194	7
19	31 juill. 2023	Concentric Ab, swap sur rendement total	482	(26)
75	31 juill. 2023	Elanders Ab, actions, B, swap sur rendement total	1 463	65
160	31 juill. 2023	Elekta Ab, actions, B, swap sur rendement total	1 307	18
166	31 juill. 2023	Evolution Gaming Group, swap sur rendement total	21 919	(1 130)
3 075	31 juill. 2023	Hennes & Mauritz Ab, actions, B, swap sur rendement total	44 882	(1 807)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
820	31 juill. 2023	Hexatronic Group Ab, swap sur rendement total	15 094	(377)
51	31 juill. 2023	Humana Ab, swap sur rendement total	255	(28)
74	31 juill. 2023	Intrum Ab, swap sur rendement total	1 214	(39)
50	31 juill. 2023	Inwido Ab, swap sur rendement total	720	38
72	31 juill. 2023	Kindred Group Plc, swap sur rendement total	1 017	5
39	31 juill. 2023	Lagercrantz Group Ab, actions, B, swap sur rendement total	524	(37)
525	31 juill. 2023	Lifco Ab-actions, B, swap sur rendement total	11 889	(393)
251	31 juill. 2023	Modern Times Group, actions, B, swap sur rendement total	2 908	196
34	31 juill. 2023	New Wave Group Ab, actions, B, swap sur rendement total	913	(20)
736	31 juill. 2023	Nibe Industrier Ab, actions, B, swap sur rendement total	9 293	(109)
86	31 juill. 2023	Nordic Waterproofing Hold Ab, swap sur rendement total	1 628	(48)
294	31 juill. 2023	Np3 Fastigheter Ab, swap sur rendement total	7 593	627
648	31 juill. 2023	Orron Energy Ab, swap sur rendement total	1 893	(126)
210	31 juill. 2023	Proact It Group Ab, swap sur rendement total	2 267	(42)
441	31 juill. 2023	Rottneros Ab, swap sur rendement total	701	(91)
52	31 juill. 2023	Sagax Ab-B, swap sur rendement total	1 599	36
21	31 juill. 2023	Sandvik Ab, swap sur rendement total	514	(1)
644	31 juill. 2023	Scandic Hotels Group Ab, swap sur rendement total	2 698	(255)
9	31 juill. 2023	Securitas Ab, actions, B, swap sur rendement total	102	2
655	31 juill. 2023	Skf Ab-actions, B, swap sur rendement total	13 556	(885)
136	31 juill. 2023	Thule Group Ab/The, swap sur rendement total	3 850	(480)
350	31 juill. 2023	Tobii Ab, swap sur rendement total	761	(2)
				<u>(3 015)</u>
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
76	31 juill. 2023	Ascom Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	827	(45)
67	31 juill. 2023	Banque Cantonale Vaudois- actions ord., swap sur rendement total	8 708	(58)
4	31 juill. 2023	Barry Callebaut Ag, actions ord., swap sur rendement total	10 714	(335)
9	31 juill. 2023	Berner Kantonalbank Ag, actions ord., swap sur rendement total	2 933	(19)
8	31 juill. 2023	Bossard Holding Ag, actions ord., A, swap sur rendement total	2 341	(79)
1	31 juill. 2023	Burckhardt Compression Holdi, swap sur rendement total	807	51
81	31 juill. 2023	Calida Holding, actions ord., swap sur rendement total	5 605	50
4	31 juill. 2023	Dksh Holding Ag, swap sur rendement total	411	(2)
4	31 juill. 2023	Feintool Intl Holding, actions ord., swap sur rendement total	118	(6)
7	31 juill. 2023	Flughafen Zurich Ag, actions ord., swap sur rendement total	1 467	(133)
85	31 juill. 2023	Galenica Ag, swap sur rendement total	9 405	386
5	31 juill. 2023	Helvetia Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	789	14
697	31 juill. 2023	Holcim Ltd, swap sur rendement total	48 874	(879)
4	31 juill. 2023	Investis Holding Sa, swap sur rendement total	595	(9)
1	31 juill. 2023	Phoenix Mecano Ag-Br, swap sur rendement total	482	(22)
97	31 juill. 2023	Psp Swiss Property Ag, actions ord., swap sur rendement total	15 413	585
8	31 juill. 2023	Sensirion Holding Ag, swap sur rendement total	1 148	(50)
3	31 juill. 2023	Sonova Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	963	(12)
86	31 juill. 2023	Swiss Life Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	60 605	(2 575)
94	31 juill. 2023	Swiss Prime Site- actions ord., swap sur rendement total	11 034	181
1	31 juill. 2023	Swissquote Group Holding- actions ord., swap sur rendement total	196	(2)
11	31 juill. 2023	Tecan Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	6 644	328
48	31 juill. 2023	Thurgauer Kantonalbank, Cert, swap sur rendement total	8 365	2
13	31 juill. 2023	Tx Group Ag, swap sur rendement total	2 818	106
8	31 juill. 2023	U-Blox Holding Ag, swap sur rendement total	1 291	(127)
				<u>(2 650)</u>
Dollar américain – taux interbancaire offert à Londres (ICE LIBOR) à 1 mois				
2 000	31 juill. 2023	Acter Group Corp Ltd, swap sur rendement total	8 950	(28)
20	31 juill. 2023	Adani Transmission Ltd, swap sur rendement total	848	(124)
900	31 juill. 2023	Affin Bank Bhd, swap sur rendement total	562	(29)
34	31 juill. 2023	Afreecatv Co Ltd, swap sur rendement total	2 599	(368)
95	31 juill. 2023	Agi Greenpac Ltd, swap sur rendement total	509	39
178	31 juill. 2023	Ak Holdings Inc, swap sur rendement total	3 291	445
625	31 juill. 2023	Alembic Ltd, swap sur rendement total	729	(47)
47 725	31 juill. 2023	Alfa S.A.B.-A, swap sur rendement total	41 189	(3 786)
1 000	31 juill. 2023	Ali Corp, swap sur rendement total	904	(44)
1 000	31 juill. 2023	All Cosmos Bio-Tech Holding, swap sur rendement total	2 368	(269)
700	31 juill. 2023	Alpek Sa De Cv, swap sur rendement total	1 343	(4)
100	31 juill. 2023	Alsea Sab De Cv, swap sur rendement total	256	(14)
3 000	31 juill. 2023	Ambassador Hotel/The, swap sur rendement total	4 312	160
939	31 juill. 2023	Amtran Technology Co Ltd, swap sur rendement total	414	10
50	31 juill. 2023	Antarchile Sa, swap sur rendement total	574	35
209	31 juill. 2023	Apar Industries Ltd, swap sur rendement total	6 138	1 014
7 000	31 juill. 2023	Ata Ims Bhd, swap sur rendement total	485	(8)
1 000	31 juill. 2023	Aten Internation Co Ltd, swap sur rendement total	3 417	-
1 000	31 juill. 2023	Avalue Technology Inc, swap sur rendement total	3 589	720

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
5 700	31 juill. 2023	Azul Sa, swap sur rendement total	16 086	(1 984)
500	31 juill. 2023	Banco Del Bajio Sa, swap sur rendement total	2 140	(129)
4 800	31 juill. 2023	Banco Do Brasil Sa, swap sur rendement total	42 729	(750)
100	31 juill. 2023	Banco Estado Rio Gran-actions priv., B -, swap sur rendement total	249	(8)
295	31 juill. 2023	Banco Products (India) Ltd, swap sur rendement total	967	(33)
1 000	31 juill. 2023	Bangkok Aviation Fuel Servic, swap sur rendement total	1 242	48
5 100	31 juill. 2023	Bangkok Ranch Pcl, swap sur rendement total	587	(3)
2 800	31 juill. 2023	Bank Of Chengdu Co Ltd-A, swap sur rendement total	8 414	169
400	31 juill. 2023	Bb Seguridade Participacoes, swap sur rendement total	3 456	236
200	31 juill. 2023	Bear Electric Appliance Co-A, swap sur rendement total	2 370	(13)
1 000	31 juill. 2023	Bes Engineering Corp, swap sur rendement total	359	(5)
3	31 juill. 2023	Bgf Retail Co Ltd, swap sur rendement total	679	10
445	31 juill. 2023	Bhi Co Ltd, swap sur rendement total	3 105	(291)
4	31 juill. 2023	Blue Dart Express Ltd, swap sur rendement total	505	(3)
176	31 juill. 2023	Bnk Financial Group Inc, swap sur rendement total	1 230	(78)
300	31 juill. 2023	Braskem Sa-actions priv., A, swap sur rendement total	1 827	(227)
500	31 juill. 2023	Brf Sa, swap sur rendement total	1 061	40
20 971	31 juill. 2023	Cal-Comp Electronics Thailan, swap sur rendement total	1 904	(37)
2 000	31 juill. 2023	Cameo Communications Inc, swap sur rendement total	908	35
38	31 juill. 2023	Caplin Point Laboratories, swap sur rendement total	444	(36)
233	31 juill. 2023	Cell Biotech Co Ltd, swap sur rendement total	3 181	310
1 680	31 juill. 2023	Celsia Sa Esp, swap sur rendement total	1 305	(76)
5	31 juill. 2023	Cera Sanitaryware Ltd, swap sur rendement total	426	(21)
280	31 juill. 2023	Cesc Ltd, swap sur rendement total	350	2
2 000	31 juill. 2023	Chc Resources Corp, swap sur rendement total	4 056	14
2 000	31 juill. 2023	Cheng Uei Precision Industry, swap sur rendement total	3 254	(226)
10 600	31 juill. 2023	Chengdu Hongqi Chain Co Lt-A, swap sur rendement total	11 721	1 157
2 000	31 juill. 2023	China Chemical & Pharm Co, swap sur rendement total	2 932	1 076
1 000	31 juill. 2023	China Ecotek Corporation, swap sur rendement total	1 889	11
900	31 juill. 2023	China Electric Manufacturing, swap sur rendement total	524	(62)
6 900	31 juill. 2023	Chularat Hospital Pcl, swap sur rendement total	994	8
100	31 juill. 2023	Cia De Saneamento Do Pa, parts, swap sur rendement total	463	(31)
4 223	31 juill. 2023	Cia Energetica Minas Ger, actions priv., swap sur rendement total	12 058	(412)
292 266	31 juill. 2023	Cia Sud Americana De Vapores, swap sur rendement total	31 240	(975)
300	31 juill. 2023	Cimb Group Holdings Bhd, swap sur rendement total	535	3
96	31 juill. 2023	Cj Hello Co Ltd, swap sur rendement total	454	(42)
500	31 juill. 2023	Companhia Brasileira De Alum, swap sur rendement total	1 480	(61)
4 000	31 juill. 2023	Coretronic Corp, swap sur rendement total	10 034	(116)
38	31 juill. 2023	Crown Confectionery Co Ltd, swap sur rendement total	347	14
58	31 juill. 2023	Cs Wind Corp, swap sur rendement total	4 290	(207)
50	31 juill. 2023	Csc Steel Holdings Bhd, swap sur rendement total	18	-
57	31 juill. 2023	Cte Bio Inc, swap sur rendement total	386	(26)
100	31 juill. 2023	Cuckoo Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 768	62
1 000	31 juill. 2023	Cyberlink Corp, swap sur rendement total	3 655	(161)
248	31 juill. 2023	D.B. Corp Ltd, swap sur rendement total	501	19
74	31 juill. 2023	Daehan Steel Co Ltd, swap sur rendement total	863	(111)
243	31 juill. 2023	Daewon Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	4 898	506
300	31 juill. 2023	Daqin Railway Co Ltd, A, swap sur rendement total	394	2
635	31 juill. 2023	Dasan Networks Inc, swap sur rendement total	2 720	(146)
4	31 juill. 2023	Dentium Co Ltd, swap sur rendement total	430	67
33	31 juill. 2023	Dgb Financial Group Inc, swap sur rendement total	248	(17)
5 800	31 juill. 2023	Diamond Building Products Pc, swap sur rendement total	1 827	39
1 558	31 juill. 2023	Dish Tv India Ltd, swap sur rendement total	470	(67)
422	31 juill. 2023	Dms Co Ltd, swap sur rendement total	2 713	398
1 000	31 juill. 2023	Do Day Dream Pcl, swap sur rendement total	622	14
28	31 juill. 2023	Dongbu Hitek Co Ltd, swap sur rendement total	1 118	(140)
100	31 juill. 2023	Dongbu Securities Co Ltd, swap sur rendement total	441	(29)
81	31 juill. 2023	Dongbu Steel Co Ltd, swap sur rendement total	643	(101)
873	31 juill. 2023	Dongkuk Steel Mill Co Ltd, swap sur rendement total	10 464	(1 709)
136	31 juill. 2023	Dongwon Development Co, swap sur rendement total	500	(6)
5	31 juill. 2023	Dongwon Industries Co Ltd, swap sur rendement total	265	29
55	31 juill. 2023	Doosan Bobcat Inc, swap sur rendement total	2 046	65
58	31 juill. 2023	Doosan Corp, swap sur rendement total	5 181	(552)
198	31 juill. 2023	Duksan Hi-Metal Co Ltd, swap sur rendement total	1 020	(64)
472	31 juill. 2023	E.Sun Financial Holding Co, swap sur rendement total	500	(15)
70	31 juill. 2023	Easy Bio Inc, swap sur rendement total	211	(11)
215	31 juill. 2023	Eclerx Services Ltd, swap sur rendement total	4 505	(696)
1 900	31 juill. 2023	Ecorodovias Infra E Log Sa, swap sur rendement total	2 167	36
1 000	31 juill. 2023	E-Life Mall Corporation, swap sur rendement total	3 606	26
1 000	31 juill. 2023	Elitegroup Computer Systems, swap sur rendement total	908	(81)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
582	31 juill. 2023	Embassy Office Parks Reit, swap sur rendement total	3 204	(131)
300	31 juill. 2023	Equatorial Energia Sa, actions ord., swap sur rendement total	2 078	(187)
3 500	31 juill. 2023	Erawan Group Pcl/The, swap sur rendement total	614	15
700	31 juill. 2023	Eucatex Sa Industria, actions priv., swap sur rendement total	1 520	202
150	31 juill. 2023	Eveready Industries India, swap sur rendement total	891	13
2 600	31 juill. 2023	Evergreen Fibreboard Bhd, swap sur rendement total	312	(14)
4 000	31 juill. 2023	Excelsior Medical Co Ltd, swap sur rendement total	11 921	463
1 000	31 juill. 2023	Farglory Ftz Investment Hold, swap sur rendement total	2 306	(118)
42	31 juill. 2023	Fiem Industries Ltd, swap sur rendement total	1 193	(172)
40	31 juill. 2023	First Financial Holding Co, swap sur rendement total	47	1
4 000	31 juill. 2023	Forth Smart Service Pcl, swap sur rendement total	2 019	(234)
1 000	31 juill. 2023	Fsp Technology Inc, swap sur rendement total	1 678	(22)
2 000	31 juill. 2023	Gamania Digital Entertainment, swap sur rendement total	6 163	269
1 000	31 juill. 2023	Gemtek Technology Corp, swap sur rendement total	1 208	(53)
183	31 juill. 2023	General Ins Corp Of India, swap sur rendement total	536	61
600	31 juill. 2023	Genomma Lab Internacional, B, swap sur rendement total	707	2
15 500	31 juill. 2023	Genera Sab De Cv, swap sur rendement total	23 650	1 137
200	31 juill. 2023	Genting Plantations Bhd, swap sur rendement total	394	14
700	31 juill. 2023	Global Green Chemicals Pcl, swap sur rendement total	405	4
4 000	31 juill. 2023	Glyconex Inc, swap sur rendement total	5 370	(236)
542	31 juill. 2023	Gmr Infrastructure Ltd, swap sur rendement total	353	(38)
800	31 juill. 2023	Gol Linhas Aereas, actions priv., swap sur rendement total	1 505	49
262	31 juill. 2023	Goodyear India Ltd, swap sur rendement total	4 759	(64)
60	31 juill. 2023	Great Wall Enterprises, swap sur rendement total	120	3
44	31 juill. 2023	Grindwell Norton Ltd, swap sur rendement total	1 285	(126)
400	31 juill. 2023	Grupo Bimbo Sab, série A, swap sur rendement total	2 291	(19)
1 300	31 juill. 2023	Grupo Comercial Chedraui Sa, swap sur rendement total	7 520	(147)
46	31 juill. 2023	Grupo Nutresa Sa, swap sur rendement total	572	4
1 955	31 juill. 2023	Grupo Security Sa, swap sur rendement total	537	44
29	31 juill. 2023	Gs Engineering & Construct, swap sur rendement total	659	(30)
1 522	31 juill. 2023	Gujarat Inds Power Co Ltd, swap sur rendement total	2 055	(182)
17	31 juill. 2023	Haesung Ds Co Ltd, swap sur rendement total	655	(72)
8	31 juill. 2023	Handsome Co Ltd, swap sur rendement total	233	19
100	31 juill. 2023	Hamil Cement Co Ltd, swap sur rendement total	1 161	(2)
5	31 juill. 2023	Hanmi Science Co Ltd, swap sur rendement total	174	14
200	31 juill. 2023	Hansae Yes24 Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	994	(29)
460	31 juill. 2023	Hansol Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 617	37
25	31 juill. 2023	Hansol Paper Co Ltd, swap sur rendement total	356	1
71	31 juill. 2023	Hansol Technics Co Ltd, swap sur rendement total	389	(6)
121	31 juill. 2023	Hanwha Aerospace Co Ltd, swap sur rendement total	9 574	671
72	31 juill. 2023	Hanwha Chemical Corp, swap sur rendement total	3 328	(426)
318	31 juill. 2023	Hanwha General Insurance Co, swap sur rendement total	1 593	220
8 201	31 juill. 2023	Hanwha Life Insurance Co Ltd, swap sur rendement total	24 421	3 465
582	31 juill. 2023	Hb Technology Co Ltd, swap sur rendement total	1 201	27
200	31 juill. 2023	Henan Lingrui Pharmaceutic, A, swap sur rendement total	512	(24)
1 000	31 juill. 2023	Hey Song Corp, swap sur rendement total	1 437	(18)
43	31 juill. 2023	Hg Infra Engineering Ltd, swap sur rendement total	437	7
3 700	31 juill. 2023	Hibiscus Petroleum Bhd, swap sur rendement total	1 218	(37)
8 000	31 juill. 2023	Hidrovias Do Brasil Sa, swap sur rendement total	4 634	(283)
169	31 juill. 2023	Hitejinro Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 766	(26)
2 000	31 juill. 2023	Hitron Technology Inc, swap sur rendement total	2 112	(282)
692	31 juill. 2023	Home Center Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	844	(86)
100	31 juill. 2023	Hong Leong Bank Berhad, swap sur rendement total	633	(133)
1 000	31 juill. 2023	Hsing Ta Cement Co Ltd, swap sur rendement total	690	(6)
194	31 juill. 2023	Humax Co Ltd, swap sur rendement total	688	(38)
425	31 juill. 2023	Hwa Shin Co Ltd, swap sur rendement total	3 299	(650)
52	31 juill. 2023	Hwasung Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	587	(92)
100	31 juill. 2023	Hypera Sa, swap sur rendement total	1 166	(19)
50	31 juill. 2023	Hyundai Corporation, swap sur rendement total	871	(49)
12	31 juill. 2023	Hyundai Energy Solutions, swap sur rendement total	630	(130)
307	31 juill. 2023	Hyundai Engineering & Const, swap sur rendement total	11 518	(1 289)
110	31 juill. 2023	Hyundai Marine & Fire Ins Co, swap sur rendement total	3 483	113
70	31 juill. 2023	Hyundai Mipo Dockyard, swap sur rendement total	6 359	219
4	31 juill. 2023	Hyundai Mobis Co Ltd, swap sur rendement total	862	9
3	31 juill. 2023	Hyundai Motor Co, swap sur rendement total	487	1
100	31 juill. 2023	Hyundai Motor Securities Co, swap sur rendement total	977	(53)
11	31 juill. 2023	Hyundai Robotics Co Ltd, swap sur rendement total	675	(51)
85	31 juill. 2023	Hyundai Steel Co, swap sur rendement total	2 796	(112)
28	31 juill. 2023	Hyundai Wia Corp, swap sur rendement total	1 488	(215)
4 000	31 juill. 2023	Ichia Technologies Inc, swap sur rendement total	3 210	20

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
400	31 juill. 2023	Ihh Healthcare Bhd, swap sur rendement total	765	56
170	31 juill. 2023	Il Dong Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	3 682	(1 734)
104	31 juill. 2023	Il Dong Pharmaceutical Co Lt, swap sur rendement total	3 192	(885)
397	31 juill. 2023	Iljin Electric Co Ltd, swap sur rendement total	2 266	(25)
123	31 juill. 2023	Inbody Co Ltd, swap sur rendement total	2 671	351
129	31 juill. 2023	Industrias Romi Sa, swap sur rendement total	511	46
4 000	31 juill. 2023	Infortrend Technology Inc, swap sur rendement total	3 377	(96)
62	31 juill. 2023	Inox Leisure Ltd, swap sur rendement total	507	(51)
254	31 juill. 2023	Integrated Diagnostics Holdi, swap sur rendement total	218	(23)
47	31 juill. 2023	Interflex Co Ltd, swap sur rendement total	193	(18)
100	31 juill. 2023	Intouch Holdings Pcl, swap sur rendement total	302	17
1 000	31 juill. 2023	Inventec Corp, swap sur rendement total	1 157	63
300	31 juill. 2023	Ioi Corp Bhd, swap sur rendement total	374	23
1 000	31 juill. 2023	Iron Force Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	3 201	(392)
85	31 juill. 2023	It'S Skin Co Ltc, swap sur rendement total	1 631	102
81	31 juill. 2023	J.B. Chemicals & Pharma Ltd, swap sur rendement total	2 580	(151)
236	31 juill. 2023	J.Kumar Infraprojects Ltd, swap sur rendement total	1 053	(50)
1 981	31 juill. 2023	Jagran Prakashan Ltd, swap sur rendement total	2 374	(22)
9 800	31 juill. 2023	Jasmine Intl Public Co Ltd, swap sur rendement total	844	(42)
222	31 juill. 2023	Jm Financial Ltd, swap sur rendement total	260	(16)
1 000	31 juill. 2023	Journess Group Ltd, swap sur rendement total	3 311	118
37	31 juill. 2023	Kangwon Land Inc, swap sur rendement total	923	(28)
375	31 juill. 2023	Karur Vysya Bank Ltd, swap sur rendement total	696	68
25	31 juill. 2023	Kc Co Ltd, swap sur rendement total	458	(4)
2 000	31 juill. 2023	Kee Tai Properties Co Ltd, swap sur rendement total	1 115	23
1 100	31 juill. 2023	Kelington Group Bhd, swap sur rendement total	464	(27)
99	31 juill. 2023	Kginicis Co Ltd, swap sur rendement total	1 245	(40)
2 500	31 juill. 2023	Khon Kaen Sugar Industry Pcl, swap sur rendement total	362	(1)
62	31 juill. 2023	Kirloskar Brothers Ltd, swap sur rendement total	329	(68)
100	31 juill. 2023	Kisco Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 682	(80)
2 400	31 juill. 2023	Klabin Sa - parts, swap sur rendement total	12 305	124
5	31 juill. 2023	Kolon Industries Inc, swap sur rendement total	221	(12)
499	31 juill. 2023	Korea Aerospace Industries, swap sur rendement total	27 305	2 733
150	31 juill. 2023	Korea Cast Iron Pipe Indus, swap sur rendement total	1 093	(18)
36	31 juill. 2023	Korea Information&Communicat, swap sur rendement total	441	(56)
186	31 juill. 2023	Korea Shipbuilding & Offshor, swap sur rendement total	14 137	(684)
1	31 juill. 2023	Korea Zinc Co Ltd, swap sur rendement total	606	(34)
46	31 juill. 2023	Korean Reinsurance Co, swap sur rendement total	337	(23)
131	31 juill. 2023	Kss Line Ltd, swap sur rendement total	1 303	28
432	31 juill. 2023	Ktb Investment & Securities, swap sur rendement total	1 300	(134)
55	31 juill. 2023	Kumho Tire Co Inc, swap sur rendement total	164	(6)
1 000	31 juill. 2023	La Kaffa International Co Lt, swap sur rendement total	5 533	84
1 000	31 juill. 2023	Leofoo Development, swap sur rendement total	736	(4)
3 400	31 juill. 2023	Leong Hup International Bhd, swap sur rendement total	518	(55)
68	31 juill. 2023	Lf Corp, swap sur rendement total	1 162	53
8	31 juill. 2023	Lg Chem Ltd, swap sur rendement total	5 160	(771)
2	31 juill. 2023	Lg Innotek Co Ltd, swap sur rendement total	543	(82)
28	31 juill. 2023	Lg International Corp, swap sur rendement total	1 022	(147)
47	31 juill. 2023	Lg Uplus Corp, swap sur rendement total	558	(18)
1 221	31 juill. 2023	Lian Hwa Foods Corp, swap sur rendement total	4 021	(16)
1 000	31 juill. 2023	Lida Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 318	25
300	31 juill. 2023	Lier Chemical Co Ltd -A, swap sur rendement total	1 058	(40)
22	31 juill. 2023	Lig Nex1 Co Ltd, swap sur rendement total	2 181	109
400	31 juill. 2023	Light Sa, swap sur rendement total	475	(96)
3 784	31 juill. 2023	Lotte Chemical Titan Holding, swap sur rendement total	1 653	(221)
48	31 juill. 2023	Lotte Fine Chemical Co Ltd, swap sur rendement total	2 926	(138)
2 500	31 juill. 2023	Lpn Development Pcl, swap sur rendement total	452	11
26	31 juill. 2023	Ls Corp, swap sur rendement total	1 948	(62)
568	31 juill. 2023	Lumax Auto Technologies Ltd, swap sur rendement total	2 228	(257)
100	31 juill. 2023	Lumax Industries Ltd, swap sur rendement total	2 772	(489)
1 111	31 juill. 2023	Lumax International Corp Ltd, swap sur rendement total	3 380	(69)
1 000	31 juill. 2023	Lung Yen Life Service Corp, swap sur rendement total	1 722	78
900	31 juill. 2023	M Dias Branco Sa, swap sur rendement total	8 265	(818)
1 900	31 juill. 2023	Macquarie Mexico Real Estate, swap sur rendement total	3 758	(98)
800	31 juill. 2023	Magnum Bhd, swap sur rendement total	318	(10)
3 400	31 juill. 2023	Malaysian Bulk Carriers Bhd, swap sur rendement total	481	30
500	31 juill. 2023	Marcopolo Sa, actions priv., swap sur rendement total	381	64
32	31 juill. 2023	Mas Financial Services Ltd, swap sur rendement total	425	(30)
22 047	31 juill. 2023	Masisa Sa, swap sur rendement total	1 231	290
21	31 juill. 2023	Max Financial Services Ltd, swap sur rendement total	233	(14)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
2 300	31 juill. 2023	Mbm Resources Berhad, swap sur rendement total	2 321	(6)
15 900	31 juill. 2023	Media Prima Bhd, swap sur rendement total	2 055	(83)
500	31 juill. 2023	Mega First Corp Bhd, swap sur rendement total	511	–
43	31 juill. 2023	Megastudyedu Co Ltd, swap sur rendement total	3 680	280
114	31 juill. 2023	Meritz Financial Group Inc, swap sur rendement total	5 233	863
70	31 juill. 2023	Meritz Fire & Marine Insuran, swap sur rendement total	3 740	458
6 400	31 juill. 2023	Metalurgica Gerdau Sa, swap sur rendement total	21 276	(1 055)
716	31 juill. 2023	Mirae Asset Life Insurance, swap sur rendement total	2 224	143
9 000	31 juill. 2023	Mitac Holdings Corp, swap sur rendement total	11 705	(97)
200	31 juill. 2023	Mk Restaurants Group Pcl, swap sur rendement total	460	26
107	31 juill. 2023	Moda-Innochips Co Ltd, swap sur rendement total	338	(26)
400	31 juill. 2023	Mrv Engenharia, swap sur rendement total	779	(85)
572	31 juill. 2023	Muhak Co Ltd, swap sur rendement total	3 035	67
307	31 juill. 2023	Namhae Chemical Corp, swap sur rendement total	2 809	(48)
1	31 juill. 2023	Namyang Dairy Products Co, swap sur rendement total	526	83
160	31 juill. 2023	Narayana Hrudayalaya Ltd, swap sur rendement total	1 993	8
600	31 juill. 2023	Netbay Pcl, swap sur rendement total	587	(20)
178	31 juill. 2023	Nhn Corp, swap sur rendement total	4 765	305
744	31 juill. 2023	Nhpc Ltd, swap sur rendement total	484	(38)
314	31 juill. 2023	Nlc India Ltd, swap sur rendement total	443	(2)
1	31 juill. 2023	Nongshim Co Ltd, swap sur rendement total	384	40
874	31 juill. 2023	Nrb Bearings Ltd, swap sur rendement total	2 185	25
1 000	31 juill. 2023	O-Bank Co Ltd, swap sur rendement total	370	(7)
1 000	31 juill. 2023	Obi Pharma Inc, swap sur rendement total	3 046	(334)
700	31 juill. 2023	Oriental Holdings Berhad, swap sur rendement total	1 462	(8)
4	31 juill. 2023	Orion Corp, swap sur rendement total	550	68
1 000	31 juill. 2023	Pacific Hospital Supply Co, swap sur rendement total	3 329	110
1 000	31 juill. 2023	P-Duke Technology Co Ltd, swap sur rendement total	3 809	14
3 100	31 juill. 2023	Polyplex Pcl, swap sur rendement total	3 063	124
13	31 juill. 2023	Poongsan Holdings Corp, swap sur rendement total	396	29
2 500	31 juill. 2023	Porto Seguro Sa, swap sur rendement total	14 834	(804)
1 000	31 juill. 2023	Posiflex Technology Inc, swap sur rendement total	4 761	(661)
3 200	31 juill. 2023	Power Root Bhd, swap sur rendement total	2 067	(186)
106	31 juill. 2023	Prataap Snacks Ltd, swap sur rendement total	1 579	(103)
1 700	31 juill. 2023	Principal Capital Pcl, swap sur rendement total	386	(8)
400	31 juill. 2023	Profarma Distribuidora, swap sur rendement total	394	13
101	31 juill. 2023	Pyeong Hwa Automotive Co Lt, swap sur rendement total	764	35
100	31 juill. 2023	Qingdao Haier Co Ltd, A, swap sur rendement total	480	5
700	31 juill. 2023	Raia Drogasil Sa, swap sur rendement total	4 256	100
2 500	31 juill. 2023	Rajthanee Hospital Pcl, swap sur rendement total	2 959	21
100	31 juill. 2023	Rayence Co Ltd, swap sur rendement total	1 183	35
100	31 juill. 2023	Regional Sab De Cv, swap sur rendement total	974	(13)
3 000	31 juill. 2023	Ritek Corporation, swap sur rendement total	1 007	13
600	31 juill. 2023	Ruentex Development Co Ltd, swap sur rendement total	1 144	(70)
600	31 juill. 2023	Rumo Na, swap sur rendement total	2 862	(48)
327	31 juill. 2023	S&T Dynamics Co Ltd, swap sur rendement total	3 283	(155)
213	31 juill. 2023	S&T Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	3 595	169
6	31 juill. 2023	S-1 Corporation, swap sur rendement total	382	(15)
2 500	31 juill. 2023	Sahamitr Pressure Container, swap sur rendement total	1 272	7
50	31 juill. 2023	Sam Kang M&T Co Ltd, swap sur rendement total	1 080	(97)
61	31 juill. 2023	Samhwa Paints Industrial Co, swap sur rendement total	386	(1)
135	31 juill. 2023	Sammok S-Form Co Ltd, swap sur rendement total	2 424	(413)
26	31 juill. 2023	Samsung Biologics Co Ltd, swap sur rendement total	22 947	(419)
460	31 juill. 2023	Samsung Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	11 003	(483)
5	31 juill. 2023	Samsung Fire & Marine Ins, swap sur rendement total	1 075	31
3 383	31 juill. 2023	Samsung Heavy Industries, swap sur rendement total	18 584	652
93	31 juill. 2023	Samsung Sdi Co Ltd, swap sur rendement total	59 087	(9 766)
2 000	31 juill. 2023	Sanyang Motor Co Ltd, swap sur rendement total	2 985	(207)
100	31 juill. 2023	Sao Martinho Sa, swap sur rendement total	680	(187)
900	31 juill. 2023	Sarawak Oil Palms Berhad, swap sur rendement total	720	19
5 500	31 juill. 2023	Sc Asset Corp Pcl, swap sur rendement total	908	35
131	31 juill. 2023	Schaeffler India Ltd, swap sur rendement total	5 894	40
2 000	31 juill. 2023	Sciencetech Corp, swap sur rendement total	6 349	(145)
185	31 juill. 2023	Seah Besteel Corp, swap sur rendement total	3 242	(362)
1 728	31 juill. 2023	Sejong Telecom Inc, swap sur rendement total	1 206	(120)
1 000	31 juill. 2023	Senao International Co Ltd, swap sur rendement total	1 353	(16)
199	31 juill. 2023	Seoyon E-Hwa Co Ltd, swap sur rendement total	1 681	(188)
100	31 juill. 2023	Shanghai Lingang Holdings, A, swap sur rendement total	234	(7)
1 000	31 juill. 2023	Shinkong Insurance Co Ltd, swap sur rendement total	2 154	(36)
567	31 juill. 2023	Shinsung E&G Energy Co Ltd, swap sur rendement total	948	(160)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
139	31 juill. 2023	Shinwon Corp, swap sur rendement total	231	(6)
6	31 juill. 2023	Silicon Works Co Ltd, swap sur rendement total	462	(53)
41	31 juill. 2023	Simmtech Co Ltd, swap sur rendement total	1 166	(210)
23	31 juill. 2023	Sindoh Co Ltd, swap sur rendement total	800	(6)
1 000	31 juill. 2023	Sinon Corp, swap sur rendement total	1 607	(75)
2 000	31 juill. 2023	Sirtec International Co Ltd, swap sur rendement total	1 821	29
59	31 juill. 2023	Sk Networks Co Ltd, swap sur rendement total	245	(8)
13	31 juill. 2023	Sk Telecom, swap sur rendement total	662	6
11	31 juill. 2023	Skc Co Ltd, swap sur rendement total	1 047	(205)
65	31 juill. 2023	Sm Culture & Contents Co Ltd, swap sur rendement total	207	(18)
5 400	31 juill. 2023	Snc Former Pcl, swap sur rendement total	2 958	106
1 000	31 juill. 2023	Soft-World Intl Corp, swap sur rendement total	3 518	83
1 400	31 juill. 2023	Solarvest Holdings Bhd, swap sur rendement total	368	19
3 100	31 juill. 2023	Spcg Pcl, swap sur rendement total	1 759	27
12	31 juill. 2023	Sundaytoz Corp, swap sur rendement total	160	(21)
3 000	31 juill. 2023	Sunspring Metal Corp, swap sur rendement total	2 989	67
469	31 juill. 2023	Supreme Petrochem Ltd, swap sur rendement total	6 078	129
1 900	31 juill. 2023	Svi Pcl, swap sur rendement total	717	3
9 304	31 juill. 2023	Synmosa Biopharma Corp, swap sur rendement total	19 976	3 864
284	31 juill. 2023	Taeyoung Engineering & Const, swap sur rendement total	1 230	(211)
1 000	31 juill. 2023	Taisol Electronics Co Ltd, swap sur rendement total	1 380	(162)
1 000	31 juill. 2023	Taiwan Fire & Marine Insuran, swap sur rendement total	902	5
4 000	31 juill. 2023	Taiwan Hon Chuan Enterprise, swap sur rendement total	15 343	949
2 000	31 juill. 2023	Taiwan Sakura Corp, swap sur rendement total	5 476	(6)
1 000	31 juill. 2023	Taiwan Steel Union Co Ltd, swap sur rendement total	4 056	(35)
608	31 juill. 2023	Tata Teleservices Maharashtra, swap sur rendement total	924	(114)
10 000	31 juill. 2023	Teco Electric & Machinery, swap sur rendement total	12 146	(261)
1 300	31 juill. 2023	Tesco Lotus Retail Growth Fr, swap sur rendement total	646	16
1 000	31 juill. 2023	Test-Rite International Co, swap sur rendement total	866	(15)
100	31 juill. 2023	Thai Stanley Electric Pub Co, swap sur rendement total	726	248
229	31 juill. 2023	Theragen Etex Co Ltd, swap sur rendement total	1 088	98
100	31 juill. 2023	Thermax Ltd, swap sur rendement total	3 224	(198)
18 700	31 juill. 2023	Thoresen Thai Agencies Pcl, swap sur rendement total	6 000	198
3 900	31 juill. 2023	Tks Technologies Pcl, swap sur rendement total	1 892	118
2 000	31 juill. 2023	Ton Yi Industrial Corp, swap sur rendement total	1 503	(53)
56	31 juill. 2023	Tongyang Life Insurance, swap sur rendement total	293	(21)
1 000	31 juill. 2023	Tpk Holding Co Ltd, swap sur rendement total	1 298	(111)
124	31 juill. 2023	Transport Corp Of India Ltd, swap sur rendement total	1 257	(177)
3 591	31 juill. 2023	Triveni Engineering & Indus, swap sur rendement total	16 581	(1 150)
609	31 juill. 2023	Tym Corp, swap sur rendement total	1 886	268
755	31 juill. 2023	Uco Bank, swap sur rendement total	390	(24)
700	31 juill. 2023	Umw Holdings Bhd, swap sur rendement total	747	49
7	31 juill. 2023	Unid Co Ltd, swap sur rendement total	613	70
1 088	31 juill. 2023	Union Bank Of Taiwan, swap sur rendement total	767	(24)
5 000	31 juill. 2023	Uni-President Enterprises Co, swap sur rendement total	14 681	120
1 000	31 juill. 2023	United Orthopedic Corp, swap sur rendement total	2 107	312
1 000	31 juill. 2023	Universal Cement, swap sur rendement total	979	14
1 000	31 juill. 2023	Userjoy Technology Co Ltd, swap sur rendement total	3 399	38
1 200	31 juill. 2023	Usinas Sider Minas Ger, actions priv., A, swap sur rendement total	2 202	(135)
2 000	31 juill. 2023	Via Technologies Inc, swap sur rendement total	5 934	(588)
8 700	31 juill. 2023	Vibhavadi Medical Center Pcl, swap sur rendement total	926	(6)
5 500	31 juill. 2023	Vibra Energia Sa, swap sur rendement total	22 472	(881)
39	31 juill. 2023	Visaka Industries Ltd, swap sur rendement total	276	(10)
176	31 juill. 2023	Vrl Logistics Ltd, swap sur rendement total	1 561	(80)
10	31 juill. 2023	Vst Tillers Tractors Ltd, swap sur rendement total	361	(38)
1 200	31 juill. 2023	Vulcabras Azaleia Sa, swap sur rendement total	3 839	(79)
100	31 juill. 2023	Walmart De Mexico Sab De Cv, swap sur rendement total	477	(52)
200	31 juill. 2023	Wasu Media Holding Co Ltd, A, swap sur rendement total	294	13
2 200	31 juill. 2023	Wet Holdings Bhd, swap sur rendement total	271	(19)
1 000	31 juill. 2023	Wistron Corp, swap sur rendement total	1 296	77
937	31 juill. 2023	Wonderla Holidays Ltd, swap sur rendement total	5 245	(840)
327	31 juill. 2023	Wonik Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 193	23
10	31 juill. 2023	Wonik Materials Co Ltd, swap sur rendement total	305	(15)
131	31 juill. 2023	Woongjin Co Ltd, swap sur rendement total	167	6
1 000	31 juill. 2023	Xxentria Technology Material, swap sur rendement total	2 694	(92)
7 000	31 juill. 2023	Yc Inox Co Ltd, swap sur rendement total	8 934	261
100	31 juill. 2023	Young Poong Precision Corp, swap sur rendement total	1 279	(234)
1 000	31 juill. 2023	Yungshin Global Holding Corp, swap sur rendement total	2 028	246
200	31 juill. 2023	Zamp Sa, swap sur rendement total	279	(27)
2 000	31 juill. 2023	Zhen Ding Technology Holding, swap sur rendement total	9 258	(1 276)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
2 000	31 juill. 2023	Zinwell Corporation, swap sur rendement total	1 503	(92)
Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position acheteur				(22 943)
				(72 354)
Swaps d'actions – position vendeur				
Dollar australien – taux de swap des acceptations bancaires (BBSW) à 1 mois				
(2 632)	31 juill. 2023	Accent Group Ltd, swap sur rendement total	(4 063)	295
(3 518)	31 juill. 2023	Adairs Ltd, swap sur rendement total	(7 112)	309
(543)	31 juill. 2023	Adelaide Brighton Ltd, swap sur rendement total	(826)	23
(10 389)	31 juill. 2023	Ama Group Ltd, swap sur rendement total	(2 052)	5
(7 468)	31 juill. 2023	Amp Ltd, swap sur rendement total	(9 024)	330
(71)	31 juill. 2023	Ap Eagers Ltd, swap sur rendement total	(708)	90
(1 309)	31 juill. 2023	Apn Industria Reit, swap sur rendement total	(3 537)	11
(440)	31 juill. 2023	Appen Ltd, swap sur rendement total	(1 007)	54
(193)	31 juill. 2023	Arb Corp Ltd, swap sur rendement total	(4 552)	469
(240)	31 juill. 2023	Australian Strategic Material, swap sur rendement total	(316)	53
(81)	31 juill. 2023	Baby Bunting Group Ltd, swap sur rendement total	(202)	(4)
(404)	31 juill. 2023	Bapcor Ltd, swap sur rendement total	(2 398)	168
(1 127)	31 juill. 2023	Betmakers Technology Group L, swap sur rendement total	(285)	(14)
(531)	31 juill. 2023	Bravura Solutions Ltd, swap sur rendement total	(427)	(41)
(23)	31 juill. 2023	Carsales.Com Ltd, swap sur rendement total	(439)	25
(1 341)	31 juill. 2023	Centuria Office Reit, swap sur rendement total	(1 929)	36
(2 357)	31 juill. 2023	Challenger Ltd, swap sur rendement total	(16 503)	(672)
(520)	31 juill. 2023	Charter Hall Long Wale Reit, swap sur rendement total	(2 150)	(19)
(99)	31 juill. 2023	City Chic Collective Ltd, swap sur rendement total	(43)	29
(134)	31 juill. 2023	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd, swap sur rendement total	(2 668)	(246)
(1 216)	31 juill. 2023	Clover Corp Ltd, swap sur rendement total	(1 385)	14
(42)	31 juill. 2023	Coles Group Ltd, swap sur rendement total	(645)	13
(874)	31 juill. 2023	Cooper Energy Ltd, swap sur rendement total	(149)	8
(2 476)	31 juill. 2023	Cromwell Property Group, swap sur rendement total	(1 556)	52
(414)	31 juill. 2023	Domain Holdings Australia Lt, swap sur rendement total	(1 031)	131
(39)	31 juill. 2023	Domino'S Pizza Enterprises L, swap sur rendement total	(2 374)	9
(549)	31 juill. 2023	Eml Payments Ltd, swap sur rendement total	(318)	7
(30)	31 juill. 2023	Flight Centre Travel Group L, swap sur rendement total	(399)	48
(323)	31 juill. 2023	G.U.D. Holdings Ltd, swap sur rendement total	(2 250)	174
(1 513)	31 juill. 2023	Goodman Group, swap sur rendement total	(24 343)	2 253
(188)	31 juill. 2023	Gwa Group Ltd, swap sur rendement total	(354)	13
(1 745)	31 juill. 2023	Imdex Ltd, swap sur rendement total	(3 544)	326
(7 196)	31 juill. 2023	Imugene Ltd, swap sur rendement total	(959)	267
(2 379)	31 juill. 2023	Jervois Mining Ltd, swap sur rendement total	(601)	202
(109)	31 juill. 2023	Johns Lyng Group Ltd, swap sur rendement total	(620)	107
(55)	31 juill. 2023	Kelsian Group Ltd, swap sur rendement total	(291)	(13)
(227)	31 juill. 2023	Magellan Financial Group Ltd, swap sur rendement total	(1 865)	183
(3 495)	31 juill. 2023	Mirvac Group, swap sur rendement total	(7 007)	160
(444)	31 juill. 2023	Money3 Corp Ltd, swap sur rendement total	(767)	5
(25)	31 juill. 2023	National Australia Bank Ltd, swap sur rendement total	(691)	36
(74)	31 juill. 2023	Nufarm Ltd, swap sur rendement total	(417)	(5)
(93)	31 juill. 2023	Omni Bridgeway Ltd, swap sur rendement total	(309)	59
(769)	31 juill. 2023	Ooh!Media Ltd, swap sur rendement total	(908)	18
(1 004)	31 juill. 2023	Paladin Energy Ltd, swap sur rendement total	(646)	83
(3 546)	31 juill. 2023	Perenti Global Ltd, swap sur rendement total	(4 285)	(683)
(3 896)	31 juill. 2023	Pointsbet Holdings Ltd, swap sur rendement total	(5 316)	1 859
(388)	31 juill. 2023	Polynovo Ltd, swap sur rendement total	(720)	2
(81)	31 juill. 2023	Rea Group Ltd, swap sur rendement total	(8 247)	934
(471)	31 juill. 2023	Reece Ltd, swap sur rendement total	(6 124)	525
(2 894)	31 juill. 2023	Reliance Worldwide Corp Ltd, swap sur rendement total	(7 871)	281
(235)	31 juill. 2023	Scentre Group, swap sur rendement total	(622)	21
(1 378)	31 juill. 2023	Seek Ltd, swap sur rendement total	(26 527)	1 503
(380)	31 juill. 2023	Select Harvests Ltd, swap sur rendement total	(1 372)	162
(319)	31 juill. 2023	Service Stream Ltd, swap sur rendement total	(201)	2
(1 986)	31 juill. 2023	Sigma Healthcare Ltd, swap sur rendement total	(1 113)	72
(1 614)	31 juill. 2023	Southern Cross Media Group L, swap sur rendement total	(1 579)	(13)
(144)	31 juill. 2023	Star Entertainment Grp Ltd/T, swap sur rendement total	(234)	118
(615)	31 juill. 2023	Starpharma Holdings Ltd, swap sur rendement total	(311)	(27)
(37)	31 juill. 2023	Suncorp Group Ltd, swap sur rendement total	(409)	(3)
(1 299)	31 juill. 2023	Superloop Ltd, swap sur rendement total	(865)	22
(1 145)	31 juill. 2023	Syrah Resources Ltd, swap sur rendement total	(2 167)	487
(505)	31 juill. 2023	Telix Pharmaceuticals Ltd, swap sur rendement total	(3 373)	45
(1 822)	31 juill. 2023	Telstra Corp Ltd, swap sur rendement total	(6 680)	(1)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(3 408)	31 juill. 2023	Tyro Payments Ltd, swap sur rendement total	(4 431)	943
(694)	31 juill. 2023	Vicinity Centres, swap sur rendement total	(1 275)	21
(1 303)	31 juill. 2023	Worleyparsons Ltd, swap sur rendement total	(17 959)	(227)
(2 263)	31 juill. 2023	Zip Co Ltd, swap sur rendement total	(1 060)	474
				11 568
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
(541)	31 juill. 2023	4D Pharma Plc, swap sur rendement total	(147)	–
(109)	31 juill. 2023	Admiral Group Plc, swap sur rendement total	(3 797)	(188)
(1 450)	31 juill. 2023	Advanced Medical Solutions, swap sur rendement total	(6 121)	359
(493)	31 juill. 2023	Ascential Plc, swap sur rendement total	(1 620)	121
(4 052)	31 juill. 2023	Assura Plc, swap sur rendement total	(3 654)	(106)
(658)	31 juill. 2023	Aston Martin Lagonda Global, swap sur rendement total	(1 652)	(210)
(241)	31 juill. 2023	Aveva Group Plc, swap sur rendement total	(12 621)	(94)
(19)	31 juill. 2023	Avon Rubber Plc, swap sur rendement total	(333)	(13)
(2 380)	31 juill. 2023	Barclays Plc, swap sur rendement total	(6 149)	82
(884)	31 juill. 2023	Batm Advanced Communications, swap sur rendement total	(395)	(11)
(52)	31 juill. 2023	Beazley Plc, swap sur rendement total	(576)	(24)
(208)	31 juill. 2023	Berkeley Group Holdings/The, swap sur rendement total	(12 791)	163
(3 028)	31 juill. 2023	Boohoo Group Plc, swap sur rendement total	(1 749)	310
(100)	31 juill. 2023	Boot (Henry) Plc, swap sur rendement total	(383)	(1)
(892)	31 juill. 2023	Breedon Group Plc, swap sur rendement total	(887)	(5)
(4 814)	31 juill. 2023	Bt Group Plc, swap sur rendement total	(8 973)	430
(548)	31 juill. 2023	Cairn Homes Plc, swap sur rendement total	(703)	2
(1 621)	31 juill. 2023	Capital & Counties Propertie, swap sur rendement total	(2 814)	(123)
(100)	31 juill. 2023	Chesnara Plc, swap sur rendement total	(462)	11
(46)	31 juill. 2023	Clarkson Plc, swap sur rendement total	(2 425)	(129)
(140)	31 juill. 2023	Close Brothers Group Plc, swap sur rendement total	(2 389)	64
(1 874)	31 juill. 2023	Costain Group Plc, swap sur rendement total	(1 203)	45
(1 839)	31 juill. 2023	Countryside Properties Plc, swap sur rendement total	(6 888)	(498)
(6)	31 juill. 2023	Croda International Plc, swap sur rendement total	(646)	289
(1 089)	31 juill. 2023	De La Rue Plc, swap sur rendement total	(1 393)	53
(43)	31 juill. 2023	Dechra Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	(1 835)	76
(216)	31 juill. 2023	Dignity Plc, swap sur rendement total	(1 461)	(152)
(2 944)	31 juill. 2023	Diversified Energy Co Plc, swap sur rendement total	(5 585)	479
(665)	31 juill. 2023	Domino'S Pizza Group Plc, swap sur rendement total	(3 180)	(67)
(3 391)	31 juill. 2023	Easyjet Plc, swap sur rendement total	(17 940)	3 622
(225)	31 juill. 2023	Energiean Plc, swap sur rendement total	(4 800)	557
(1 533)	31 juill. 2023	Essentra Plc, swap sur rendement total	(5 909)	188
(10)	31 juill. 2023	First Derivatives Plc, swap sur rendement total	(222)	7
(243)	31 juill. 2023	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(44 715)	3 616
(827)	31 juill. 2023	Foxtons Group Plc, swap sur rendement total	(400)	31
(98)	31 juill. 2023	Frasers Group Plc, swap sur rendement total	(1 134)	145
(398)	31 juill. 2023	Future Plc, swap sur rendement total	(8 219)	916
(627)	31 juill. 2023	Gb Group Plc, swap sur rendement total	(3 217)	104
(49)	31 juill. 2023	Genuit Group Plc, swap sur rendement total	(224)	26
(79)	31 juill. 2023	Grainger Plc, swap sur rendement total	(329)	(16)
(341)	31 juill. 2023	Great Portland Estates Plc, swap sur rendement total	(2 777)	1
(3 713)	31 juill. 2023	Greatland Gold Plc, swap sur rendement total	(484)	(22)
(1 139)	31 juill. 2023	Gym Group Plc/The, swap sur rendement total	(2 023)	(109)
(26)	31 juill. 2023	Hikma Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	(658)	(13)
(228)	31 juill. 2023	Hill & Smith Holdings Plc, swap sur rendement total	(4 404)	44
(21)	31 juill. 2023	Homeserve Plc, swap sur rendement total	(410)	(1)
(574)	31 juill. 2023	Hotel Chocolat Group Plc, swap sur rendement total	(1 455)	(97)
(1 699)	31 juill. 2023	Hyve Group Plc, swap sur rendement total	(2 038)	(365)
(108)	31 juill. 2023	Ig Design Group Plc, swap sur rendement total	(217)	5
(6 366)	31 juill. 2023	Itm Power Plc, swap sur rendement total	(9 508)	1 219
(11 845)	31 juill. 2023	Itv Plc, swap sur rendement total	(14 510)	(25)
(65)	31 juill. 2023	James Fisher & Sons Plc, swap sur rendement total	(414)	(55)
(7 447)	31 juill. 2023	Jd Sports Fashion Plc, swap sur rendement total	(15 327)	10
(1 884)	31 juill. 2023	John Wood Group Plc, swap sur rendement total	(4 150)	(133)
(1 646)	31 juill. 2023	Jubilee Metals Group Plc, swap sur rendement total	(272)	40
(444)	31 juill. 2023	Kier Group Plc, swap sur rendement total	(429)	31
(90)	31 juill. 2023	Land Securities Group Plc, swap sur rendement total	(925)	(21)
(6 353)	31 juill. 2023	Legal & General Group Plc, swap sur rendement total	(25 835)	286
(793)	31 juill. 2023	Lloyds Banking Group Plc, swap sur rendement total	(587)	21
(89)	31 juill. 2023	Londonmetric Property Plc, swap sur rendement total	(253)	5
(100)	31 juill. 2023	M P Evans Group Plc, swap sur rendement total	(1 320)	82
(717)	31 juill. 2023	M&G Plc, swap sur rendement total	(2 195)	58
(679)	31 juill. 2023	Marshalls Plc, swap sur rendement total	(3 023)	192
(476)	31 juill. 2023	Next Plc, swap sur rendement total	(45 556)	(138)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(3 071)	31 juill. 2023	Ocado Group Plc, swap sur rendement total	(30 873)	499
(11 030)	31 juill. 2023	Old Mutual Ltd, swap sur rendement total	(9 151)	778
(66)	31 juill. 2023	Oxford Biomedica Plc, swap sur rendement total	(476)	(67)
(189)	31 juill. 2023	Pagegroup Plc, swap sur rendement total	(1 421)	34
(173)	31 juill. 2023	Pennon Group Plc, swap sur rendement total	(2 505)	77
(17)	31 juill. 2023	Persimmon Plc, swap sur rendement total	(337)	12
(6 552)	31 juill. 2023	Phoenix Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(64 992)	(1 969)
(100)	31 juill. 2023	Phoenix Spree Deutschland Lt, swap sur rendement total	(403)	6
(259)	31 juill. 2023	Picton Property Income Ltd, swap sur rendement total	(337)	21
(713)	31 juill. 2023	Prudential Plc, swap sur rendement total	(13 103)	(1 278)
(7 692)	31 juill. 2023	Quilter Plc, swap sur rendement total	(11 649)	1 077
(3 557)	31 juill. 2023	Restaurant Group Plc, swap sur rendement total	(1 811)	(143)
(1 481)	31 juill. 2023	Rws Holdings Plc, swap sur rendement total	(9 066)	(1 063)
(1 755)	31 juill. 2023	S4 Capital Plc, swap sur rendement total	(5 412)	27
(529)	31 juill. 2023	Sainsbury (J) Plc, swap sur rendement total	(1 877)	47
(406)	31 juill. 2023	Serica Energy Plc, swap sur rendement total	(1 886)	185
(491)	31 juill. 2023	Severfield Plc, swap sur rendement total	(496)	3
(146)	31 juill. 2023	Shell Plc, swap sur rendement total	(5 535)	78
(548)	31 juill. 2023	Softcat Plc, swap sur rendement total	(10 575)	686
(3 250)	31 juill. 2023	St James'S Place Plc, swap sur rendement total	(58 003)	3 033
(302)	31 juill. 2023	Standard Chartered Plc, swap sur rendement total	(3 064)	(100)
(264)	31 juill. 2023	Strix Group Plc, swap sur rendement total	(353)	(27)
(500)	31 juill. 2023	Sylvania Platinum Ltd, swap sur rendement total	(835)	(37)
(289)	31 juill. 2023	Synthomer Plc, swap sur rendement total	(679)	(52)
(525)	31 juill. 2023	Target Healthcare Reit Plc, swap sur rendement total	(686)	(8)
(96)	31 juill. 2023	Tate & Lyle Plc, swap sur rendement total	(1 121)	23
(144)	31 juill. 2023	Tp Icap Plc, swap sur rendement total	(410)	2
(88)	31 juill. 2023	Trainline Plc, swap sur rendement total	(394)	76
(61)	31 juill. 2023	Travis Perkins Plc, swap sur rendement total	(884)	36
(10 427)	31 juill. 2023	Vodafone Group Plc, swap sur rendement total	(14 324)	1 254
(131)	31 juill. 2023	Woodside Energy Group, swap sur rendement total	(4 249)	65
(175)	31 juill. 2023	Xps Pensions Group Plc, swap sur rendement total	(396)	21
				<u>14 370</u>
Euro – taux à court terme (ESTR)				
(99)	31 juill. 2023	I&I Ag, swap sur rendement total	(1 661)	312
(9)	31 juill. 2023	Acciona Sa, swap sur rendement total	(2 237)	187
(762)	31 juill. 2023	Accor Sa, swap sur rendement total	(25 729)	2 004
(36)	31 juill. 2023	Ackermans & Van Haaren, swap sur rendement total	(8 340)	(463)
(23)	31 juill. 2023	Ado Properties Sa, swap sur rendement total	(45)	15
(170)	31 juill. 2023	Adp, swap sur rendement total	(30 778)	5 129
(5 994)	31 juill. 2023	Aegon Nv, swap sur rendement total	(41 068)	(593)
(4)	31 juill. 2023	Aena Sme Sa, swap sur rendement total	(678)	35
(10 502)	31 juill. 2023	Air France-Klm, swap sur rendement total	(18 695)	809
(38)	31 juill. 2023	Aixtron Se, swap sur rendement total	(1 482)	226
(218)	31 juill. 2023	Akzo Nobel N.V., swap sur rendement total	(19 722)	1 804
(13)	31 juill. 2023	Alfen Nv, swap sur rendement total	(1 583)	7
(319)	31 juill. 2023	Almirall Sa, swap sur rendement total	(4 170)	104
(25)	31 juill. 2023	Altarea, swap sur rendement total	(4 562)	338
(24)	31 juill. 2023	Amadeus It Group Sa, swap sur rendement total	(1 685)	98
(5 725)	31 juill. 2023	Amper Sa, swap sur rendement total	(1 235)	165
(43)	31 juill. 2023	Amundi Sa, swap sur rendement total	(3 296)	78
(73)	31 juill. 2023	Aperam, swap sur rendement total	(3 113)	18
(117)	31 juill. 2023	Arcadis Nv, swap sur rendement total	(6 209)	284
(132)	31 juill. 2023	Arkema, swap sur rendement total	(16 011)	82
(53)	31 juill. 2023	Aroundtown Sa, swap sur rendement total	(167)	(1)
(90)	31 juill. 2023	Asm International Nv, swap sur rendement total	(30 669)	3 112
(496)	31 juill. 2023	Atos Se, swap sur rendement total	(6 464)	731
(198)	31 juill. 2023	Atresmedia Corp De Medios De, swap sur rendement total	(914)	46
(718)	31 juill. 2023	Audax Renovables Sa, swap sur rendement total	(778)	136
(2)	31 juill. 2023	Aurubis Ag, swap sur rendement total	(221)	(1)
(149)	31 juill. 2023	Auto1 Group Se, swap sur rendement total	(1 681)	136
(325)	31 juill. 2023	Banco Bilbao Vizcaya Argenta, swap sur rendement total	(2 648)	(42)
(150)	31 juill. 2023	Banco Santander Sa, swap sur rendement total	(608)	3
(258)	31 juill. 2023	Basf Se, swap sur rendement total	(17 307)	704
(372)	31 juill. 2023	Bayer Ag, actions ord., swap sur rendement total	(25 996)	3 600
(284)	31 juill. 2023	Bayerische Motoren Werke Ag, swap sur rendement total	(34 243)	935
(346)	31 juill. 2023	Be Semiconductor Industries, swap sur rendement total	(28 299)	1 882
(151)	31 juill. 2023	Bechtle Ag, swap sur rendement total	(7 219)	322
(250)	31 juill. 2023	Bigben Interactive, swap sur rendement total	(2 303)	111
(37)	31 juill. 2023	Biomerieux, swap sur rendement total	(5 239)	(90)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(100)	31 juill. 2023	Bittium Oyj, swap sur rendement total	(575)	(38)
(88)	31 juill. 2023	Borussia Dortmund Gmbh & Co, swap sur rendement total	(471)	(20)
(601)	31 juill. 2023	Bpost Sa, swap sur rendement total	(4 175)	605
(77)	31 juill. 2023	Ca Immobilien Anlagen Ag, swap sur rendement total	(3 157)	361
(138)	31 juill. 2023	Caverion Oyj, swap sur rendement total	(1 383)	8
(202)	31 juill. 2023	Cellectis, swap sur rendement total	(580)	40
(1 406)	31 juill. 2023	Cellnex Telecom Sa, swap sur rendement total	(62 866)	3 400
(44)	31 juill. 2023	Cofinimmo, swap sur rendement total	(5 326)	(42)
(391)	31 juill. 2023	Colruyt Sa, swap sur rendement total	(12 043)	1 707
(164)	31 juill. 2023	Compugroup Medical Se, swap sur rendement total	(8 533)	(17)
(7)	31 juill. 2023	Construcc Y Aux De Ferrocarr, swap sur rendement total	(268)	15
(116)	31 juill. 2023	Corbion Nv, swap sur rendement total	(5 341)	(415)
(38)	31 juill. 2023	Covestro Ag, swap sur rendement total	(2 008)	91
(23)	31 juill. 2023	Cropenergies Ag, swap sur rendement total	(433)	50
(4)	31 juill. 2023	Cts Eventim Ag & Co Kгаа, swap sur rendement total	(345)	(1)
(89)	31 juill. 2023	Daimler Truck Holding Ag, swap sur rendement total	(3 725)	144
(57)	31 juill. 2023	Deutsche Pfandbriefbank Ag, swap sur rendement total	(599)	26
(331)	31 juill. 2023	Deutsche Wohnen Se, swap sur rendement total	(9 518)	363
(27)	31 juill. 2023	Draegerwerk Ag, actions priv., swap sur rendement total	(1 630)	60
(3 953)	31 juill. 2023	E.On Se, swap sur rendement total	(53 356)	(1 135)
(49)	31 juill. 2023	Ebro Foods Sa, swap sur rendement total	(1 039)	35
(475)	31 juill. 2023	Edenred, swap sur rendement total	(34 949)	1 142
(65)	31 juill. 2023	Eiffage, swap sur rendement total	(8 640)	200
(165)	31 juill. 2023	Elisa Oyj, swap sur rendement total	(11 801)	102
(15)	31 juill. 2023	Encavis Ag, swap sur rendement total	(401)	28
(1 364)	31 juill. 2023	Endesa Sa, swap sur rendement total	(34 784)	172
(100)	31 juill. 2023	Enento Group Oyj, swap sur rendement total	(3 095)	97
(4)	31 juill. 2023	Energiekontor Ag, swap sur rendement total	(445)	59
(298)	31 juill. 2023	Engie, swap sur rendement total	(5 769)	481
(7)	31 juill. 2023	Eramet, swap sur rendement total	(849)	(17)
(83)	31 juill. 2023	Euronav Nv, swap sur rendement total	(1 883)	353
(55)	31 juill. 2023	Euronext Nv, swap sur rendement total	(5 501)	210
(60)	31 juill. 2023	Eutelsat Communications, swap sur rendement total	(604)	12
(121)	31 juill. 2023	Faes Farma Sa, swap sur rendement total	(614)	30
(13)	31 juill. 2023	Fagron, swap sur rendement total	(249)	(2)
(124)	31 juill. 2023	Fielmann Ag, swap sur rendement total	(6 638)	(388)
(47)	31 juill. 2023	Flow Traders, swap sur rendement total	(1 471)	37
(100)	31 juill. 2023	Flughafen Wien Ag, swap sur rendement total	(4 678)	99
(2 806)	31 juill. 2023	Fortum Oyj, swap sur rendement total	(64 274)	(2 515)
(430)	31 juill. 2023	Freenet Ag, swap sur rendement total	(12 697)	509
(130)	31 juill. 2023	Fresenius Medical Care Ag &, swap sur rendement total	(5 747)	(251)
(73)	31 juill. 2023	Galp Energia Sgps Sa, swap sur rendement total	(1 331)	(83)
(217)	31 juill. 2023	Gaztransport Et Techniga Sa, swap sur rendement total	(31 317)	6 160
(16)	31 juill. 2023	Gecina Sa, swap sur rendement total	(2 201)	(38)
(1 046)	31 juill. 2023	Glenveagh Properties Plc, swap sur rendement total	(1 280)	120
(199)	31 juill. 2023	Global Dominion Access Sa, swap sur rendement total	(1 032)	10
(337)	31 juill. 2023	Hamborner Reit Ag, swap sur rendement total	(3 280)	261
(13)	31 juill. 2023	Hamburger Hafen Und Logistik, swap sur rendement total	(224)	(5)
(201)	31 juill. 2023	Heineken Nv, swap sur rendement total	(25 543)	149
(198)	31 juill. 2023	Hella Gmbh & Co Kгаа, swap sur rendement total	(21 775)	1 213
(570)	31 juill. 2023	Hellofresh Se, swap sur rendement total	(16 922)	2 424
(30)	31 juill. 2023	Henkel Ag & Co Kгаа Vorzug, swap sur rendement total	(2 821)	178
(21)	31 juill. 2023	Hypoport Ag, swap sur rendement total	(2 958)	184
(57)	31 juill. 2023	Iberdrola Sa, swap sur rendement total	(901)	(11)
(145)	31 juill. 2023	Icade, swap sur rendement total	(8 438)	(158)
(1)	31 juill. 2023	Id Logistics Group, swap sur rendement total	(388)	(4)
(6)	31 juill. 2023	Interparfums Sa, swap sur rendement total	(482)	(14)
(65)	31 juill. 2023	Intertrust Nv, swap sur rendement total	(1 854)	15
(483)	31 juill. 2023	Irish Residential Properties, swap sur rendement total	(778)	5
(123)	31 juill. 2023	Jenoptik Ag, swap sur rendement total	(4 546)	163
(1 280)	31 juill. 2023	Just Eat Takeaway.Com Nv, swap sur rendement total	(36 557)	3 449
(198)	31 juill. 2023	K+S Ag, actions ord., swap sur rendement total	(5 261)	739
(178)	31 juill. 2023	Kaufman & Broad Sa, swap sur rendement total	(7 066)	(427)
(3)	31 juill. 2023	Kerry Group Plc, A, swap sur rendement total	(365)	9
(18)	31 juill. 2023	Kojamo Oyj, swap sur rendement total	(359)	13
(100)	31 juill. 2023	Korian, swap sur rendement total	(1 463)	(80)
(21)	31 juill. 2023	Kws Saat Se & Co Kгаа, swap sur rendement total	(1 947)	54
(40)	31 juill. 2023	Lagardere Sca, swap sur rendement total	(1 159)	(47)
(150)	31 juill. 2023	Lassila & Tikanoja Oyj, swap sur rendement total	(2 308)	50
(100)	31 juill. 2023	Lectra, swap sur rendement total	(5 090)	(188)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(353)	31 juill. 2023	Leg Immobilien Ag, swap sur rendement total	(31 067)	20
(54)	31 juill. 2023	Lenzing Ag, swap sur rendement total	(4 279)	810
(129)	31 juill. 2023	Lna Santé, swap sur rendement total	(5 522)	(659)
(373)	31 juill. 2023	Mephy Energy Sa, swap sur rendement total	(6 586)	736
(8)	31 juill. 2023	Melexis Nv, swap sur rendement total	(937)	21
(87)	31 juill. 2023	Mercedes-Benz Group Ag, swap sur rendement total	(7 725)	167
(324)	31 juill. 2023	Mercialys, swap sur rendement total	(4 578)	(274)
(126)	31 juill. 2023	Metrovacesa Sa, swap sur rendement total	(1 161)	153
(256)	31 juill. 2023	Michelin (Cgde), swap sur rendement total	(9 619)	253
(21)	31 juill. 2023	Miquel Y Costas, swap sur rendement total	(355)	(13)
(94)	31 juill. 2023	Montea, swap sur rendement total	(9 053)	(382)
(7)	31 juill. 2023	Mtu Aero Engines Ag, swap sur rendement total	(2 047)	(10)
(240)	31 juill. 2023	Nacon Sa, swap sur rendement total	(902)	(6)
(527)	31 juill. 2023	Neinor Homes Sa, swap sur rendement total	(6 234)	458
(51)	31 juill. 2023	Nexity, swap sur rendement total	(1 922)	(138)
(63)	31 juill. 2023	Nos Sgps, swap sur rendement total	(345)	6
(55)	31 juill. 2023	Oesterreichische Post Ag, swap sur rendement total	(2 338)	202
(188)	31 juill. 2023	Ohb Se, swap sur rendement total	(8 768)	690
(17)	31 juill. 2023	Omv Ag, swap sur rendement total	(1 182)	43
(100)	31 juill. 2023	Orange Belgium, swap sur rendement total	(2 493)	(28)
(27)	31 juill. 2023	Orange, swap sur rendement total	(362)	19
(487)	31 juill. 2023	Oriola Corp, B, swap sur rendement total	(1 225)	38
(8)	31 juill. 2023	Orpea, swap sur rendement total	(71)	10
(95)	31 juill. 2023	Palfinger Ag, swap sur rendement total	(3 249)	203
(3)	31 juill. 2023	Pernod Ricard Sa, swap sur rendement total	(797)	2
(111)	31 juill. 2023	Pharma Mar Sa, swap sur rendement total	(10 321)	717
(144)	31 juill. 2023	Plastic Omnium, swap sur rendement total	(2 828)	222
(36)	31 juill. 2023	Pne Ag, swap sur rendement total	(1 111)	33
(748)	31 juill. 2023	Prosegur Cash Sa, swap sur rendement total	(647)	15
(719)	31 juill. 2023	Prosiebensat. l Media Se, swap sur rendement total	(8 682)	324
(13)	31 juill. 2023	Publicis Groupe, swap sur rendement total	(1 117)	281
(17)	31 juill. 2023	Qiagen N.V., swap sur rendement total	(1 156)	6
(12)	31 juill. 2023	Qt Group Oyj, swap sur rendement total	(772)	13
(263)	31 juill. 2023	Randstad Nv, swap sur rendement total	(21 663)	(638)
(15)	31 juill. 2023	Rémy Cointreau, swap sur rendement total	(3 419)	26
(199)	31 juill. 2023	Renault Sa, swap sur rendement total	(9 000)	842
(1)	31 juill. 2023	Robertet Sa, swap sur rendement total	(1 210)	(15)
(72)	31 juill. 2023	Rtl Group, swap sur rendement total	(4 106)	16
(162)	31 juill. 2023	Rwe Ag, swap sur rendement total	(9 743)	109
(63)	31 juill. 2023	S.O.I.T.E.C., swap sur rendement total	(13 925)	118
(25)	31 juill. 2023	Sartorius Stedim Biotech, swap sur rendement total	(10 936)	766
(119)	31 juill. 2023	Seb Sa, swap sur rendement total	(13 465)	(479)
(7)	31 juill. 2023	Secunet Security Networks Ag, swap sur rendement total	(1 988)	232
(1 078)	31 juill. 2023	Ses, swap sur rendement total	(9 493)	759
(7)	31 juill. 2023	Shop Apotheke Europe Nv, swap sur rendement total	(447)	14
(2)	31 juill. 2023	Siemens Ag, actions ord., swap sur rendement total	(375)	5
(91)	31 juill. 2023	Sif Holding Nv, swap sur rendement total	(1 526)	(1)
(65)	31 juill. 2023	Signify Nv, swap sur rendement total	(2 950)	77
(180)	31 juill. 2023	Sligro Food Group Nv, swap sur rendement total	(4 227)	127
(55)	31 juill. 2023	Smurfit Kappa Group Plc, swap sur rendement total	(2 749)	32
(21)	31 juill. 2023	Software Ag, swap sur rendement total	(736)	6
(4 170)	31 juill. 2023	Solocal Group, swap sur rendement total	(3 678)	363
(33)	31 juill. 2023	Solvay Sa, swap sur rendement total	(4 508)	(15)
(2)	31 juill. 2023	Somfy Sa, swap sur rendement total	(414)	2
(2 068)	31 juill. 2023	Stellantis Nv, swap sur rendement total	(39 684)	2 136
(50)	31 juill. 2023	Stratec Se, swap sur rendement total	(5 864)	126
(18)	31 juill. 2023	Stroeer Se & Co Kga, swap sur rendement total	(1 134)	8
(456)	31 juill. 2023	Suominen Oyj, swap sur rendement total	(1 975)	78
(635)	31 juill. 2023	Tag Immobilien Ag, swap sur rendement total	(5 551)	(304)
(302)	31 juill. 2023	Talgo Sa, swap sur rendement total	(1 441)	(71)
(49)	31 juill. 2023	Technip Energies Nv, swap sur rendement total	(1 039)	27
(64)	31 juill. 2023	Tecnicas Reunidas Sa, swap sur rendement total	(844)	-
(745)	31 juill. 2023	Telefonica Deutschland Holdi, swap sur rendement total	(2 481)	(17)
(724)	31 juill. 2023	Télévision Française (T.F.1), swap sur rendement total	(7 491)	30
(88)	31 juill. 2023	Thales Sa, swap sur rendement total	(15 181)	379
(311)	31 juill. 2023	Tokmanni Group Corp, swap sur rendement total	(5 077)	825
(57)	31 juill. 2023	Totalenergies Se, swap sur rendement total	(4 834)	58
(72)	31 juill. 2023	Trigano Sa, swap sur rendement total	(13 285)	(810)
(9)	31 juill. 2023	Unibail-Rodamco-Westfield, swap sur rendement total	(633)	23
(44)	31 juill. 2023	United Internet Ag, actions ord., Share, swap sur rendement total	(1 202)	77

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(60)	31 juill. 2023	Universal Music Group Nv, swap sur rendement total	(1 953)	18
(23)	31 juill. 2023	Upm-Kymmene Oyj, swap sur rendement total	(1 162)	26
(23)	31 juill. 2023	Verallia, swap sur rendement total	(1 054)	(79)
(28)	31 juill. 2023	Verbio Vereinigte Bioenergi, swap sur rendement total	(2 454)	459
(7)	31 juill. 2023	Verbund Ag, swap sur rendement total	(796)	34
(1)	31 juill. 2023	Vib Vermoegen Ag, swap sur rendement total	(29)	(2)
(8)	31 juill. 2023	Vicat, swap sur rendement total	(271)	(6)
(150)	31 juill. 2023	Vilmorin & Cie, swap sur rendement total	(9 902)	710
(2 392)	31 juill. 2023	Vivendi, swap sur rendement total	(30 834)	(1 051)
(37)	31 juill. 2023	Votalia Sa, actions ord., swap sur rendement total	(913)	72
(79)	31 juill. 2023	Vopak, swap sur rendement total	(3 170)	61
(100)	31 juill. 2023	Vossloh Ag, swap sur rendement total	(5 654)	411
(2)	31 juill. 2023	Wacker Chemie Ag, swap sur rendement total	(345)	9
(204)	31 juill. 2023	Warehouses De Pauw Sca, swap sur rendement total	(7 876)	(281)
(110)	31 juill. 2023	Westwing Group Ag, swap sur rendement total	(1 527)	(209)
(387)	31 juill. 2023	Worldline Sa, swap sur rendement total	(20 443)	4 577
(58)	31 juill. 2023	Wuestenrot & Wuerttemberg, swap sur rendement total	(1 295)	(22)
(5)	31 juill. 2023	Zalando Se, swap sur rendement total	(239)	(24)
(135)	31 juill. 2023	Zeal Network Se, swap sur rendement total	(5 495)	(297)
				<u>55 208</u>
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
(24 000)	31 juill. 2023	Agricultural Bank Of China-H, swap sur rendement total	(11 166)	(385)
(4 000)	31 juill. 2023	Ak Medical Holdings Ltd, swap sur rendement total	(6 798)	(1 440)
(4 000)	31 juill. 2023	Anhui Conch Cement Co Ltd-H, swap sur rendement total	(18 957)	760
(2 400)	31 juill. 2023	Ascentage Pharma Group Inter, swap sur rendement total	(10 708)	(1 531)
(1 600)	31 juill. 2023	Asiainfo Technologies Ltd, swap sur rendement total	(3 822)	(873)
(1 300)	31 juill. 2023	Asm Pacific Technology, swap sur rendement total	(12 559)	441
(15 002)	31 juill. 2023	Avichina Industry & Tech, H, swap sur rendement total	(9 141)	423
(7 000)	31 juill. 2023	Bbmg Corp-H, swap sur rendement total	(1 227)	(20)
(1 000)	31 juill. 2023	Beijing Chunlizhengda Medi, H, swap sur rendement total	(2 771)	(287)
(12 000)	31 juill. 2023	Beijing Enterprises Water Gr, swap sur rendement total	(4 166)	161
(4 000)	31 juill. 2023	Beijing Tong Ren Tang Chines, swap sur rendement total	(7 958)	(934)
(498)	31 juill. 2023	Cansino Biologics Inc, H, swap sur rendement total	(5 771)	2 934
(2)	31 juill. 2023	Canvest Environmental Protec, swap sur rendement total	(1)	-
(2 000)	31 juill. 2023	Central China Real Estate, swap sur rendement total	(146)	(40)
(6 000)	31 juill. 2023	Central China Securities C-H, swap sur rendement total	(1 177)	47
(12 000)	31 juill. 2023	Cgn New Energy Holdings Co L, swap sur rendement total	(5 625)	61
(3 000)	31 juill. 2023	Cgn Power Co Ltd, H, swap sur rendement total	(969)	19
(1 000)	31 juill. 2023	Champion Reit, swap sur rendement total	(535)	(64)
(2 000)	31 juill. 2023	China Aircraft Leasing Group, swap sur rendement total	(1 503)	(16)
(4 000)	31 juill. 2023	China Aoyuan Group Ltd, swap sur rendement total	(819)	(11)
(1 000)	31 juill. 2023	China Citic Bank Corp Ltd-H, swap sur rendement total	(601)	2
(12 000)	31 juill. 2023	China Coal Energy Co, H, swap sur rendement total	(13 228)	1 738
(2 000)	31 juill. 2023	China Conch Venture Holdings, swap sur rendement total	(5 889)	292
(9 000)	31 juill. 2023	China Construction Bank, H, swap sur rendement total	(7 640)	(256)
(2 000)	31 juill. 2023	China Eastern Airlines Co-H, swap sur rendement total	(1 101)	(87)
(2 000)	31 juill. 2023	China Everbright Greentech L, swap sur rendement total	(733)	(175)
(14 000)	31 juill. 2023	China Everbright Intl Ltd, swap sur rendement total	(8 482)	224
(2 000)	31 juill. 2023	China Everbright Ltd, swap sur rendement total	(2 017)	(129)
(500)	31 juill. 2023	China Galaxy Securities Co, H, swap sur rendement total	(331)	5
(8 802)	31 juill. 2023	China Gas Holdings Ltd, swap sur rendement total	(17 358)	(2 164)
(1 000)	31 juill. 2023	China Harmony New Energy Aut, swap sur rendement total	(208)	(9)
(600)	31 juill. 2023	China International Marine-H, swap sur rendement total	(617)	15
(20 000)	31 juill. 2023	China Jinmao Holdings Group, swap sur rendement total	(5 833)	543
(2 000)	31 juill. 2023	China Lilang Ltd, swap sur rendement total	(1 305)	(20)
(4 000)	31 juill. 2023	China Longyuan Power Group, H, swap sur rendement total	(6 625)	9
(3 000)	31 juill. 2023	China Medical System Holding, swap sur rendement total	(6 395)	(477)
(3 000)	31 juill. 2023	China Modern Dairy Holdings, swap sur rendement total	(516)	2
(29 998)	31 juill. 2023	China Molybdenum Co Ltd, H, swap sur rendement total	(18 748)	116
(4 000)	31 juill. 2023	China National Building Ma, H, swap sur rendement total	(4 451)	329
(4 000)	31 juill. 2023	China Oilfield Services, H, swap sur rendement total	(6 590)	213
(11 895)	31 juill. 2023	China Petroleum & Chemical, H, swap sur rendement total	(7 785)	(172)
(4 000)	31 juill. 2023	China Power International, swap sur rendement total	(2 292)	(201)
(2 000)	31 juill. 2023	China Railway Group Ltd, H, swap sur rendement total	(1 430)	99
(500)	31 juill. 2023	China Renaissance Holdings L, swap sur rendement total	(705)	(43)
(16 000)	31 juill. 2023	China Resources Cement, swap sur rendement total	(11 499)	223
(700)	31 juill. 2023	China Resources Gas Group Lt, swap sur rendement total	(3 561)	(200)
(1 200)	31 juill. 2023	China Zhongwang Holdings Ltd, swap sur rendement total	(350)	1
(500)	31 juill. 2023	Chinese Estates Holdings Ltd, swap sur rendement total	(219)	(23)
(4 000)	31 juill. 2023	Comba Telecom Systems Holdin, swap sur rendement total	(931)	38

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(100 000)	31 juill. 2023	Cosco Shipping Development, H, swap sur rendement total	(18 055)	410
(4 000)	31 juill. 2023	Cosco Shipping Energy Tran, H, swap sur rendement total	(4 153)	652
(2 000)	31 juill. 2023	Cosco Shipping International, swap sur rendement total	(875)	81
(3 000)	31 juill. 2023	Cpmc Holdings Ltd, swap sur rendement total	(2 198)	70
(6 000)	31 juill. 2023	Dali Foods Group Co Ltd, swap sur rendement total	(3 708)	149
(4 000)	31 juill. 2023	Dynagreen Environmental Pr, H, swap sur rendement total	(1 750)	13
(29 958)	31 juill. 2023	Esprit Holdings Ltd, swap sur rendement total	(4 369)	(455)
(1 176)	31 juill. 2023	Esr Cayman Ltd, swap sur rendement total	(3 344)	267
(2 100)	31 juill. 2023	Far East Consortium Internat, swap sur rendement total	(696)	(19)
(2 000)	31 juill. 2023	Flat Glass Group Co Ltd, H, swap sur rendement total	(6 555)	379
(6 000)	31 juill. 2023	Fu Shou Yuan International, swap sur rendement total	(6 979)	(1 028)
(200)	31 juill. 2023	Gf Securities Co Ltd, H, swap sur rendement total	(390)	5
(3 000)	31 juill. 2023	Greatview Aseptic Packaging, swap sur rendement total	(760)	(107)
(1 000)	31 juill. 2023	Greenland Hong Kong Holdings, swap sur rendement total	(130)	17
(14 000)	31 juill. 2023	Guangdong Investment Ltd, swap sur rendement total	(19 419)	(1 931)
(6 000)	31 juill. 2023	Guotai Junan International, swap sur rendement total	(750)	(50)
(5 718)	31 juill. 2023	Haidilao International Holdi, swap sur rendement total	(22 235)	(3 989)
(4 880)	31 juill. 2023	Haitong Securities Co Ltd, H, swap sur rendement total	(4 066)	14
(2 000)	31 juill. 2023	Hansoh Pharmaceutical Group, swap sur rendement total	(5 152)	(10)
(500)	31 juill. 2023	Health And Happiness H&H Int, swap sur rendement total	(1 446)	(625)
(4 500)	31 juill. 2023	Hengan Intl Group Co Ltd, swap sur rendement total	(32 381)	(4 180)
(15 000)	31 juill. 2023	Hkbn Ltd, swap sur rendement total	(13 619)	(19)
(7 014)	31 juill. 2023	Hong Kong & China Gas, swap sur rendement total	(9 035)	(922)
(4 000)	31 juill. 2023	Hong Kong Television Network, swap sur rendement total	(3 729)	306
(88)	31 juill. 2023	Hopson Development Holdings, swap sur rendement total	(117)	(66)
(4 020)	31 juill. 2023	Huaneng Power Intl Inc, H, swap sur rendement total	(2 575)	(54)
(700)	31 juill. 2023	Imax China Holding Inc, swap sur rendement total	(857)	(137)
(5 000)	31 juill. 2023	Ind & Comm Bk Of China, H, swap sur rendement total	(3 489)	(84)
(6 147)	31 juill. 2023	Jiangsu Express Co Ltd, H, swap sur rendement total	(7 609)	(74)
(3 000)	31 juill. 2023	Jinchuan Group International, swap sur rendement total	(292)	17
(500)	31 juill. 2023	Johnson Electric Holdings, swap sur rendement total	(868)	(20)
(4 000)	31 juill. 2023	Joy City Property Ltd, swap sur rendement total	(222)	(41)
(4 000)	31 juill. 2023	Js Global Lifestyle Co Ltd, swap sur rendement total	(6 090)	(49)
(1 000)	31 juill. 2023	Kerry Logistics Network Ltd, swap sur rendement total	(2 437)	(33)
(3 500)	31 juill. 2023	Kerry Properties Ltd, swap sur rendement total	(10 329)	(1 257)
(1 000)	31 juill. 2023	Kowloon Development Co Ltd, swap sur rendement total	(1 328)	(65)
(16 168)	31 juill. 2023	Kwg Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	(5 221)	(205)
(1 800)	31 juill. 2023	Livzon Pharmaceutical Grou, H, swap sur rendement total	(8 203)	333
(750)	31 juill. 2023	L'Occitane International Sa, swap sur rendement total	(3 170)	(329)
(2 000)	31 juill. 2023	Luoyang Glass Company Ltd, H, swap sur rendement total	(2 847)	423
(9 000)	31 juill. 2023	Luye Pharma Group Ltd, swap sur rendement total	(5 718)	(934)
(1 200)	31 juill. 2023	Maoyan Entertainment, swap sur rendement total	(1 877)	(315)
(5 000)	31 juill. 2023	Nine Dragons Paper Holdings, swap sur rendement total	(6 198)	(806)
(8 000)	31 juill. 2023	Nissin Foods Co Ltd, swap sur rendement total	(9 291)	(244)
(11 000)	31 juill. 2023	Pccw Ltd, swap sur rendement total	(6 722)	(207)
(12 002)	31 juill. 2023	Petrochina Co Ltd, H, swap sur rendement total	(7 438)	(37)
(1 050)	31 juill. 2023	Pharmaron Beijing Co Ltd, H, swap sur rendement total	(9 871)	(1 749)
(11 000)	31 juill. 2023	Pou Sheng Intl Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 432)	(397)
(1 000)	31 juill. 2023	Prosperity Reit, swap sur rendement total	(345)	(44)
(3 000)	31 juill. 2023	Q Technology Group Co Ltd, swap sur rendement total	(2 193)	(102)
(4 000)	31 juill. 2023	Redco Properties Group Ltd, swap sur rendement total	(1 118)	73
(2 000)	31 juill. 2023	Regal International Airport, swap sur rendement total	(8 246)	(843)
(4 000)	31 juill. 2023	Ronshine China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(778)	(254)
(10 000)	31 juill. 2023	Sands China Ltd, swap sur rendement total	(44 963)	(6 526)
(1 000)	31 juill. 2023	Sany Heavy Equipment Intl, swap sur rendement total	(1 392)	55
(4 000)	31 juill. 2023	S-Enjoy Service Group Co Ltd, swap sur rendement total	(6 389)	(431)
(5 200)	31 juill. 2023	Shandong Weigao Gp Medical, H, swap sur rendement total	(11 573)	(1 301)
(2 000)	31 juill. 2023	Shanghai Electric Grp Co L, H, swap sur rendement total	(611)	26
(300)	31 juill. 2023	Shanghai Henlius Biotech I, H, swap sur rendement total	(667)	(24)
(4 000)	31 juill. 2023	Shanghai Industrial Urban De, swap sur rendement total	(458)	(92)
(7 500)	31 juill. 2023	Shenzhen Intl Holdings, swap sur rendement total	(9 973)	(593)
(2 000)	31 juill. 2023	Shougang Fushan Resources Gr, swap sur rendement total	(865)	49
(58 500)	31 juill. 2023	Shui On Land Ltd, swap sur rendement total	(10 054)	(577)
(2 000)	31 juill. 2023	Sichuan Expressway Co, H, swap sur rendement total	(632)	20
(4 000)	31 juill. 2023	Sihuan Pharmaceutical Hldgs, swap sur rendement total	(660)	(60)
(4 000)	31 juill. 2023	Sino Land Co, swap sur rendement total	(6 777)	(12)
(1 500)	31 juill. 2023	Sino-Ocean Group Holding Ltd, swap sur rendement total	(284)	(25)
(2 000)	31 juill. 2023	Sinopec Kantons Holdings, swap sur rendement total	(1 024)	(101)
(2 000)	31 juill. 2023	Sinopec Oilfield Service, H, swap sur rendement total	(177)	3
(7 551)	31 juill. 2023	Sinopharm Group Co, H, swap sur rendement total	(26 007)	(1 740)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(2 500)	31 juill. 2023	Smartone Telecommunications, swap sur rendement total	(2 044)	(319)
(5 500)	31 juill. 2023	Soho China Ltd, swap sur rendement total	(1 308)	(34)
(2 000)	31 juill. 2023	Sun King Technology Group Ltd, swap sur rendement total	(562)	23
(2 000)	31 juill. 2023	Sunlight Real Estate Invest, swap sur rendement total	(1 170)	(128)
(646)	31 juill. 2023	Super Hi International Holdi, swap sur rendement total	-	-
(2 000)	31 juill. 2023	Tong Ren Tang Technologies, H, swap sur rendement total	(1 962)	(164)
(2 000)	31 juill. 2023	Travelsky Technology Ltd, H, swap sur rendement total	(5 729)	(259)
(6 000)	31 juill. 2023	United Energy Group Ltd, swap sur rendement total	(802)	(48)
(3 000)	31 juill. 2023	Value Partners Group Ltd, swap sur rendement total	(1 500)	(277)
(3 500)	31 juill. 2023	Venus Medtech Hangzhou Inc, H, swap sur rendement total	(8 664)	(873)
(4 000)	31 juill. 2023	Vitasoy Intl Holdings Ltd, swap sur rendement total	(11 152)	(1 244)
(22 000)	31 juill. 2023	Viva Biotech Holdings, swap sur rendement total	(6 684)	(284)
(3 000)	31 juill. 2023	Vobile Group Ltd, swap sur rendement total	(1 750)	63
(200)	31 juill. 2023	Vtech Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 746)	(20)
(7 000)	31 juill. 2023	Want Want China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(6 357)	101
(32 000)	31 juill. 2023	We Solutions Ltd, swap sur rendement total	(1 339)	361
(1 000)	31 juill. 2023	Weichai Power Co Ltd, H, swap sur rendement total	(1 819)	(21)
(2 000)	31 juill. 2023	Wharf Holdings Ltd, swap sur rendement total	(7 968)	(614)
(12 400)	31 juill. 2023	Wynn Macau Ltd, swap sur rendement total	(18 728)	(5 854)
(2 500)	31 juill. 2023	Xiabuxiabu Catering Managem, swap sur rendement total	(3 854)	(542)
(1 400)	31 juill. 2023	Xinjiang Goldwind Sci&Tec, H, swap sur rendement total	(1 689)	355
(2 000)	31 juill. 2023	Xinyi Solar Holdings Ltd, swap sur rendement total	(3 000)	139
(6 200)	31 juill. 2023	Yichang Hec Changjiang Pha, H, swap sur rendement total	(6 996)	(106)
(8 092)	31 juill. 2023	Yuexiu Real Estate Investmen, swap sur rendement total	(2 767)	(89)
(8 000)	31 juill. 2023	Yuexiu Transport Infrastruct, swap sur rendement total	(5 902)	(815)
(499)	31 juill. 2023	Zhaojin Mining Industry, H, swap sur rendement total	(752)	(10)
(8 006)	31 juill. 2023	Zhejiang Expressway Co, H, swap sur rendement total	(8 353)	(257)
(2 000)	31 juill. 2023	Zhuguang Holdings Group Co, swap sur rendement total	(312)	(83)
(2 900)	31 juill. 2023	Zhuzhou Crcr Times Electri, H, swap sur rendement total	(19 508)	(1 370)
(34 724)	31 juill. 2023	Zoomlion Heavy Industry, H, swap sur rendement total	(22 244)	(285)
				(43 317)
Yen japonais – taux moyen du financement à un jour offert à Tokyo (TONAR)				
(100)	31 juill. 2023	Broadleaf Co Ltd, swap sur rendement total	(451)	-
(100)	31 juill. 2023	Canon Inc, swap sur rendement total	(2 932)	356
(100)	31 juill. 2023	Change Inc, swap sur rendement total	(2 235)	5
(100)	31 juill. 2023	Daiwa Industries Ltd, swap sur rendement total	(1 157)	101
(600)	31 juill. 2023	Gree Inc, swap sur rendement total	(4 288)	443
(100)	31 juill. 2023	Hankyu Hanshin Holdings Inc, swap sur rendement total	(4 025)	379
(400)	31 juill. 2023	Hoosiers Holdings, swap sur rendement total	(3 056)	218
(100)	31 juill. 2023	Itoham Yonekyu Holdings Inc, swap sur rendement total	(720)	(18)
(100)	31 juill. 2023	Kokuyo Co Ltd, swap sur rendement total	(1 908)	(53)
(100)	31 juill. 2023	Max Co Ltd, swap sur rendement total	(2 002)	112
(300)	31 juill. 2023	Mebuki Financial Group Inc, swap sur rendement total	(1 029)	(72)
(200)	31 juill. 2023	Midac Co Ltd, swap sur rendement total	(5 278)	1 603
(400)	31 juill. 2023	Mito Securities Co Ltd, swap sur rendement total	(875)	53
(700)	31 juill. 2023	Mitsubishi Motors Corp, swap sur rendement total	(3 666)	862
(100)	31 juill. 2023	Mugen Estate Co Ltd, swap sur rendement total	(501)	1
(100)	31 juill. 2023	Nichiha Corp, swap sur rendement total	(2 727)	171
(100)	31 juill. 2023	Nihon House Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(374)	18
(600)	31 juill. 2023	Olympus Corp, swap sur rendement total	(14 492)	2 796
(100)	31 juill. 2023	Renova Inc, swap sur rendement total	(2 422)	328
(100)	31 juill. 2023	Round One Corp, swap sur rendement total	(493)	133
(3)	31 juill. 2023	Sankei Real Estate Inc, swap sur rendement total	(2 745)	123
(200)	31 juill. 2023	Sanwa Holdings Corp, swap sur rendement total	(2 508)	141
(400)	31 juill. 2023	Takara Standard Co Ltd, swap sur rendement total	(5 681)	(241)
(100)	31 juill. 2023	Toa Corp, swap sur rendement total	(791)	(5)
(100)	31 juill. 2023	Trust Tech Inc, swap sur rendement total	(1 747)	221
(100)	31 juill. 2023	Vt Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(485)	37
(200)	31 juill. 2023	Zenrin Co Ltd, swap sur rendement total	(1 698)	67
				7 779
Dollar néo-zélandais – taux du marché des acceptations bancaires (BKBM) à 1 mois				
(396)	31 juill. 2023	Fisher & Paykel Healthcare C, swap sur rendement total	(7 669)	371
(208)	31 juill. 2023	Freightways Ltd, swap sur rendement total	(1 722)	59
(1 678)	31 juill. 2023	Kiwi Property Group Ltd, swap sur rendement total	(1 309)	33
(1 295)	31 juill. 2023	Meridian Energy Ltd, swap sur rendement total	(5 815)	(361)
(7 873)	31 juill. 2023	Pacific Edge Ltd, swap sur rendement total	(3 373)	(259)
(2 580)	31 juill. 2023	Precinct Properties New Zeal, swap sur rendement total	(2 797)	43
(418)	31 juill. 2023	Serko Ltd, swap sur rendement total	(806)	61
(1 387)	31 juill. 2023	Stride Property Group, swap sur rendement total	(1 688)	88
(32)	31 juill. 2023	Warehouse Group Limited/The, swap sur rendement total	(71)	9

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
				44
Dollar de Singapour – taux interbancaire offert à Singapour (SIBOR) à 1 mois				
(9 400)	31 juill. 2023	Capitaland Ascott Trust, swap sur rendement total	(9 971)	(902)
(900)	31 juill. 2023	Capitaland India Trust, swap sur rendement total	(1 018)	(42)
(300)	31 juill. 2023	Capitaland Integrated Commerce, swap sur rendement total	(618)	11
(4 500)	31 juill. 2023	Comfortdelgro Corp Ltd, swap sur rendement total	(5 592)	19
(1 500)	31 juill. 2023	Esr-Reit, swap sur rendement total	(561)	(33)
(2 700)	31 juill. 2023	Far East Hospitality Trust, swap sur rendement total	(1 691)	9
(3 400)	31 juill. 2023	First Real Estate Invst Trust, swap sur rendement total	(893)	(66)
(4 823)	31 juill. 2023	Frasers Hospitality Trust, swap sur rendement total	(2 168)	5
(301)	31 juill. 2023	Frasers Property Ltd, swap sur rendement total	(283)	(1)
(700)	31 juill. 2023	Keppel Infrastructure Trust, swap sur rendement total	(382)	1
(2 400)	31 juill. 2023	Lippo Malls Indonesia Retail, swap sur rendement total	(73)	–
(900)	31 juill. 2023	Q & M Dental Group Singapore, swap sur rendement total	(286)	10
(500)	31 juill. 2023	Sats Ltd, swap sur rendement total	(1 435)	(47)
(1 200)	31 juill. 2023	Singapore Airlines Ltd, swap sur rendement total	(6 704)	288
(100)	31 juill. 2023	Singapore Tech Engineering, swap sur rendement total	(338)	10
(1 900)	31 juill. 2023	Suntec Reit, swap sur rendement total	(2 649)	27
(600)	31 juill. 2023	Thai Beverage Pcl, swap sur rendement total	(415)	(29)
(100)	31 juill. 2023	Wilmar International Ltd, swap sur rendement total	(421)	(3)
				(743)
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
(94)	31 juill. 2023	African Rainbow Minerals Ltd, swap sur rendement total	(2 156)	18
(548)	31 juill. 2023	Alexander Forbes Group Holdi, swap sur rendement total	(229)	(23)
(3 223)	31 juill. 2023	Attacq Ltd, swap sur rendement total	(1 925)	45
(949)	31 juill. 2023	Blue Label Telecoms Ltd, swap sur rendement total	(369)	22
(6 958)	31 juill. 2023	Fortress Reit Ltd, A, swap sur rendement total	(5 823)	348
(19 669)	31 juill. 2023	Growthpoint Properties Ltd, swap sur rendement total	(22 774)	(422)
(574)	31 juill. 2023	Hyprop Investments Ltd, swap sur rendement total	(1 538)	40
(993)	31 juill. 2023	Kap Industrial Holdings Ltd, swap sur rendement total	(351)	4
(20)	31 juill. 2023	Kumba Iron Ore Ltd, swap sur rendement total	(784)	(20)
(1 005)	31 juill. 2023	Massmart Holdings Ltd, swap sur rendement total	(4 952)	(27)
(152)	31 juill. 2023	Naspers Ltd, actions, N, swap sur rendement total	(34 186)	(1 798)
(451)	31 juill. 2023	Oceana Group Ltd, swap sur rendement total	(2 273)	(109)
(693)	31 juill. 2023	Pepkor Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 104)	100
(1 866)	31 juill. 2023	Ppc Ltd, swap sur rendement total	(324)	69
(1 349)	31 juill. 2023	Redefine Properties Ltd, swap sur rendement total	(454)	(19)
(1 018)	31 juill. 2023	Resilient Reit Ltd, swap sur rendement total	(4 357)	(15)
(78)	31 juill. 2023	Royal Bafokeng Platinum Ltd, swap sur rendement total	(1 024)	18
(117)	31 juill. 2023	Sanlam Ltd, swap sur rendement total	(454)	39
(91)	31 juill. 2023	Standard Bank Group Ltd, swap sur rendement total	(1 216)	51
(1 785)	31 juill. 2023	Telkom Sa Soc Ltd, swap sur rendement total	(4 267)	609
(1 064)	31 juill. 2023	Truworths International Ltd, swap sur rendement total	(4 660)	176
(88)	31 juill. 2023	Vodacom Group Ltd, swap sur rendement total	(860)	31
(100)	31 juill. 2023	Wilson Bayly Holmes-Ovcon, swap sur rendement total	(706)	48
				(815)
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
(18)	31 juill. 2023	Aak Ab, swap sur rendement total	(416)	(9)
(107)	31 juill. 2023	Academedi Ab, swap sur rendement total	(621)	(8)
(51)	31 juill. 2023	Addlife Ab, B, swap sur rendement total	(720)	(4)
(83)	31 juill. 2023	Afry Ab, swap sur rendement total	(1 845)	19
(33)	31 juill. 2023	Bactiguard Holding Ab, swap sur rendement total	(474)	–
(167)	31 juill. 2023	Boliden Ab, swap sur rendement total	(8 497)	102
(441)	31 juill. 2023	Bonava Ab, actions, B, swap sur rendement total	(1 687)	(85)
(38)	31 juill. 2023	Bufab Ab, swap sur rendement total	(1 156)	(18)
(32)	31 juill. 2023	Bulten Ab, swap sur rendement total	(248)	34
(1 399)	31 juill. 2023	Bygghemma Group First Ab, swap sur rendement total	(3 378)	361
(266)	31 juill. 2023	Castellum Ab, swap sur rendement total	(4 433)	(17)
(116)	31 juill. 2023	Catena Ab, swap sur rendement total	(5 862)	(330)
(118)	31 juill. 2023	Cellavision Ab, swap sur rendement total	(3 514)	(101)
(91)	31 juill. 2023	Dometic Group Ab, swap sur rendement total	(796)	42
(142)	31 juill. 2023	Duni Ab, swap sur rendement total	(1 592)	226
(572)	31 juill. 2023	Embracer Group Ab, swap sur rendement total	(3 518)	46
(12)	31 juill. 2023	Eolus Vind Ab, actions, B, swap sur rendement total	(165)	35
(54)	31 juill. 2023	Ericsson Lm, actions, B, swap sur rendement total	(428)	42
(145)	31 juill. 2023	Fabege Ab, swap sur rendement total	(1 673)	(27)
(42)	31 juill. 2023	Fastighets Ab Balder, actions B, swap sur rendement total	(265)	(11)
(227)	31 juill. 2023	Granges Ab, swap sur rendement total	(2 518)	(19)
(22)	31 juill. 2023	Hexagon Ab, actions, B, swap sur rendement total	(312)	37

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(50)	31 juill. 2023	Holmen Ab, actions, B, swap sur rendement total	(2 691)	111
(438)	31 juill. 2023	Husqvarna Ab, actions, B, swap sur rendement total	(4 165)	291
(102)	31 juill. 2023	Jm Ab, swap sur rendement total	(2 283)	(36)
(46)	31 juill. 2023	Kambi Group Plc, swap sur rendement total	(1 135)	19
(336)	31 juill. 2023	K-Fast Holding Ab, swap sur rendement total	(1 029)	(81)
(147)	31 juill. 2023	Mekonomen Ab, swap sur rendement total	(2 152)	70
(62)	31 juill. 2023	Ncc Ab, actions, B, swap sur rendement total	(784)	30
(581)	31 juill. 2023	Nolato Ab, actions, B, swap sur rendement total	(4 129)	79
(12)	31 juill. 2023	Nordea Bank Abp, swap sur rendement total	(174)	(7)
(79)	31 juill. 2023	Nyfosa Ab, swap sur rendement total	(838)	(63)
(582)	31 juill. 2023	Pandox Ab, swap sur rendement total	(8 810)	1 086
(221)	31 juill. 2023	Peab Ab, cat. B, swap sur rendement total	(1 698)	30
(50)	31 juill. 2023	Platzer Fastigheter Hold, B, swap sur rendement total	(535)	(24)
(385)	31 juill. 2023	Powercell Sweden Ab, swap sur rendement total	(5 960)	289
(759)	31 juill. 2023	Pricer Ab, actions, B, swap sur rendement total	(1 615)	110
(538)	31 juill. 2023	Rvrc Holding Ab, swap sur rendement total	(2 486)	108
(23)	31 juill. 2023	Saab Ab, B, swap sur rendement total	(1 228)	33
(241)	31 juill. 2023	Sectra Ab, actions, B, swap sur rendement total	(4 663)	23
(1 313)	31 juill. 2023	Sinch Ab, swap sur rendement total	(6 527)	(678)
(1 065)	31 juill. 2023	Ssab Ab, actions, B, swap sur rendement total	(7 506)	591
(2 113)	31 juill. 2023	Stillfront Group Ab, swap sur rendement total	(4 814)	(382)
(137)	31 juill. 2023	Storytel Ab, swap sur rendement total	(788)	(25)
(966)	31 juill. 2023	Svenska Handelsbanken, actions, A, swap sur rendement total	(13 203)	740
(57)	31 juill. 2023	Sweco Ab, actions, B, swap sur rendement total	(740)	15
(100)	31 juill. 2023	Viaplay Group Ab, B, swap sur rendement total	(2 575)	158
(98)	31 juill. 2023	Vitrolife Ab, swap sur rendement total	(2 373)	(2)
(933)	31 juill. 2023	Wallenstam Ab, actions, B, swap sur rendement total	(5 326)	(303)
				<u>2 497</u>
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
(1 176)	31 juill. 2023	Adecco Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(52 460)	2 414
(11)	31 juill. 2023	Also Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(2 726)	52
(24)	31 juill. 2023	Autoneum Holding Ag, swap sur rendement total	(3 585)	423
(37)	31 juill. 2023	Baloise Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(7 732)	(22)
(29)	31 juill. 2023	Basilea Pharmaceutica, actions ord., swap sur rendement total	(1 945)	122
(233)	31 juill. 2023	Cie Financiere Richemont, actions ord., swap sur rendement total	(40 913)	1 416
(53)	31 juill. 2023	Clariant Ag, actions ord., swap sur rendement total	(1 137)	43
(54)	31 juill. 2023	Coltene Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(6 026)	(93)
(22)	31 juill. 2023	Dormakaba Holding Ag, swap sur rendement total	(10 906)	(157)
(1 196)	31 juill. 2023	Evolva Holding Sa, swap sur rendement total	(144)	(6)
(33)	31 juill. 2023	Geberit Ag, actions ord., swap sur rendement total	(21 047)	950
(23)	31 juill. 2023	Gurit Holding Ag, Br, swap sur rendement total	(3 032)	217
(14)	31 juill. 2023	Julius Baer Group Ltd, swap sur rendement total	(1 104)	1
(201)	31 juill. 2023	Kuehne + Nagel Intl Ag, actions ord., swap sur rendement total	(63 347)	3 969
(110)	31 juill. 2023	Logitech International, actions ord., swap sur rendement total	(9 192)	(116)
(2)	31 juill. 2023	Lonza Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(1 327)	(29)
(1 066)	31 juill. 2023	Meyer Burger Technology Ag, swap sur rendement total	(92)	(92)
(3 441)	31 juill. 2023	Meyer Burger Technology Ag, swap sur rendement total	(2 699)	(156)
(3)	31 juill. 2023	Mobimo Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(1 037)	(25)
(56)	31 juill. 2023	Schindler Holding, Part Cert, swap sur rendement total	(14 262)	281
(9)	31 juill. 2023	Sgs Sa- actions ord., swap sur rendement total	(28 338)	660
(68)	31 juill. 2023	Sig Combibloc Group Ag, swap sur rendement total	(2 012)	51
(158)	31 juill. 2023	Sika Ag, actions ord., swap sur rendement total	(51 299)	3 560
(46)	31 juill. 2023	Softwareone Holding Ag, swap sur rendement total	(883)	63
(61)	31 juill. 2023	Straumann Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(9 434)	182
(5)	31 juill. 2023	Swatch Group Ag/The, Br, swap sur rendement total	(1 926)	(96)
(8)	31 juill. 2023	Temenos Ag, actions ord., swap sur rendement total	(594)	64
(8)	31 juill. 2023	Vat Group Ag, swap sur rendement total	(2 962)	199
				<u>13 875</u>
Dollar américain – taux interbancaire offert à Londres (ICE LIBOR) à 1 mois				
(135)	31 juill. 2023	Ace Technologies Corp, swap sur rendement total	(971)	(251)
(1 800)	31 juill. 2023	Aes Brasil Energia Sa, swap sur rendement total	(4 457)	352
(700)	31 juill. 2023	Alupar Investimento Sa, parts, swap sur rendement total	(5 067)	(147)
(2 900)	31 juill. 2023	Americanas Sa, swap sur rendement total	(7 173)	654
(1 000)	31 juill. 2023	Ampacs Corporation, swap sur rendement total	(1 585)	4
(220)	31 juill. 2023	Ananti Inc, swap sur rendement total	(1 580)	(133)
(2 200)	31 juill. 2023	Auren Energia Sa - On, swap sur rendement total	(8 306)	(423)
(500)	31 juill. 2023	Banco Pan Sa, swap sur rendement total	(810)	114
(200)	31 juill. 2023	Becle Sab De Cv, swap sur rendement total	(589)	2
(197)	31 juill. 2023	Boryung Pharmaceutical Co, swap sur rendement total	(1 919)	245

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(491)	31 juill. 2023	Bukwang Pharmaceutical Co, swap sur rendement total	(4 619)	(588)
(26)	31 juill. 2023	Cafe24 Corp, swap sur rendement total	(276)	65
(600)	31 juill. 2023	Calin Technology Co Ltd, swap sur rendement total	(995)	53
(1 400)	31 juill. 2023	Camil Alimentos Sa, swap sur rendement total	(2 971)	317
(100)	31 juill. 2023	Ccr Sa, swap sur rendement total	(277)	64
(724)	31 juill. 2023	Celltrion Healthcare Co Ltd, swap sur rendement total	(45 142)	1 354
(78)	31 juill. 2023	Celltrion Inc, swap sur rendement total	(13 458)	(13)
(475)	31 juill. 2023	Celltrion Pharm Inc, swap sur rendement total	(34 162)	(3 312)
(1 000)	31 juill. 2023	Century Iron & Steel Indus, swap sur rendement total	(3 906)	(162)
(1 000)	31 juill. 2023	Channel Well Technology Co, swap sur rendement total	(1 241)	(30)
(1 000)	31 juill. 2023	China Metal Products Co Ltd, swap sur rendement total	(1 265)	44
(33 000)	31 juill. 2023	China Petrochemical Dev Corp, swap sur rendement total	(14 374)	729
(1 000)	31 juill. 2023	China Steel Corp, swap sur rendement total	(1 314)	(29)
(1 000)	31 juill. 2023	Ching Feng Home Fashions Co, swap sur rendement total	(772)	9
(1 000)	31 juill. 2023	Chin-Poon Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	(1 268)	117
(35)	31 juill. 2023	Chong Kun Dang Pharma, swap sur rendement total	(3 089)	(85)
(45 000)	31 juill. 2023	Chun Yuan Steel Industry Co, swap sur rendement total	(31 644)	(235)
(300)	31 juill. 2023	Cia Brasileira De Distribuic, swap sur rendement total	(1 270)	331
(2 600)	31 juill. 2023	Cia De Transmissao De Ene, actions priv., swap sur rendement total	(15 328)	139
(9 200)	31 juill. 2023	Cielo Sa, swap sur rendement total	(12 566)	(1 325)
(3)	31 juill. 2023	Cj Cheiljedang Corp, swap sur rendement total	(1 227)	(31)
(1 000)	31 juill. 2023	Clevo Company, swap sur rendement total	(1 349)	57
(3 900)	31 juill. 2023	Cogna Educacional Sa, swap sur rendement total	(2 119)	123
(2 000)	31 juill. 2023	Concord Securities Co Ltd, swap sur rendement total	(854)	37
(1 700)	31 juill. 2023	Construtora Tenda Sa, swap sur rendement total	(1 839)	88
(6 700)	31 juill. 2023	Cosan Sa Industria Comercio, swap sur rendement total	(29 401)	2 079
(900)	31 juill. 2023	Cpfl Energia Sa, swap sur rendement total	(7 659)	449
(244)	31 juill. 2023	Crystalgenomics Inc, swap sur rendement total	(918)	(20)
(66)	31 juill. 2023	Cuckoo Homesys Co Ltd, swap sur rendement total	(2 086)	85
(100)	31 juill. 2023	Cvc Brasil Operadora E Agenc, swap sur rendement total	(115)	15
(2 150)	31 juill. 2023	Cyrela Brazil Realty Sa Emp, swap sur rendement total	(7 203)	730
(110)	31 juill. 2023	Dairy Farm Intl Hldgs Ltd, swap sur rendement total	(437)	(54)
(11 060)	31 juill. 2023	Da-Li Development Co Ltd, swap sur rendement total	(14 433)	(282)
(200)	31 juill. 2023	Dimed Sa Distribuidora De Me, swap sur rendement total	(523)	18
(8)	31 juill. 2023	DI Co Ltd, swap sur rendement total	(509)	57
(77)	31 juill. 2023	Doosan Fuel Cell Co Ltd, swap sur rendement total	(2 430)	190
(100)	31 juill. 2023	Duk San Neolux Co Ltd, swap sur rendement total	(4 203)	(157)
(1 000)	31 juill. 2023	Dyaco International Inc, swap sur rendement total	(1 794)	(37)
(7)	31 juill. 2023	Ecopro Bm Co Ltd, swap sur rendement total	(693)	113
(500)	31 juill. 2023	Engie Brasil Energia Sa, swap sur rendement total	(4 855)	139
(8 000)	31 juill. 2023	Ennostar Inc, swap sur rendement total	(15 783)	793
(163)	31 juill. 2023	Eo Technics Co Ltd, swap sur rendement total	(11 670)	115
(2 400)	31 juill. 2023	Even Construtora E Inco Sa, swap sur rendement total	(2 910)	371
(1 600)	31 juill. 2023	Ez Tec Empreendimentos E Par, swap sur rendement total	(5 508)	676
(200)	31 juill. 2023	Fibra Uno Administracion Sa, swap sur rendement total	(319)	17
(122)	31 juill. 2023	Fila Korea Ltd, swap sur rendement total	(4 361)	(253)
(1 000)	31 juill. 2023	First Steamship, swap sur rendement total	(385)	(4)
(2 000)	31 juill. 2023	Formosa Petrochemical Corp, swap sur rendement total	(7 080)	348
(4 120)	31 juill. 2023	Fulltech Fiber Glass Corp, swap sur rendement total	(2 116)	172
(1 000)	31 juill. 2023	Gaec Educacao Sa, swap sur rendement total	(989)	152
(204)	31 juill. 2023	Genexine Co Ltd, swap sur rendement total	(4 101)	252
(53)	31 juill. 2023	Green Cross Corp, swap sur rendement total	(7 378)	(325)
(214)	31 juill. 2023	Green Cross Holdings Corp, swap sur rendement total	(3 911)	(141)
(3)	31 juill. 2023	Green Cross Labcell Corp, swap sur rendement total	(152)	(7)
(300)	31 juill. 2023	Grupo Carso Sab De Cv, série A1, swap sur rendement total	(1 706)	58
(600)	31 juill. 2023	Grupo Cementos Chihuahua, swap sur rendement total	(5 441)	441
(2 500)	31 juill. 2023	Grupo De Moda Soma Sa, swap sur rendement total	(6 498)	280
(7 100)	31 juill. 2023	Grupo Mexico Sab De Cv, série B, swap sur rendement total	(33 779)	5 592
(1 600)	31 juill. 2023	Grupo Traxion Sab De Cv, swap sur rendement total	(3 001)	150
(100)	31 juill. 2023	Guararapes Confeccoes Sa, swap sur rendement total	(167)	11
(75)	31 juill. 2023	Hanall Biopharma Co Ltd, swap sur rendement total	(1 435)	(339)
(43)	31 juill. 2023	Hanon Systems, swap sur rendement total	(374)	7
(27)	31 juill. 2023	Hansae Co Ltd, swap sur rendement total	(447)	21
(143)	31 juill. 2023	Hanssem Co Ltd, swap sur rendement total	(6 856)	11
(38 300)	31 juill. 2023	Hapvida Participacoes E Inve, swap sur rendement total	(49 870)	1 152
(23)	31 juill. 2023	Hdc Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	(136)	(1)
(314)	31 juill. 2023	Helixmith Co Ltd, swap sur rendement total	(3 561)	652
(12 800)	31 juill. 2023	Highwealth Construction Corp, swap sur rendement total	(22 742)	2 512
(640)	31 juill. 2023	Hlb Inc, swap sur rendement total	(19 540)	989
(46 641)	31 juill. 2023	Hoteles City Express Sab De, swap sur rendement total	(27 344)	(4 789)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(4 000)	31 juill. 2023	Hsin Kuang Steel Co Ltd, swap sur rendement total	(7 565)	(883)
(2 000)	31 juill. 2023	Huaku Development Co Ltd, swap sur rendement total	(7 848)	2
(2)	31 juill. 2023	Hugel Inc, swap sur rendement total	(290)	(54)
(7)	31 juill. 2023	Hyosung Corporation, swap sur rendement total	(505)	43
(6)	31 juill. 2023	Hyundai Dept Store Co, swap sur rendement total	(381)	(8)
(101)	31 juill. 2023	Hyundai Greenfood Co Ltd, swap sur rendement total	(731)	(14)
(620)	31 juill. 2023	Hyundai Merchant Marine, swap sur rendement total	(13 030)	1 034
(204)	31 juill. 2023	Ilyang Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(4 244)	(664)
(209)	31 juill. 2023	Imarketkorea Inc, swap sur rendement total	(4 539)	60
(62)	31 juill. 2023	Industrial Bank Of Korea, swap sur rendement total	(655)	62
(200)	31 juill. 2023	Industrias Penoles Sab De Cv, swap sur rendement total	(3 333)	324
(44)	31 juill. 2023	Insun Ent Co Ltd, swap sur rendement total	(391)	35
(550)	31 juill. 2023	International Meal Company, swap sur rendement total	(395)	(69)
(30)	31 juill. 2023	Is Dongseo Co Ltd, swap sur rendement total	(909)	138
(29)	31 juill. 2023	Itm Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	(817)	103
(900)	31 juill. 2023	Jhsf Participacoes Sa, swap sur rendement total	(1 158)	89
(41)	31 juill. 2023	Jusung Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	(467)	96
(3)	31 juill. 2023	Kcc Corp, swap sur rendement total	(660)	74
(5 000)	31 juill. 2023	King'S Town Bank, swap sur rendement total	(7 473)	212
(1 000)	31 juill. 2023	Kinpo Electronics Inc, swap sur rendement total	(595)	20
(31)	31 juill. 2023	Kolmar Bnh Co Ltd, swap sur rendement total	(943)	(189)
(209)	31 juill. 2023	Kolmar Korea Co Ltd, swap sur rendement total	(9 571)	(1 215)
(211)	31 juill. 2023	Komipharm International Co, swap sur rendement total	(1 586)	78
(10)	31 juill. 2023	Korea Investment Holdings Co, swap sur rendement total	(573)	23
(400)	31 juill. 2023	Localiza Rent A Car, swap sur rendement total	(5 492)	596
(3 900)	31 juill. 2023	Locaweb Servicios De Internet, swap sur rendement total	(7 017)	1 431
(600)	31 juill. 2023	Log-In Logistica Intermodal, swap sur rendement total	(5 398)	(676)
(8 000)	31 juill. 2023	Magazine, swap sur rendement total	(5 619)	1 406
(1 400)	31 juill. 2023	Magazine Luiza Sa, swap sur rendement total	(732)	113
(10)	31 juill. 2023	Medpacto Inc, swap sur rendement total	(239)	3
(100)	31 juill. 2023	Minerva Sa, swap sur rendement total	(332)	(5)
(1 433)	31 juill. 2023	Mirae Asset Daewoo Co Ltd, swap sur rendement total	(9 366)	444
(1 000)	31 juill. 2023	Mosa Industrial Corp, swap sur rendement total	(1 071)	21
(700)	31 juill. 2023	Movida Participacoes Sa, swap sur rendement total	(1 398)	137
(1 400)	31 juill. 2023	Multilaser Industrial Sa, swap sur rendement total	(1 446)	(249)
(1 000)	31 juill. 2023	Nan Kang Rubber Tire Co Ltd, swap sur rendement total	(1 475)	72
(77)	31 juill. 2023	Nasmedia Co Ltd, swap sur rendement total	(10 595)	(1 579)
(12)	31 juill. 2023	Ncsoft Co, swap sur rendement total	(5 779)	(22)
(12)	31 juill. 2023	Netmarble Corp, swap sur rendement total	(779)	(174)
(7 000)	31 juill. 2023	Newmax Technology Co Ltd, swap sur rendement total	(8 595)	1 600
(284)	31 juill. 2023	Nh Investment & Securities C, swap sur rendement total	(2 678)	136
(258)	31 juill. 2023	Nkmax Co Ltd, swap sur rendement total	(3 800)	202
(2 000)	31 juill. 2023	Novatek Microelectronics Cor, swap sur rendement total	(27 819)	(1 540)
(1 500)	31 juill. 2023	Omega Energia Sa, swap sur rendement total	(3 691)	173
(1 000)	31 juill. 2023	Orbia Advance Corp Sab De Cv, swap sur rendement total	(2 399)	100
(1 700)	31 juill. 2023	Qgep Participacoes Sa, swap sur rendement total	(5 883)	(50)
(1 000)	31 juill. 2023	Radium Life Tech Co Ltd, swap sur rendement total	(403)	8
(2 544)	31 juill. 2023	Run Long Construction Co Ltd, swap sur rendement total	(7 795)	(566)
(16)	31 juill. 2023	Samsung Electr- CIAE, swap sur rendement total	(23 956)	1 109
(20)	31 juill. 2023	Samsung Sds Co Ltd, swap sur rendement total	(2 645)	(16)
(401)	31 juill. 2023	Samsung Securities Co Ltd, swap sur rendement total	(13 558)	882
(16)	31 juill. 2023	Sang-A Frontec Co Ltd, swap sur rendement total	(466)	6
(24)	31 juill. 2023	Seegene Inc, swap sur rendement total	(702)	49
(100)	31 juill. 2023	Seobu T&D, swap sur rendement total	(832)	(86)
(28)	31 juill. 2023	Seojin System Co Ltd, swap sur rendement total	(527)	(54)
(632)	31 juill. 2023	Seoul Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	(6 862)	351
(100)	31 juill. 2023	Ser Educacional Sa, swap sur rendement total	(115)	27
(151)	31 juill. 2023	Sfa Engineering Corp, swap sur rendement total	(5 909)	310
(1 000)	31 juill. 2023	Shun On Electronic Co Ltd, swap sur rendement total	(1 406)	173
(6 000)	31 juill. 2023	Sincere Navigation, swap sur rendement total	(5 291)	18
(200)	31 juill. 2023	Singja Sa, swap sur rendement total	(770)	95
(44)	31 juill. 2023	Sk Discovery Co Ltd, swap sur rendement total	(1 431)	17
(50)	31 juill. 2023	Sk Hynix Inc, swap sur rendement total	(4 031)	338
(11)	31 juill. 2023	Sk Innovation Co Ltd, swap sur rendement total	(1 821)	196
(400)	31 juill. 2023	Sle Agricola Sa, swap sur rendement total	(4 845)	(212)
(79)	31 juill. 2023	S-Oil Corp, swap sur rendement total	(7 083)	1
(57)	31 juill. 2023	Ssangyong Cement Ind, swap sur rendement total	(353)	1
(141)	31 juill. 2023	St Pharm Co Ltd, swap sur rendement total	(13 278)	(2 234)
(5 200)	31 juill. 2023	Ta Chen Stainless Pipe Co, swap sur rendement total	(9 720)	(496)
(700)	31 juill. 2023	Tegma Gestao Logistica, swap sur rendement total	(3 477)	163

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2022

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(602)	31 juill. 2023	Telcon Rf Pharmaceutical Inc, swap sur rendement total	(657)	58
(2 200)	31 juill. 2023	Transmissora Alianca De, parts, swap sur rendement total	(19 550)	(9)
(300)	31 juill. 2023	Trisul Sa, swap sur rendement total	(265)	21
(720)	31 juill. 2023	Unifin Financiera Sab De Cv, swap sur rendement total	(60)	1
(61 000)	31 juill. 2023	Upc Technology Corp, swap sur rendement total	(36 575)	1 157
(600)	31 juill. 2023	Vivara Participacoes Sa, swap sur rendement total	(3 450)	(57)
(2 150)	31 juill. 2023	Wan Hai Lines Ltd, swap sur rendement total	(7 593)	(510)
(13)	31 juill. 2023	Wonik Ips Co Ltd, swap sur rendement total	(346)	25
(126)	31 juill. 2023	Woongjin Coway Co Ltd, swap sur rendement total	(7 572)	(210)
(1 000)	31 juill. 2023	Yfy Inc, swap sur rendement total	(1 078)	129
(1 000)	31 juill. 2023	Yulon Motor Company, swap sur rendement total	(2 733)	139
(31)	31 juill. 2023	Zinus Inc, swap sur rendement total	(1 166)	(132)
(1 000)	31 juill. 2023	Zongtai Real Estate Developm, swap sur rendement total	(1 378)	33
				12 533
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position vendeur		72 999
		Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total		320 991
		Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total		(320 346)
		Plus-value (moins-value) latente des swaps sur rendement total, montant net		645

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2022 et 2021

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 31 décembre 2022

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

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

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2022 et 2021

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 les exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 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	4 013	4 215	(2 028)	48 055
Série F	35 406	333 401	32 164	(87 033)	313 938
Série I	2 004 975	2 763	157 173	(710 024)	1 454 887
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 2022, le Fonds disposait de pertes en capital inutilisées de néant (néant en 2021) pouvant être reportées indéfiniment pour réduire ses futurs gains en capital réalisés. Il ne disposait d'aucune perte autre qu'en capital inutilisée pouvant être reportée aux fins de l'impôt (néant en 2021).

Au cours de l'exercice, 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
31 décembre 2022 et 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 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 31 décembre 2022, CCLFGII détenait 1 412 779 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 14 387 318 \$ (1 962 376 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 23 470 017 \$ en 2021). Au 31 décembre 2022, GFCC&L détenait 6 867 parts de série A, 7 036 parts de série F et 7 278 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 69 052 \$, de 71 628 \$ et de 74 117 \$ (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 \$ en 2021).

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

Le Fonds a payé 23 511 \$ (27 435 \$ en 2021) en commissions de courtage et autres coûts de transactions relativement à des opérations de portefeuille durant l'exercice. Les paiements indirects effectués pour l'exercice se sont élevés à 4 401 \$ (6 054 \$ en 2021).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises aux 31 décembre 2022 et 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

31 décembre 2022 et 2021

Au 31 décembre 2022

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

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
31 décembre 2022 et 2021

Risque de taux d'intérêt

Aux 31 décembre 2022 et 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

Aux 31 décembre 2022 et 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 1 734 000 \$ (2 375 000 \$ en 2021). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Risque de crédit

Aux 31 décembre 2022 et 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 1,9 % (2,4 % en 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 exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2022	2021
	(\$)	(\$)
Revenus bruts tirés du prêt de titres	3 276	4 447
Charges liées au prêt de titres	(650)	(885)
Revenus nets tirés du prêt de titres	2 626	3 562
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	(132)	(110)
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	2 494	3 452

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 aux 31 décembre 2022 et 2021.

	31 décembre 2022	31 décembre 2021
	(en milliers de \$)	(en milliers de \$)
Titres prêtés	909	924
Garanties reçues	954	970
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2022 et 2021

Effet de levier et emprunt (note 13)

Au cours des exercices clos les 31 décembre 2022 et 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 31 décembre 2022, l'exposition totale du Fonds correspondait à 73,7 % (62,4 % en 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 des exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant 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 1,98 % (0,29 % en 2021). Au 31 décembre 2022, les emprunts en trésorerie correspondaient à 18,3 % (7,7 % en 2021) de la valeur liquidative du Fonds.

Événements postérieurs à la date de clôture (note 14)

Après la clôture de l'exercice, les porteurs de parts du Fonds ont approuvé des modifications aux frais de gestion et à la rémunération au rendement du Fonds et des modifications aux objectifs de placement du Fonds. Dans le cadre des modifications aux objectifs de placement du Fonds, le nom du Fonds sera changé pour CC&L Global Long Short Fund. Les modifications aux frais de gestion et à la rémunération au rendement du Fonds sont présentées ci-après.

Série	Frais de gestion actuels	Frais de gestion proposés	Rémunération au rendement actuelle	Rémunération au rendement proposée
A	1,50 %	2,00 %	20 % de l'excédent du rendement total des parts de série A sur un taux de rendement minimal, qui correspond au rendement de l'indice composé S&P/TSX.	20 % de l'excédent du rendement total des parts de série A sur un rendement annuel de 4,00 % (calculé trimestriellement), avec un rendement de référence perpétuel.
F	0,50 %	1,00 %	20 % de l'excédent du rendement total des parts de série F sur un taux de rendement minimal, qui correspond au rendement de l'indice composé S&P/TSX.	20 % de l'excédent du rendement total des parts de série F sur un rendement annuel de 4,00 % (calculé trimestriellement), avec un rendement de référence perpétuel.

Ces modifications, ainsi que les modifications aux objectifs de placement, sont décrites en détail dans une circulaire de la direction disponible sur le Système électronique de données, d'analyse et de recherche (SEDAR). Les modifications devraient entrer en vigueur le 23 mars 2023 ou vers de cette date.

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de la situation financière

Aux 31 décembre

	2022	2021
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	39 867 \$	852 931 \$
Placements à court terme	428 412	13 912 881
Placements	50 654 800	52 431 222
Plus-value latente des contrats de change à terme	114 467	101 010
Plus-value latente des contrats à terme normalisés	232 781	61 714
Plus-value latente des swaps sur défaillance de crédit	573	4 147
Marge de variation quotidienne	770 090	549 430
Montant à recevoir du courtier	69 357	-
Intérêts à recevoir	559 924	550 241
Autres créances	47	-
Souscriptions à recevoir	300	10 000
	52 870 618	68 473 576
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	526 167	665 817
Placements à court terme vendus à découvert	4 820 910	-
Placements vendus à découvert	19 391 897	30 637 333
Moins-value latente des contrats de change à terme	22 483	63 356
Moins-value latente des contrats à terme normalisés	180 575	41 873
Moins-value latente des contrats de swap	-	71 623
Moins-value latente des swaps sur défaillance de crédit	218	2 489
Intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	287 527	167 645
Montant à payer au courtier	542 781	-
Frais d'emprunt de titres à payer	9 001	111
Charges à payer	58 002	35 397
Frais de gestion à payer	748	1 366
Rémunération au rendement à payer	-	4 408
	25 840 309	31 691 418
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	27 030 309 \$	36 782 158 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de la situation financière

Aux 31 décembre

	2022	2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	105 001 \$	99 388 \$
Série F	1 630 088 \$	2 781 622 \$
Série I	25 295 220 \$	33 901 148 \$
	<hr/>	<hr/>
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	13 264	10 663
Série F	199 147	291 593
Série I	2 959 236	3 416 269
	<hr/>	<hr/>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	7,92 \$	9,32 \$
Série F	8,19 \$	9,54 \$
Série I	8,55 \$	9,92 \$
	<hr/>	<hr/>

Approuvé par le gestionnaire

« *Michael Freund* »

Administrateur

« *Tim Elliott* »

Administrateur

Fonds alternatif de revenu CC&L

États du résultat global

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2022	2021
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	(96 512) \$	(142 786) \$
Variation du gain (perte) de change latent	(19 820)	17 638
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	3 390	6 341
Autres revenus (pertes)	12 000	806
Gain (perte) net sur placements		
Intérêts aux fins des distributions	2 282 060	2 255 949
Charges d'intérêts sur les titres vendus à découvert	(1 100 102)	(734 738)
Gain (perte) net réalisé sur les placements	(2 781 790)	135 476
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	1 338 662	505 682
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	(701 177)	41 039
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme sur obligations	–	(80 374)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	233 303	486 450
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	(441 324)	17 875
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	(1 706 523)	90 632
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	833 651	(346 293)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	54 330	45 581
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats à terme sur obligations	–	(29 139)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats à terme normalisés	32 365	42 393
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	70 320	(71 058)
Gain (perte) net total sur placements	(1 886 225)	2 359 475
Total des revenus (pertes) nets	(1 987 167)	2 241 474
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	32 167	25 909
Honoraires des dépositaires	73 686	53 608
Frais de dépôt	22 251	18 885
Honoraires du comité d'examen indépendant	4 711	4 955
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	642	547
Charges d'intérêts	2 980	451
Frais de gestion	12 687	11 604
Rémunération au rendement	13	17 300
Honoraires de professionnels	13 620	16 853
Coût d'emprunt de titres	139 317	63 376
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	11 647	10 462
Coûts d'opérations (note 9)	9 322	6 332
Total des charges d'exploitation	323 043	230 282
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 310 210) \$	2 011 192 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

États du résultat global

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2022	2021
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	(7 349) \$	3 752 \$
Série F	(193 917) \$	91 158 \$
Série I	(2 108 944) \$	1 916 282 \$
	<hr/>	<hr/>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	11 866	11 960
Série F	253 358	189 099
Série I	3 038 482	3 054 978
	<hr/>	<hr/>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	(0,62) \$	0,31 \$
Série F	(0,77) \$	0,48 \$
Série I	(0,69) \$	0,63 \$
	<hr/>	<hr/>

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables
Pour les exercices clos les 31 décembre

	Série A 2022	Série A 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	99 388 \$	129 112 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(7 349)	3 752
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	26 000	29 900
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	7 021	6 796
Rachat de parts rachetables	(11 089)	(62 877)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	21 932	(26 181)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(8 970)	(7 237)
Gains en capital nets réalisés	–	(58)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(8 970)	(7 295)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	5 613	(29 724)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	105 001 \$	99 388 \$
	Série F 2022	Série F 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	2 781 622 \$	1 528 419 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(193 917)	91 158
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	760 371	1 581 387
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	101 500	144 644
Rachat de parts rachetables	(1 657 342)	(390 780)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(795 471)	1 335 251
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(162 146)	(171 580)
Gains en capital nets réalisés	–	(1 626)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(162 146)	(173 206)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(1 151 534)	1 253 203
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	1 630 088 \$	2 781 622 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables
Pour les exercices clos les 31 décembre

	Série I 2022	Série I 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	33 901 148 \$	27 639 812 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 108 944)	1 916 282
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	1 909 847	4 397 153
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	2 290 430	2 376 516
Rachat de parts rachetables	(8 406 831)	(52 099)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(4 206 554)	6 721 570
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(2 290 430)	(2 356 760)
Gains en capital nets réalisés	–	(19 756)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(2 290 430)	(2 376 516)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(8 605 928)	6 261 336
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	25 295 220 \$	33 901 148 \$
	Total 2022	Total 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	36 782 158 \$	29 297 343 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	(2 310 210)	2 011 192
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	2 696 218	6 008 440
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	2 398 951	2 527 956
Rachat de parts rachetables	(10 075 262)	(505 756)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(4 980 093)	8 030 640
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(2 461 546)	(2 535 577)
Gains en capital nets réalisés	–	(21 440)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(2 461 546)	(2 557 017)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(9 751 849)	7 484 815
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	27 030 309 \$	36 782 158 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les exercices clos les 31 décembre

	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	(2 310 210) \$	2 011 192 \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	19 820	(17 638)
(Gain) perte net réalisé sur les placements	2 781 790	(135 476)
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	(1 338 662)	(505 682)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	1 706 523	(90 632)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	(833 651)	346 293
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	(54 330)	(45 581)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats à terme sur obligations	-	29 139
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats à terme normalisés	(32 365)	(42 393)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	(70 320)	71 058
Achat de placements	(490 774 669)	(459 880 564)
Produit des placements vendus	497 768 458	452 829 034
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	(220 660)	(338 970)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(9 683)	(36 342)
(Augmentation) diminution des autres créances	(47)	68
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	8 890	(5 961)
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	119 882	19 488
Augmentation (diminution) des charges à payer	22 605	(336)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(618)	615
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	(4 408)	(3 329)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	6 778 345	(5 796 017)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	2 704 867	5 973 268
Rachat de parts rachetables**	(10 074 211)	(480 584)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des réinvestissements	(62 595)	(29 061)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(7 431 939)	5 463 623
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	(653 594)	(332 394)
Variation du gain (perte) de change latent	(19 820)	17 638
Trésorerie, à l'ouverture de l'exercice	852 931	501 870
Dette bancaire, à l'ouverture de l'exercice	(665 817)	-
	(486 300)	187 114
Trésorerie, à la clôture de l'exercice	39 867 \$	852 931 \$
Dette bancaire, à la clôture de l'exercice	(526 167) \$	(665 817) \$
	(486 300) \$	187 114 \$
Intérêts reçus*	2 272 377 \$	2 219 607 \$
Intérêts payés*	983 200	715 701

* Inclus dans les activités d'exploitation.

** Déduction faite d'échanges hors trésorerie de 1 051 \$ (25 172 \$ en 2021)

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 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	7,638	5 janv. 2023	25 000	24 786	24 985	
Bons du Trésor du Canada*	4,328	19 janv. 2023	300 000	297 948	299 334	
Bons du Trésor du Canada	4,260	2 mars 2023	55 000	54 449	54 612	
Bons du Trésor du Canada	4,273	30 mars 2023	50 000	49 434	49 481	
				426 617	428 412	1,58
Billets à ordre (31 décembre 2021 : 12,50 %)						
Total des placements à court terme – position acheteur						
				426 617	428 412	1,58
Placements à court terme – position vendeur						
Bons du Trésor du Canada (31 décembre 2021 : néant)						
Bons du Trésor du Canada	4,328	19 janv. 2023	(4 845 000)	(4 820 910)	(4 820 910)	(17,84)
Total des placements à court terme – position vendeur						
				(4 820 910)	(4 820 910)	(17,84)
Obligations – position vendeur						
Obligations fédérales canadiennes (31 décembre 2021 : 7,62 %)						
Obligations du gouvernement du Canada	1,250	1 ^{er} juin 2030	292 000	262 434	253 164	
Obligations du gouvernement du Canada	2,000	1 ^{er} juin 2032	14 000	12 953	12 539	
Obligations du gouvernement du Canada	2,500	1 ^{er} déc. 2032	1 994 000	1 874 755	1 860 247	
Obligations du gouvernement du Canada	2,000	1 ^{er} déc. 2051	177 000	134 898	134 580	
Obligations du gouvernement du Canada	1,750	1 ^{er} déc. 2053	2 626 000	1 917 091	1 850 652	
Obligations du gouvernement du Canada	2,750	1 ^{er} déc. 2064	303 000	345 392	267 060	
				4 547 523	4 378 242	16,20
Obligations provinciales canadiennes (31 décembre 2021 : 24,32 %)						
Province de l'Alberta	3,100	1 ^{er} juin 2050	855 000	1 002 952	693 001	
Province de Terre-Neuve-et-Labrador	3,150	2 déc. 2052	408 000	404 548	311 437	
Province d'Ontario	2,900	2 juin 2028	139 000	134 796	132 583	
Province d'Ontario	2,550	2 déc. 2052	527 000	401 311	376 193	
				1 943 607	1 513 214	5,60
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2021 : 18,41 %)						
Allied Properties REIT	1,726	12 fév. 2026	41 000	36 591	36 368	
Allied Properties REIT	3,113	8 avril 2027	51 000	47 368	46 122	
Allied Properties REIT	3,131	15 mai 2028	17 000	15 240	14 988	
Allied Properties REIT	3,394	15 août 2029	362 000	321 605	312 866	
Banque de Montréal	3,650	1 ^{er} avril 2027	869 000	839 836	825 643	
Banque de Montréal	4,709	7 déc. 2027	345 000	345 000	340 582	
Banque de Montréal	2,077	17 juin 2030	179 000	163 674	164 710	
Banque de Montréal	6,534	27 oct. 2032	161 000	166 510	167 334	
Banque de Montréal	4,800	31 déc. 2049	157 000	216 600	195 760	
La Banque de Nouvelle-Écosse	5,500	8 mai 2026	303 000	302 991	307 688	
La Banque de Nouvelle-Écosse	2,836	3 juill. 2029	382 000	369 075	366 040	
La Banque de Nouvelle-Écosse	4,900	31 déc. 2049	294 000	399 987	382 921	
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada	2,200	39 mai 2028	332 000	288 325	290 419	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2,750	7 mars 2025	199 000	193 419	189 624	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	4,950	29 juin 2027	144 000	143 780	143 844	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	5,050	7 oct. 2027	341 000	340 478	341 204	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2,010	21 juill. 2030	671 000	614 283	613 499	
Banque canadienne de l'Ouest	5,937	22 déc. 2032	70 000	70 000	69 150	
Fiducie de placement immobilier industriel Dream	3,968	13 avril 2026	188 000	181 827	178 572	
Fiducie de placement immobilier industriel Dream	2,539	7 déc. 2026	134 000	121 759	119 565	
Enbridge Gas Inc.	2,880	22 nov. 2027	168 000	156 818	156 219	
Enbridge Gas Inc.	2,900	1 ^{er} avril 2030	16 000	14 609	14 329	
Enbridge Gas Inc.	4,150	17 août 2032	3 000	2 990	2 858	
Fédération des caisses Desjardins du Québec	5,200	1 ^{er} oct. 2025	196 000	195 888	196 621	
Le Fonds de placement immobilier First Capital	4,790	30 août 2024	30 000	32 149	29 224	
Le Fonds de placement immobilier First Capital	3,456	22 janv. 2027	22 000	20 037	19 741	
FortisAlberta Inc.	2,632	8 juin 2051	50 000	30 018	32 496	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Great-West Lifeco Inc.	2,379	14 mai 2030	184 000	158 343	155 420	
Intact Corporation financière	3,691	24 mars 2025	167 000	170 270	162 335	
Intact Corporation financière	2,850	7 juin 2027	184 000	195 065	169 881	
Inter Pipeline Ltd.	5,760	17 fév. 2028	553 000	552 956	560 016	
Inter Pipeline Ltd.	6,380	17 fév. 2033	31 000	30 997	31 759	
Banque Laurentienne du Canada	4,600	2 sept. 2025	123 000	123 037	120 500	
Banque Nationale du Canada	2,580	3 fév. 2025	170 000	164 486	161 530	
Banque Nationale du Canada	5,296	3 nov. 2025	433 000	433 568	435 812	
Banque Nationale du Canada	5,426	16 août 2032	327 000	324 225	323 492	
FPI RioCan	1,974	15 juin 2026	138 000	124 371	121 950	
Rogers Communications Inc.	5,000	17 déc. 2081	192 000	192 000	173 479	
Banque Royale du Canada	5,235	2 nov. 2026	405 000	405 053	408 478	
Banque Royale du Canada	4,612	26 juill. 2027	65 000	64 802	64 162	
Banque Royale du Canada	2,740	25 juill. 2029	125 000	120 566	119 360	
Banque Royale du Canada	2,880	23 déc. 2029	322 000	305 562	305 069	
Banque Royale du Canada	2,140	3 nov. 2031	71 000	64 177	62 487	
Saputo inc.	5,250	29 nov. 2029	28 000	28 000	28 211	
Shaw Communications Inc.	3,800	1 ^{er} mars 2027	86 000	83 383	81 479	
Shaw Communications Inc.	4,400	2 nov. 2028	389 000	371 008	372 455	
Shaw Communications Inc.	3,300	10 déc. 2029	232 000	202 439	204 581	
Summit Industrial Income REIT	2,250	12 janv. 2027	40 000	35 567	35 442	
TELUS Corp.	5,000	13 sept. 2029	14 000	13 940	13 973	
Toronto Hydro Corp.	2,430	11 déc. 2029	81 000	72 736	71 726	
La Banque Toronto-Dominion	2,260	7 janv. 2027	130 000	114 017	117 338	
La Banque Toronto-Dominion	4,680	8 janv. 2029	542 000	542 000	533 869	
La Banque Toronto-Dominion	3,105	22 avril 2030	367 000	346 055	347 728	
La Banque Toronto-Dominion	3,060	26 janv. 2032	17 000	14 981	15 460	
La Banque Toronto-Dominion	5,750	31 déc. 2049	211 000	211 000	187 414	
Transcanada Trust	2,077	25 janv. 2028	108 000	95 903	93 853	
Vidéotron Itée	4,650	18 mai 2077	156 000	158 638	139 614	
	5,125	15 avril 2027	1 097 000	1 376 308	1 406 496	
				12 726 310	12 583 756	46,55
Obligations de sociétés américaines (31 décembre 2021 : 84,27 %)						
American Airlines 2016-3, cat. B, à flux identiques	3,750	15 oct. 2025	98 470	105 292	119 264	
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC	3,250	1 ^{er} sept. 2028	611 000	705 266	704 600	
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC	4,000	1 ^{er} sept. 2029	433 000	464 002	466 086	
AT&T Inc.	2,300	1 ^{er} juin 2027	513 000	612 082	620 486	
AT&T Inc.	1,650	1 ^{er} fév. 2028	541 000	611 966	621 404	
AT&T Inc.	2,250	1 ^{er} fév. 2032	354 000	384 202	378 618	
AT&T Inc.	2,550	1 ^{er} déc. 2033	125 000	150 326	131 166	
AT&T Inc.	4,850	25 mai 2047	5 000	4 891	4 349	
AT&T Inc.	3,650	1 ^{er} juin 2051	139 000	172 006	134 430	
AT&T Inc.	3,300	1 ^{er} fév. 2052	235 000	235 975	214 811	
Ball Corp.	2,875	15 août 2030	737 000	783 429	798 384	
Cable One Inc.	4,000	15 nov. 2030	739 000	812 503	786 974	
CCO Holdings LLC	5,000	1 ^{er} fév. 2028	277 000	321 120	340 026	
CCO Holdings LLC	6,375	1 ^{er} sept. 2029	32 000	40 842	40 829	
CCO Holdings LLC	4,750	1 ^{er} mars 2030	182 000	203 637	210 806	
Centene Corp.	2,450	15 juill. 2028	1 378 000	1 562 425	1 577 993	
Charter Communications Operating LLC	4,908	23 juill. 2025	164 000	212 637	218 184	
Charter Communications Operating LLC	2,250	15 janv. 2029	161 000	176 668	176 356	
Charter Communications Operating LLC	5,050	30 mars 2029	241 000	304 423	308 234	
Charter Communications Operating LLC	2,300	1 ^{er} fév. 2032	482 000	482 392	484 044	
Charter Communications Operating LLC	5,250	1 ^{er} avril 2053	48 000	54 920	50 811	
CHS/Community Health Systems Inc.	8,000	15 mars 2026	745 000	928 195	921 118	
Cinemark USA Inc.	5,875	15 mars 2026	620 000	762 497	700 796	
Comcast Corp.	2,350	15 janv. 2027	912 000	1 105 821	1 126 147	
Crown Americas LLC	5,250	1 ^{er} avril 2030	396 000	499 915	508 107	
CSC Holdings LLC	5,375	1 ^{er} fév. 2028	916 000	1 121 469	1 002 632	
CSC Holdings LLC	7,500	1 ^{er} avril 2028	14 000	16 533	12 894	
CSC Holdings LLC	6,500	1 ^{er} fév. 2029	178 000	220 176	197 677	
CSC Holdings LLC	5,750	15 janv. 2030	120 000	131 046	92 060	
CSC Holdings LLC	4,500	15 nov. 2031	46 000	48 771	43 361	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ford Motor Credit Co LLC	4,063	1 ^{er} nov. 2024	498 000	590 428	649 706	
Ford Motor Credit Co LLC	4,271	9 janv. 2027	88 000	108 359	108 052	
Ford Motor Credit Co LLC	2,900	10 fév. 2029	21 000	22 205	22 764	
GLP Capital LP	4,000	15 janv. 2030	434 000	502 613	516 068	
HCA Inc.	4,125	15 juin 2029	582 000	706 128	723 366	
Kraft Heinz Foods Co.	3,875	15 mai 2027	495 000	649 829	643 176	
Level 3 Financing Inc.	3,400	1 ^{er} mars 2027	636 000	738 147	731 083	
Level 3 Financing Inc.	4,625	15 sept. 2027	82 000	113 343	92 691	
Level 3 Financing Inc.	3,625	15 janv. 2029	163 000	160 002	162 088	
Level 3 Financing Inc.	3,875	15 nov. 2029	343 000	364 139	367 588	
Lions Gate Capital Holdings LLC	5,500	15 avril 2029	620 000	662 290	488 165	
Lithia Motors Inc.	3,875	1 ^{er} juin 2029	926 000	1 101 413	1 033 303	
Lumen Technologies Inc.	4,000	15 fév. 2027	105 000	119 376	120 885	
Lumen Technologies Inc.	6,875	15 janv. 2028	39 000	42 787	43 972	
Lumen Technologies Inc.	4,500	15 janv. 2029	216 000	204 490	202 399	
Molina Healthcare Inc.	4,375	15 juin 2028	95 000	115 073	117 697	
Molina Healthcare Inc.	3,875	15 mai 2032	401 000	474 475	451 995	
Ovintiv Exploration Inc.	5,375	1 ^{er} janv. 2026	79 000	109 531	106 441	
Owens-Brockway Glass Container Inc.	6,375	15 août 2025	192 000	255 484	251 787	
Pacific Gas and Electric Co.	4,550	1 ^{er} juill. 2030	232 000	297 436	286 607	
Pacific Gas and Electric Co.	5,900	15 juin 2032	97 000	124 156	129 165	
Sysco Corp.	3,300	15 juill. 2026	591 000	739 990	757 316	
Sysco Corp.	3,250	15 juill. 2027	1 138 000	1 416 204	1 429 360	
Sysco Corp.	5,950	1 ^{er} avril 2030	104 000	141 963	146 568	
Sysco Corp.	3,150	14 déc. 2051	300 000	286 205	271 234	
Tenet Healthcare Corp.	4,875	1 ^{er} janv. 2026	993 000	1 260 429	1 280 138	
Tenet Healthcare Corp.	4,625	15 juin 2028	126 000	154 512	153 028	
Tenet Healthcare Corp.	6,125	15 juin 2030	305 000	391 714	394 482	
Bons/obligations du Trésor des États-Unis	3,875	30 nov. 2027	240 000	326 760	323 983	
Bons/obligations du Trésor des États-Unis	4,125	15 nov. 2032	8 000	10 835	11 104	
Universal Health Services Inc.	2,650	15 oct. 2030	461 000	479 687	500 369	
Verizon Communications Inc.	2,375	22 mars 2028	47 000	41 577	41 773	
Verizon Communications Inc.	2,550	21 mars 2031	1 402 000	1 651 717	1 569 564	
VMware Inc.	1,800	15 août 2028	989 000	1 188 944	1 099 026	
Warnermedia Holdings Inc.	3,755	15 mars 2027	1 566 000	1 923 020	1 918 676	
Warnermedia Holdings Inc.	4,279	15 mars 2032	306 000	353 163	343 045	
				31 063 851	30 481 311	112,77
Obligations étrangères (31 décembre 2021 : 7,92 %)						
Ardagh Packaging Finance PLC	4,125	15 août 2026	243 000	285 462	285 887	
Ardagh Packaging Finance PLC	5,250	15 août 2027	60 000	57 707	60 938	
Carnival Corp.	5,750	1 ^{er} mars 2027	219 000	260 976	212 395	
Nissan Motor Co., Ltd.	4,810	17 sept. 2030	643 000	856 137	743 398	
NXP BV / NXP Funding LLC	4,400	1 ^{er} juin 2027	304 000	393 151	395 659	
				1 853 433	1 698 277	6,28
Total des obligations – position acheteur				52 134 724	50 654 800	187,40
Obligations – position vendeur						
Obligations fédérales canadiennes (31 décembre 2021 : -27,95 %)						
Obligations du gouvernement du Canada	1,000	1 ^{er} juin 2027	(198 000)	(181 350)	(179 209)	
Obligations du gouvernement du Canada	2,750	1 ^{er} sept. 2027	(1 043 000)	(1 030 924)	(1 013 382)	
Obligations du gouvernement du Canada	2,000	1 ^{er} juin 2028	(514 000)	(488 931)	(481 720)	
				(1 701 205)	(1 674 311)	(6,19)
Obligations provinciales canadiennes (31 décembre 2021 : -16,67 %)						
Province d'Ontario	3,750	2 déc. 2053	(3 176 000)	(3 018 032)	(2 914 598)	
Province de Québec	3,100	1 ^{er} déc. 2051	(590 000)	(660 427)	(478 245)	
Province de Québec	2,850	1 ^{er} déc. 2053	(143 000)	(109 262)	(109 378)	
				(3 787 721)	(3 502 221)	(12,96)
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2021 : -10,02 %)						
Aéroports de Montréal	3,441	26 avril 2051	(49 000)	(39 111)	(38 438)	
Baytex Energy Corp.	8,750	1 ^{er} avril 2027	(788 000)	(1 047 323)	(1 088 127)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Capital Power Corp.	3,147	1 ^{er} oct. 2032	(728 000)	(706 563)	(592 544)	
EPCOR Utilities Inc.	4,725	2 sept. 2052	(21 000)	(21 257)	(20 441)	
Great-West Lifeco Inc.	2,981	8 juill. 2050	(230 000)	(201 512)	(157 531)	
Intact Corporation financière	3,765	20 mai 2053	(432 000)	(330 821)	(339 634)	
Inter Pipeline Ltd.	5,091	27 nov. 2051	(379 000)	(305 974)	(315 912)	
Les Compagnies Loblaw Itée	2,284	7 mai 2030	(484 000)	(473 550)	(405 419)	
Ontario Power Generation Inc.	3,651	13 sept. 2050	(462 000)	(470 598)	(366 708)	
Taseko Mines Ltd.	7,000	15 fév. 2026	(255 000)	(282 077)	(304 256)	
Toronto Hydro Corp.	4,950	13 oct. 2052	(232 000)	(238 132)	(237 420)	
TransCanada PipeLines Ltd.	5,920	12 mai 2052	(148 000)	(145 834)	(150 150)	
				(4 262 752)	(4 016 580)	(14,86)
Obligations américaines (31 décembre 2021 : -27,82 %)						
Allison Transmission Inc.	5,875	1 ^{er} juin 2029	(719 000)	(903 717)	(916 615)	
Allison Transmission Inc.	3,750	30 janv. 2031	(3 000)	(3 412)	(3 348)	
American Airlines Inc.	5,750	20 avril 2029	(171 000)	(210 486)	(211 771)	
American Axle & Manufacturing Inc.	5,000	1 ^{er} oct. 2029	(175 000)	(200 307)	(191 858)	
Aramark Services Inc.	5,000	1 ^{er} fév. 2028	(273 000)	(333 570)	(345 849)	
Asbury Automotive Group Inc.	4,625	15 nov. 2029	(404 000)	(449 762)	(461 910)	
Asbury Automotive Group Inc.	5,000	15 fév. 2032	(168 000)	(182 503)	(187 570)	
Avis Budget Car Rental LLC	4,750	1 ^{er} avril 2028	(536 000)	(618 330)	(612 846)	
Bloomin' Brands Inc.	5,125	15 avril 2029	(140 000)	(160 726)	(159 798)	
Boeing Co.	5,805	1 ^{er} mai 2050	(27 000)	(34 929)	(34 248)	
Callon Petroleum Co.	8,000	1 ^{er} août 2028	(498 000)	(641 495)	(641 500)	
Callon Petroleum Co.	7,500	15 juin 2030	(37 000)	(45 512)	(45 937)	
Century Communities Inc.	3,875	15 août 2029	(324 000)	(352 788)	(345 740)	
Cleveland-Cliffs Inc.	4,625	1 ^{er} mars 2029	(8 000)	(9 408)	(9 636)	
Cleveland-Cliffs Inc.	4,875	1 ^{er} mars 2031	(58 000)	(69 405)	(69 506)	
Conagra Brands Inc.	5,400	1 ^{er} nov. 2048	(61 000)	(96 869)	(77 305)	
Earthstone Energy Holdings LLC	8,000	15 avril 2027	(382 000)	(475 018)	(494 985)	
General Motors Co.	5,400	1 ^{er} avril 2048	(241 000)	(293 303)	(269 116)	
General Motors Financial Co Inc.	3,100	12 janv. 2032	(92 000)	(101 056)	(98 330)	
Goodyear Tire & Rubber Co.	5,625	30 avril 2033	(324 000)	(372 297)	(359 094)	
Hewlett Packard Enterprise Co.	6,350	15 oct. 2045	(176 000)	(213 621)	(239 527)	
iHeartCommunications Inc.	5,250	15 août 2027	(75 000)	(90 537)	(86 243)	
iHeartCommunications Inc.	4,750	15 janv. 2028	(230 000)	(267 844)	(254 274)	
KB Home	7,250	15 juill. 2030	(92 000)	(118 014)	(121 283)	
KB Home	4,000	15 juin 2031	(220 000)	(233 667)	(240 000)	
Lamar Media Corp.	3,750	15 fév. 2028	(373 000)	(439 237)	(453 185)	
Lamar Media Corp.	4,875	15 janv. 2029	(369 000)	(454 102)	(460 930)	
Lamar Media Corp.	4,000	15 fév. 2030	(135 000)	(157 346)	(160 196)	
Lamar Media Corp.	3,625	15 janv. 2031	(90 000)	(105 854)	(100 975)	
Laredo Petroleum Inc.	10,125	15 janv. 2028	(64 000)	(82 370)	(84 700)	
LGI Homes Inc.	4,000	15 juill. 2029	(149 000)	(147 914)	(156 247)	
M/I Homes Inc.	3,950	15 fév. 2030	(5 000)	(5 236)	(5 479)	
Meritage Homes Corp.	3,875	15 avril 2029	(214 000)	(247 941)	(244 711)	
Outfront Media Capital LLC	4,625	15 mars 2030	(154 000)	(174 703)	(172 967)	
Paramount Global	4,950	19 mai 2050	(42 000)	(44 675)	(41 890)	
Scripps Escrow II Inc.	3,875	15 janv. 2029	(246 000)	(263 636)	(267 979)	
Scripps Escrow II Inc.	5,375	15 janv. 2031	(11 000)	(11 689)	(11 966)	
Sonic Automotive Inc.	4,875	15 nov. 2031	(249 000)	(264 560)	(265 695)	
Taylor Morrison Communities Inc.	5,125	1 ^{er} août 2030	(42 000)	(50 502)	(49 535)	
T-Mobile USA Inc.	3,300	15 fév. 2051	(13 000)	(12 963)	(11 840)	
United Airlines Inc.	4,625	15 avril 2029	(373 000)	(418 675)	(440 936)	
United Rentals North America Inc.	5,250	15 janv. 2030	(394 000)	(532 888)	(502 547)	
United States Steel Corp.	6,875	1 ^{er} mars 2029	(91 000)	(107 479)	(119 848)	
United States Steel Corp.	6,650	1 ^{er} juin 2037	(113 000)	(125 806)	(140 368)	
Bons/obligations du Trésor des États-Unis	2,875	15 mai 2052	(26 000)	(28 732)	(28 502)	
				(10 154 884)	(10 198 785)	(37,73)
Total des obligations – position vendeur				(19 906 562)	(19 391 897)	(71,74)
Total des placements				27 833 869	26 870 405	99,40

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)					114 467	0,42
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)					(22 483)	(0,08)
Total de la plus-value latente des contrats à terme normalisés (Annexe 2)					232 781	0,87
Total de la moins-value latente des contrats à terme normalisés (Annexe 2)					(180 575)	(0,67)
Total de la plus-value latente des swaps sur défaillance de crédit (Annexe 3)					573	–
Total de la moins-value latente des swaps sur défaillance de crédit (Annexe 3)					(218)	–
Autres actifs, moins les passifs					15 359	0,06
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables					27 030 309	100,00

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

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats de change à terme (Annexe 1)

Au 31 décembre 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	USD	(665 000)	CAD	908 322	15 mars 2023	7 760
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(640 000)	CAD	868 626	15 mars 2023	1 971
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(139 000)	CAD	188 946	15 mars 2023	716
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(46 982)	CAD	64 185	15 mars 2023	560
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(24 532)	CAD	33 484	15 mars 2023	262
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(106 489)	CAD	144 448	15 mars 2023	246
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(33 585)	CAD	45 638	15 mars 2023	159
Banque Royale du Canada	CAD	(592 756)	USD	438 000	15 mars 2023	345
Banque Royale du Canada	CAD	(429 004)	USD	317 000	15 mars 2023	250
Banque Royale du Canada	CAD	(70 384)	USD	52 000	15 mars 2023	30
Banque Royale du Canada	USD	(494 000)	CAD	673 333	15 mars 2023	4 357
Banque Royale du Canada	USD	(27 000)	CAD	36 711	15 mars 2023	148
Banque Royale du Canada	USD	(17 000)	CAD	23 064	15 mars 2023	44
La Banque Toronto-Dominion	USD	(8 453 191)	CAD	11 521 319	15 mars 2023	73 996
La Banque Toronto-Dominion	USD	(844 000)	CAD	1 155 133	15 mars 2023	12 143
La Banque Toronto-Dominion	USD	(1 306 915)	CAD	1 781 266	15 mars 2023	11 441
La Banque Toronto-Dominion	USD	(4 508)	CAD	6 144	15 mars 2023	39
						114 467
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(27 129)	USD	20 000	15 mars 2023	(46)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(21 835)	USD	16 000	15 mars 2023	(167)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(71 969)	USD	53 000	15 mars 2023	(199)
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(20 000)	CAD	27 077	15 mars 2023	(5)
Banque Royale du Canada	CAD	(35 393)	USD	26 000	15 mars 2023	(185)
Banque Royale du Canada	CAD	(80 759)	USD	59 000	15 mars 2023	(858)
Banque Royale du Canada	CAD	(532 262)	USD	391 000	15 mars 2023	(2 776)
Banque Royale du Canada	CAD	(1 043 700)	USD	766 000	15 mars 2023	(6 384)
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(134 723)	USD	99 000	15 mars 2023	(659)
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(92 764)	USD	68 000	15 mars 2023	(677)
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(128 149)	USD	94 000	15 mars 2023	(854)
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(1 506 086)	USD	1 105 015	15 mars 2023	(9 673)
						(22 483)
						91 984

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

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats à terme normalisés (Annexe 2)

Au 31 décembre 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	22 mars 2023	(133)	(14 825 510)	158 062
Contrats à terme normalisés sur bons du Trésor américain à 10 ans, CBOT	22 mars 2023	(41)	(6 238 423)	67 409
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 2 ans	22 mars 2023	(34)	(3 509 310)	7 310
			(24 573 243)	232 781
Contrats à terme normalisés sur bons du Trésor américain à 5 ans, CBOT	31 mars 2023	12	1 754 872	(23 210)
Contrats à terme normalisés sur obligations, CBOT Ultra	22 mars 2023	6	1 091 920	(32 455)
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 10 ans	22 mars 2023	37	4 534 350	(124 910)
			7 381 142	(180 575)
			(17 192 101)	52 206

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

Au 31 décembre 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	325	573
				325	573
CDX.NA.HY.39 5 %	29 déc. 2022	20 déc. 2027	73,000 USD	(707)	(218)
				(707)	(218)
				(382)	355

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2022 et 2021

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 31 décembre 2022

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

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

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2022 et 2021

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 les exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021, les changements aux parts en circulation ont été les suivants :

2022	Solde à l'ouverture de l'exercice	Parts rachetables émises	Parts rachetables réinvesties	Parts rachetables rachetées	Solde à la clôture de l'exercice
Série A	10 663	2 975	858	(1 232)	13 264
Série F	291 593	84 777	11 871	(189 094)	199 147
Série I	3 416 269	205 049	259 383	(921 465)	2 959 236

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

Au cours de l'exercice, 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
31 décembre 2022 et 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 1,45 % 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 31 décembre 2022, GFCC&L détenait 6 425 parts de série A, 6 487 parts de série F et 2 290 410 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 50 862 \$, de 53 099 \$ et de 19 578 425 \$ (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 \$ en 2021).

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

Le Fonds a payé 9 322\$ (6 332 \$ en 2021) en commissions de courtage et autres coûts de transactions relativement à des opérations de portefeuille durant l'exercice. Aucun paiement indirect n'a été effectué durant l'exercice (aucun en 2021).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises aux 31 décembre 2022 et 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
31 décembre 2022 et 2021

Au 31 décembre 2022

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

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

Aux 31 décembre 2022 et 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 aux 31 décembre 2022 et 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 31 décembre 2022

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

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

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 995 000 \$ (1 397 000 \$ en 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
31 décembre 2022 et 2021

Autre risque de prix

Aux 31 décembre 2022 et 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 aux 31 décembre 2022 et 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 31 décembre 2022

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

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
31 décembre 2022 et 2021

Prêt de titres (note 12)

Pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2022	2021
	\$	\$
Revenus bruts tirés du prêt de titres	4 237	7 926
Charges liées au prêt de titres	(847)	(1 585)
Revenus nets tirés du prêt de titres	3 390	6 341
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	–	–
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	3 390	6 341

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 31 décembre 2022.

	31 décembre 2022
	(en milliers de \$)
Titres prêtés	693
Garanties reçues	727
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 des exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié entre 85,2 % et 191,1 % (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 31 décembre 2022, l'exposition totale du Fonds correspondait à 182,4 % (94,3 % en 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, de contrats à terme sur obligations 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 des exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de néant à 7 973 344 \$ (de 60 \$ à 2 546 241 \$ en 2021), avec un taux d'intérêt moyen de 6,21 % (4,99 % en 2021). Au 31 décembre 2022, les emprunts en trésorerie correspondaient à 2,0 % (1,8 % en 2021) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds de rendement absolu PCJ II

États de la situation financière
Aux 31 décembre

	2022	2021
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	596 221 \$	9 \$
Placements à court terme	51 167 098	37 195 286
Placements	36 554 059	32 408 805
Montant à recevoir du courtier	339 809	1 108 727
Dividendes à recevoir	43 326	28 899
Intérêts à recevoir	30 960	–
Autres créances	17 929	6 789
Souscriptions à recevoir	104 529	100 760
	<u>88 853 931</u>	<u>70 849 275</u>
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	2 162 647	2 917 980
Placements vendus à découvert	33 683 725	29 355 109
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	105 676	56 438
Montant à payer au courtier	197 856	542 216
Frais d'emprunt de titres à payer	9 511	4 503
Charges à payer	58 511	27 304
Frais de gestion à payer	42 799	29 684
Rachats à payer	9 283	59 720
	<u>36 270 008</u>	<u>32 992 954</u>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	<u>52 583 923 \$</u>	<u>37 856 321 \$</u>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	1 948 885 \$	1 716 918 \$
Série F	46 400 923 \$	31 876 784 \$
Série I	4 234 115 \$	4 262 619 \$
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	210 804	180 637
Série F	4 933 501	3 330 483
Série I	440 000	440 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	9,25 \$	9,50 \$
Série F	9,41 \$	9,57 \$
Série I	9,62 \$	9,69 \$

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

Administrateur

« Tim Elliott »

Administrateur

Fonds de rendement absolu PCJ II

États du résultat global

Pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 et la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 31 décembre 2021

	2022	2021
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	20 250 \$	44 332 \$
Variation du gain (perte) de change latent	(39 763)	43 927
Autres revenus (pertes)	1 500	152
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	252 738	140 621
Charges de dividendes sur les titres vendus à découvert	(614 363)	(417 799)
Intérêts aux fins des distributions	626 272	44 940
Gain (perte) net réalisé sur les placements	(1 382 757)	97 283
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	1 823 574	(1 769 860)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	(1 021 446)	1 752 945
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	830 432	(327 973)
Gain (perte) net total sur placements	<u>514 450</u>	<u>(479 843)</u>
Total des revenus (pertes) nets	<u>496 437</u>	<u>(391 432)</u>
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	32 167	31 603
Honoraires des dépositaires	51 313	8 818
Frais de dépôt	22 251	-
Honoraires du comité d'examen indépendant	4 711	4 080
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	642	547
Charges d'intérêts	34 211	1 420
Frais de gestion	480 932	241 419
Honoraires de professionnels	15 941	3 014
Coût d'emprunt de titres	129 933	65 533
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	47 785	31 586
Coûts d'opérations (note 9)	<u>208 560</u>	<u>142 623</u>
Total des charges d'exploitation	<u>1 028 446</u>	<u>530 643</u>
Retenues d'impôts (note 7)	<u>(17 096)</u>	<u>(8 655)</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>(549 105) \$</u>	<u>(930 730) \$</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	(40 334) \$	(43 291) \$
Série F	(480 267) \$	(750 058) \$
Série I	<u>(28 504) \$</u>	<u>(137 381) \$</u>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	174 526	134 311
Série F	4 409 990	2 597 389
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	(0,23) \$	(0,32) \$
Série F	(0,11) \$	(0,29) \$
Série I	<u>(0,06) \$</u>	<u>(0,31) \$</u>

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

Pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 et la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 31 décembre 2021

	Série A 2022	Série A 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	<u>1 716 918 \$</u>	– \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>(40 334)</u>	<u>(43 291)</u>
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	413 217	1 791 833
Rachat de parts rachetables	<u>(140 916)</u>	<u>(31 624)</u>
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	<u>272 301</u>	<u>1 760 209</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	<u>231 967</u>	<u>1 716 918</u>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	<u>1 948 885 \$</u>	<u>1 716 918 \$</u>
	Série F 2022	Série F 2021
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	<u>31 876 784 \$</u>	– \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>(480 267)</u>	<u>(750 058)</u>
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	26 066 062	35 492 876
Rachat de parts rachetables	<u>(11 061 656)</u>	<u>(2 866 034)</u>
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	<u>15 004 406</u>	<u>32 626 842</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	<u>14 524 139</u>	<u>31 876 784</u>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	<u>46 400 923 \$</u>	<u>31 876 784 \$</u>

Fonds de rendement absolu PCJ II

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

Pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 et la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 31 décembre 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	(28 504)	(137 381)
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	(28 504)	4 262 619
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	4 234 115 \$	4 262 619 \$
	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	(549 105)	(930 730)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	26 479 279	41 684 709
Rachat de parts rachetables	(11 202 572)	(2 897 658)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	15 276 707	38 787 051
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	14 727 602	37 856 321
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	52 583 923 \$	37 856 321 \$

Fonds de rendement absolu PCJ II

Tableaux des flux de trésorerie

Pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 et la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 31 décembre 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	(549 105) \$	(930 730) \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	39 763	(43 927)
(Gain) perte net réalisé sur les placements	1 382 757	(97 283)
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	(1 823 574)	1 769 860
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	1 021 446	(1 752 945)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	(830 432)	327 973
Achat de placements	(475 196 155)	(296 579 649)
Produit de la vente de placements	462 082 066	255 516 551
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(14 427)	(28 899)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(30 960)	-
(Augmentation) diminution des autres créances	(11 140)	(6 789)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	5 008	4 503
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	49 238	56 438
Augmentation (diminution) des charges à payer	31 207	27 304
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	13 115	29 684
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	(13 831 193)	(41 707 909)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	26 475 510	41 552 325
Rachat de parts rachetables**	(11 253 009)	(2 806 314)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	15 222 501	38 746 011
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	1 391 308	(2 961 898)
Variation du gain (perte) de change latent	(39 763)	43 927
Trésorerie, à l'ouverture de la période	9	-
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	(2 917 980)	-
	(1 566 426)	(2 917 971)
Trésorerie, à la clôture de la période	596 221 \$	9 \$
Dette bancaire, à la clôture de la période	(2 162 647) \$	(2 917 980) \$
	(1 566 426) \$	(2 917 971) \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	221 215 \$	103 067 \$
Dividendes payés*	565 125	361 361
Intérêts reçus*	595 312	44 940
Intérêts payés*	34 211	1 420

* Inclus dans les activités d'exploitation.

** Déduction faite d'échanges hors trésorerie de 0 \$ (31 624 \$ en 2021).

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 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	7,638	5 janv. 2023	18 050 000	17 896 705	18 038 829	
Bons du Trésor du Canada	4,328	19 janv. 2023	3 700 000	3 668 014	3 691 791	
Bons du Trésor du Canada	4,276	2 fév. 2023	14 050 000	13 924 740	13 996 384	
Bons du Trésor du Canada	4,276	16 fév. 2023	1 650 000	1 635 315	1 641 038	
Bons du Trésor du Canada	4,260	2 mars 2023	12 200 000	12 085 082	12 113 824	
Bons du Trésor du Canada	4,250	16 mars 2023	1 700 000	1 684 276	1 685 232	
				<u>50 894 132</u>	<u>51 167 098</u>	97,31
Total des placements à court terme – position acheteur				<u>50 894 132</u>	<u>51 167 098</u>	97,31
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	969 048	1,84
Total des obligations – position acheteur				<u>1 062 384</u>	<u>969 048</u>	1,84
Actions canadiennes – position acheteur						
Énergie (31 décembre 2021 : 5,85 %)						
Corporation Cameco, NYSE			12 890	403 923	395 941	
Canadian Natural Resources Ltd., NYSE			2 420	181 195	182 083	
Canadian Natural Resources Ltd., NYSE			4 280	270 197	321 813	
CES Energy Solutions Corp.			81 620	172 863	225 271	
NexGen Energy Ltd., NYSE			15 750	122 920	94 539	
Peyto Exploration & Development Corp.			13 550	172 404	187 939	
Rubellite Energy Inc.			56 160	208 531	103 896	
Surge Energy Inc.			18 740	173 345	170 721	
Tamarack Valley Energy Ltd.			91 830	352 418	409 562	
Corporation TC Énergie, NYSE			8 940	496 836	482 837	
Trican Well Service Ltd.			91 100	331 038	333 426	
				<u>2 885 670</u>	<u>2 908 028</u>	5,53
Matières premières (31 décembre 2021 : 14,91 %)						
Mines Agnico Eagle Ltée, NYSE			5 110	308 524	359 970	
Arizona Metals Corp.			27 780	129 965	119 732	
Canfor Corp.			9 730	194 914	207 346	
Capstone Copper Corp.			80 580	378 484	398 065	
Franco-Nevada Corp., NYSE			1 520	269 627	281 086	
NanoXplore Inc.			19 530	101 801	50 778	
Stella-Jones Inc.			5 950	230 940	288 694	
West Fraser Timber Co., Ltd., négociées hors cote			3 160	341 996	309 522	
Wheaton Precious Metals Corp., TSE			9 760	433 284	516 304	
				<u>2 389 535</u>	<u>2 531 497</u>	4,81
Industries (31 décembre 2021 : 18,63 %)						
Ag Growth International Inc.			3 160	128 804	136 986	
Air Canada			12 790	237 398	247 998	
ATS Corp.			4 310	181 848	181 408	
Bombardier Inc.			8 340	367 072	435 932	
CAE inc., NYSE			17 980	486 411	471 164	
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée, NYSE			2 230	230 554	225 378	
Exchange Income Corp.			5 500	268 436	289 465	
GFL Environmental Inc., NYSE			25 120	964 716	994 889	
K-Bro Linen Inc.			10 460	396 160	285 558	
Parkit Enterprise Inc.			321 300	417 683	401 625	
Groupe SNC-Lavalin inc.			3 170	81 211	75 636	
Stantec Inc., NYSE			21 380	1 372 867	1 388 774	
WSP Global Inc.			1 630	245 177	256 057	
				<u>5 378 337</u>	<u>5 390 870</u>	10,25

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille Au 31 décembre 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Bien de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 3,55 %)						
Linamar Corp.			2 740	156 055	167 962	
Uni-Sélect inc.			20 910	634 384	895 784	
				790 439	1 063 746	2,02
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 7,00 %)						
Alimentation Couche-Tard inc.			6 200	369 894	368 900	
GURU Organic Energy Corp.			10 630	177 825	23 918	
Saputo inc.			25 530	788 231	855 766	
				1 335 950	1 248 584	2,37
Soins de santé (31 décembre 2021 : 0,26 %)						
Services financiers (31 décembre 2021 : 2,47 %)						
Banque de Montréal, TSE			4 950	587 070	607 167	
Brookfield Corp., NYSE			11 490	593 339	489 784	
Element Fleet Management Corp.			83 690	1 455 814	1 544 081	
Fairfax Financial Holdings Ltd.			2 290	1 761 217	1 836 740	
Banque Royale du Canada, NYSE			5 180	689 432	659 897	
La Banque Toronto-Dominion, NYSE			4 140	379 171	363 273	
				5 466 043	5 500 942	10,46
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 3,17 %)						
CGI Inc., NYSE			5 190	607 013	605 968	
Constellation Software Inc.			330	617 028	697 607	
Converge Technology Solutions Corp.			47 030	210 717	215 868	
Docebo Inc.			4 960	195 529	221 910	
Kinaxis Inc.			2 840	421 982	431 424	
Lightspeed Commerce Inc., NYSE			7 890	275 370	152 876	
Payfare Inc.			33 970	172 881	145 731	
				2 500 520	2 471 384	4,70
Services de communication (31 décembre 2021 : 0,39 %)						
Rogers Communications Inc., NYSE			14 421	846 843	915 247	1,74
Services publics (31 décembre 2021 : 1,65 %)						
TransAlta Corp., NYSE			75 418	949 582	916 629	1,74
Immobilier (31 décembre 2021 : 4,00 %)						
Colliers International Group Inc., NASD			6 960	1 032 734	867 984	
DREAM Unlimited Corp.			8 770	257 977	223 021	
Fonds de placement immobilier H&R			56 600	752 615	685 426	
StorageVault Canada Inc.			49 800	291 310	299 796	
				2 334 636	2 076 227	3,95
Total des actions canadiennes – position acheteur				24 877 555	25 023 154	47,57
Actions canadiennes – position vendeur						
Énergie (31 décembre 2021 : -4,34 %)						
Advantage Energy Ltd.			(10 720)	(120 840)	(101 518)	
Enbridge Inc.			(8 350)	(443 727)	(441 882)	
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée			(13 710)	(883 621)	(904 175)	
Corporation Parkland			(4 170)	(118 900)	(123 891)	
PrairieSky Royalty Ltd.			(7 360)	(156 154)	(159 712)	
Secure Energy Services Inc.			(20 370)	(151 520)	(143 201)	
Whitecap Resources Inc.			(41 040)	(395 023)	(440 770)	
				(2 269 785)	(2 315 149)	(4,40)
Matières premières (31 décembre 2021 : -6,26 %)						
Société aurifère Barrick.			(10 540)	(240 105)	(244 633)	
Interfor Corp.			(11 560)	(348 355)	(242 760)	
Wheaton Precious Metals Corp., NYSE			(7 690)	(325 006)	(407 199)	
				(913 466)	(894 592)	(1,70)
Industries (31 décembre 2021 : -2,95 %)						
Groupe Aecon Inc.			(26 430)	(250 513)	(240 777)	
Calian Group Ltd.			(3 810)	(226 600)	(254 470)	
Corporation Internationale Masonite			(3 930)	(396 021)	(429 247)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Mullen Group Ltd.			(8 580)	(113 415)	(124 839)	
Corporation Savaria			(1 080)	(14 216)	(15 109)	
				(1 000 765)	(1 064 442)	(2,02)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -2,20 %)						
La Société Canadian Tire Ltée			(3 290)	(520 172)	(465 535)	
Magna International Inc.			(2 000)	(148 232)	(152 120)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.			(3 210)	(183 071)	(183 195)	
				(851 475)	(800 850)	(1,52)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -4,32 %)						
Metro inc.			(6 150)	(433 757)	(461 066)	(0,88)
Soins de santé (31 décembre 2021 : -0,46 %)						
Services financiers (31 décembre 2021 : -2,97 %)						
La Banque de Nouvelle-Écosse			(10 630)	(757 224)	(705 194)	
Brookfield Asset Management Ltd.			(6 260)	(238 196)	(242 700)	
Banque Canadienne Impériale de Commerce			(8 450)	(496 569)	(462 807)	
CI Financial Corp.			(30 220)	(422 373)	(408 272)	
Corporation Fiera Capital			(19 460)	(166 819)	(168 913)	
Société financière IGM Inc.			(10 120)	(425 102)	(382 536)	
Banque nationale du Canada			(5 400)	(502 161)	(492 642)	
Power Corporation du Canada			(5 260)	(171 531)	(167 531)	
				(3 179 975)	(3 030 595)	(5,76)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : -1,10 %)						
Descartes Systems Group Inc.			(13 430)	(1 178 777)	(1 267 658)	(2,41)
Services de communication (31 décembre 2021 : -0,93 %)						
Services publics (31 décembre 2021 : -1,79 %)						
Capital Power Corp.			(6 260)	(293 780)	(290 026)	
Hydro One Ltd.			(21 250)	(745 657)	(770 738)	
				(1 039 437)	(1 060 764)	(2,02)
Immobilier (31 décembre 2021 : -4,91 %)						
Allied Properties REIT			(2 130)	(71 712)	(54 528)	
Automotive Properties REIT			(2 050)	(27 151)	(26 589)	
FirstService Corp.			(1 300)	(216 755)	(215 553)	
Killam Apartment REIT			(18 490)	(320 127)	(299 723)	
SmartCentres REIT			(9 390)	(278 080)	(251 464)	
				(913 825)	(847 857)	(1,61)
Total des actions canadiennes – position vendeur						
				(11 781 262)	(11 742 973)	(22,32)
Actions américaines – position acheteur						
Matières premières (31 décembre 2021 : 2,78 %)						
Freeport-McMoRan Inc.			15 660	783 782	806 309	1,53
Industries (31 décembre 2021 : 5,73 %)						
AECOM			3 670	360 826	422 331	
Delta Air Lines Inc.			8 430	367 942	375 337	
Griffon Corp.			17 320	741 197	839 915	
Lockheed Martin Corp.			410	272 466	270 261	
Raytheon Technologies Corp.			1 040	140 370	142 212	
Southwest Airlines Co.			3 010	132 916	137 321	
Uber Technologies Inc.			7 540	291 133	252 651	
United Rentals Inc.			5 460	2 337 854	2 629 423	
				4 644 704	5 069 451	9,64
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 4,15 %)						
Dollar Tree Inc.			1 050	213 498	201 228	
Five Below Inc.			3 120	764 638	747 713	
Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc.			1 050	78 232	66 640	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
TJX Cos Inc.			4 880	451 943	526 331	
Ulta Beauty Inc.			520	337 452	330 497	
				<u>1 845 763</u>	<u>1 872 409</u>	3,56
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : 0,54 %)						
Soins de santé (31 décembre 2021 : néant)						
Elevance Health Inc.			620	442 959	430 933	
Humana Inc.			310	218 232	215 139	
				<u>661 191</u>	<u>646 072</u>	1,23
Services financiers (31 décembre 2021 : 1,03 %)						
Globe Life Inc.			3 090	480 735	504 721	
MetLife Inc.			2 570	262 268	252 010	
Progressive Corp.			1 020	176 661	179 267	
Reinsurance Group of America Inc.			610	113 230	117 441	
Wells Fargo & Co.			16 520	995 201	924 232	
				<u>2 028 095</u>	<u>1 977 671</u>	3,76
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : 1,94 %)						
Services de communication (31 décembre 2021 : néant)						
Radius Global Infrastructure Inc.			11 860	220 636	189 945	0,36
Immobilier (31 décembre 2021 : 3,53 %)						
Total des actions américaines – position acheteur						
				<u>10 184 171</u>	<u>10 561 857</u>	20,08
Actions américaines – position vendeur						
Matières premières (31 décembre 2021 : -2,66 %)						
Mercer International Inc., TSE			(18 480)	(364 003)	(291 461)	(0,55)
Industries (31 décembre 2021 : -6,56 %)						
American Airlines Group Inc.			(53 490)	(1 026 155)	(921 904)	
Deluxe Corp.			(6 520)	(317 852)	(150 007)	
Expeditors International of Washington Inc.			(2 030)	(290 106)	(285 839)	
Hawaiian Holdings Inc.			(6 950)	(128 027)	(96 618)	
JELD-WEN Holding Inc.			(29 760)	(402 432)	(389 122)	
Kennametal Inc.			(20 720)	(648 967)	(675 478)	
Middleby Corp.			(2 660)	(478 220)	(482 601)	
Old Dominion Freight Line Inc.			(680)	(229 894)	(261 467)	
Oshkosh Corp.			(5 910)	(686 612)	(706 208)	
Otis Worldwide Corp.			(1 780)	(158 434)	(188 870)	
Terex Corp.			(15 550)	(711 282)	(900 093)	
United Parcel Service Inc., cat. B			(1 860)	(433 242)	(438 116)	
				<u>(5 511 223)</u>	<u>(5 496 323)</u>	(10,45)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : -4,35 %)						
Dick's Sporting Goods Inc.			(890)	(119 051)	(145 059)	
Nordstrom Inc.			(7 110)	(207 603)	(155 489)	
NVR Inc.			(120)	(673 135)	(749 983)	
Polaris Inc.			(2 920)	(399 086)	(399 604)	
RH			(720)	(251 051)	(260 663)	
Target Corp.			(1 940)	(403 722)	(391 769)	
Tesla Inc.			(1 590)	(459 055)	(265 377)	
Urban Outfitters Inc.			(4 740)	(115 777)	(153 177)	
Whirlpool Corp.			(1 180)	(253 603)	(226 173)	
				<u>(2 882 083)</u>	<u>(2 747 294)</u>	(5,22)
Biens de consommation de base (31 décembre 2021 : -1,85 %)						
Hershey Co.			(2 910)	(850 512)	(913 064)	
PepsiCo Inc.			(2 140)	(502 373)	(523 844)	
				<u>(1 352 885)</u>	<u>(1 436 908)</u>	(2,73)
Services financiers (31 décembre 2021 : -2,21 %)						

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2022

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ally Financial Inc.			(15 640)	(573 632)	(518 133)	
Coinbase Global Inc.			(2 380)	(268 352)	(114 126)	
Discover Financial Services			(1 870)	(245 582)	(247 879)	
Franklin Resources Inc.			(8 750)	(251 341)	(312 758)	
Goldman Sachs Group Inc.			(510)	(255 349)	(237 285)	
OneMain Holdings Inc.			(5 210)	(230 515)	(235 146)	
SEI Investments Co.			(3 640)	(255 374)	(287 538)	
T Rowe Price Group Inc.			(3 130)	(461 943)	(462 526)	
US Bancorp			(16 710)	(991 026)	(987 390)	
				(3 533 114)	(3 402 781)	(6,47)
Technologies de l'information (31 décembre 2021 : néant)						
Apple Inc.			(1 520)	(264 915)	(267 596)	(0,51)
Immobilier (31 décembre 2021 : -0,25 %)						
CBRE Group Inc.			(3 670)	(375 880)	(382 699)	
Invitation Homes Inc.			(9 740)	(425 794)	(391 168)	
Iron Mountain Inc.			(6 480)	(414 895)	(437 690)	
Jones Lang LaSalle Inc.			(1 700)	(372 418)	(367 098)	
				(1 588 987)	(1 578 655)	(3,00)
Total des actions américaines – position vendeur				(15 497 210)	(15 221 018)	(28,93)
Actions étrangères – position acheteur						
Industries (31 décembre 2021 : 1,94 %)						
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : 0,31 %)						
Actions étrangères – position vendeur						
Énergie (31 décembre 2021 : -0,40 %)						
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2021 : néant)						
Signet Jewelers Ltd.			(3 040)	(245 027)	(280 097)	(0,53)
Services financiers (31 décembre 2021 : -0,51 %)						
Services publics (31 décembre 2021 : -1,20 %)						
Total des actions étrangères – position vendeur				(245 027)	(280 097)	(0,53)
Fonds négociés en bourse – position vendeur (31 décembre 2021 : -25,31 %)						
BMO S&P 500 Index ETF			(7 240)	(465 649)	(411 594)	
Invesco QQQ Trust Series 1			(2 040)	(807 903)	(736 029)	
iShares Core S&P/TSX Capped Composite Index ETF			(91 380)	(2 909 451)	(2 815 419)	
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF			(7 900)	(1 057 731)	(963 375)	
SPDR Dow Jones Industrial Average ETF Trust			(1 970)	(862 265)	(884 409)	
SPDR S&P 500 ETF Trust			(510)	(266 024)	(264 270)	
SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF			(1 980)	(293 662)	(364 541)	
Total des fonds négociés en bourse – position vendeur				(6 662 685)	(6 439 637)	(12,26)
Commissions de courtage intégrées (note 3)				(28 584)		
Total des placements				52 803 474	54 037 432	102,76
Autres actifs, moins les passifs					(1 453 509)	(2,76)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables					52 583 923	100,00

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2022 et 2021

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 régie par une déclaration de fiducie datée du 1^{er} mai 2012 dans sa version modifiée (la « déclaration de fiducie »). Le Fonds est entré en activité le 5 mars 2021. L'adresse du siège social du Fonds est le 1400 – 130 King St. West, P.O. Box 240, Toronto (Ontario) Canada, M5X 1C8.

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

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

Juste valeur des instruments financiers (note 5)

Classement des placements selon la hiérarchie des justes valeurs

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

Au 31 décembre 2022

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

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

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2022 et 2021

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 l'exercice clos le 31 décembre 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 l'exercice clos le 31 décembre 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 :

2022	Solde à l'ouverture de la période	Parts rachetables émises	Parts rachetables réinvesties	Parts rachetables rachetées	Solde à la clôture de la période
Série A	180 637	45 312	–	(15 145)	210 804
Série F	3 330 483	2 790 816	–	(1 187 798)	4 933 501
Série I	440 000	–	–	–	440 000
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

Aux 31 décembre 2022 et 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
31 décembre 2022 et 2021

Imposition du Fonds (note 7)

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

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

Au cours de l'exercice considéré, 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
31 décembre 2022 et 2021

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 31 décembre 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 46 226 \$, 47 027 \$ et 4 234 115 \$ (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 \$ en 2021).

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

Le Fonds a payé 208 560 \$ (142 623 \$ en 2021) en commissions de courtage et autres coûts de transactions relativement à des opérations de portefeuille durant l'exercice. Aucun paiement indirect n'a été effectué durant l'exercice (aucun en 2021).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises aux 31 décembre 2022 et 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 31 décembre 2022

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

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

Aux 31 décembre 2022 et 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 résument l'exposition du Fonds au risque lié aux taux d'intérêt aux 31 décembre 2022 et 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
31 décembre 2022 et 2021

Au 31 décembre 2022

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

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 35 000 \$ (44 000 \$ en 2021). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Autre risque de prix

Au 31 décembre 2022, environ 4,0 % (6,2 % en 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 192 000 \$ (235 000 \$ en 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 aux 31 décembre 2022 et 2021. Les montants présentés sont fondés sur la valeur comptable des instruments de créance.

Au 31 décembre 2022 :

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

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2022 et 2021

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 l'exercice clos le 31 décembre 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 84,5 % (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 31 décembre 2022, l'exposition totale du Fonds correspondait à 68,2 % (85,3 % en 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 l'exercice clos le 31 décembre 2022 et de la période allant du 5 mars 2021 (début des activités) au 31 décembre 2021, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de néant à 4 841 032 \$ (de néant à 3 358 317 \$ en 2021), avec un taux d'intérêt moyen de 1,91 % (0,32 % en 2021). Au 31 décembre 2022, les emprunts en trésorerie correspondaient à 4,1 % (7,7 % en 2021) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2022 et 2021

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 23 mars 2023.

2 Mode de présentation

a) Déclaration de conformité :

Les états financiers annuels ont été préparés conformément aux Normes internationales d'information financière publiées par l'International Accounting Standards Board (les *International Financial Reporting Standards*, ou « IFRS »). 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

31 décembre 2022 et 2021

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

31 décembre 2022 et 2021

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 »

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2022 et 2021

de l'état du résultat global.

k) Contrats de change à terme :

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

l) Contrats à terme sur obligations :

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

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

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

m) Contrats à terme normalisés :

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

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2022 et 2021

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

31 décembre 2022 et 2021

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

31 décembre 2022 et 2021

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 rachetable » 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

31 décembre 2022 et 2021

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 31 décembre 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

31 décembre 2022 et 2021

9 Commissions de courtage et accords de paiement indirect

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

10 Gestion des risques financiers

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

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

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

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

Les incertitudes économiques quant aux pressions inflationnistes persistantes, l'incertitude géopolitique et la pandémie de COVID-19 qui se prolonge pourraient ralentir la croissance de l'économie mondiale. L'établissement d'estimations fiables et l'exercice du jugement demeurent très complexes. Les résultats réels peuvent différer de ces estimations et hypothèses.

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

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2022 et 2021

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

31 décembre 2022 et 2021

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 31 décembre 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)

Après le 31 décembre 2022, le gestionnaire a remplacé le taux interbancaire offert à Londres (ICE LIBOR) à 1 mois en dollars américains par le SOFR, et il s'attend à ce que tout soit prêt bien avant la date d'expiration du taux CDOR à 3 mois dans le cadre de la réforme.

Autre risque de prix

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

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

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

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

Risque de crédit

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

Les Fonds évaluent le risque de crédit et les pertes de crédit attendues à l'aide des mesures suivantes : la probabilité de défaillance, l'exposition en cas de défaillance et la perte en cas de défaillance. Pour établir les pertes de crédit attendues, le gestionnaire se fonde à la fois sur des analyses historiques et sur des informations prospectives. Aux 31 décembre 2022 et 2021, 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

31 décembre 2022 et 2021

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 31 décembre 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 aux 31 décembre 2022 et 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

31 décembre 2022 et 2021

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 des exercices clos les 31 décembre 2022 et 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

31 décembre 2022 et 2021

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.

14 Événements postérieurs à la date de clôture

Au 31 décembre 2022, les Fonds étaient exposés au secteur bancaire. Après la clôture de l'exercice, les Fonds étaient toujours exposés à ce secteur. Dans certains cas, les organismes gouvernementaux ont pris le contrôle de certaines banques ou sont intervenus d'une autre manière dans leurs activités en raison de problèmes de liquidité et de solvabilité. L'ampleur de la situation demeure incertaine et, à ce titre, le gestionnaire continue d'évaluer les risques dans l'ensemble du secteur financier et prendra les mesures qui s'imposent. La résolution ultime de ces problèmes de liquidité et de solvabilité est incertaine et l'ampleur des répercussions connexes sur les Fonds pourrait être importante.